

## 【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15日提出
【計算期間】	第3期(自 2019年6月25日至 2020年6月22日)
【ファンド名】	野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040
【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】

国内および外国（新興国を含む）の各債券、国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）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」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」とします。

## 信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、2兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

## &lt;商品分類&gt;

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

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

（野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040）

## 《商品分類表》

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

## 《属性区分表》

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回  年2回  年4回	<b>グローバル (日本を含む)</b>  日本			
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)  年12回 (毎月)  日々	北米  欧州  アジア  オセアニア	<b>ファミリーファンド</b>	あり ( )	日経225   T O P I X
不動産投信  <b>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))</b>	日々  その他 ( )	中南米  アフリカ  中近東 (中東)  エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	<b>なし</b>	<b>その他 (合成指数)</b>
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のないファンドをいう。
- (2) 追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

##### [ 投資対象地域による区分 ]

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

##### [ 投資対象資産による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載

があるものをいう。

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

#### [ 投資対象資産による属性区分 ]

##### 株式

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

##### 債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

#### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

#### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

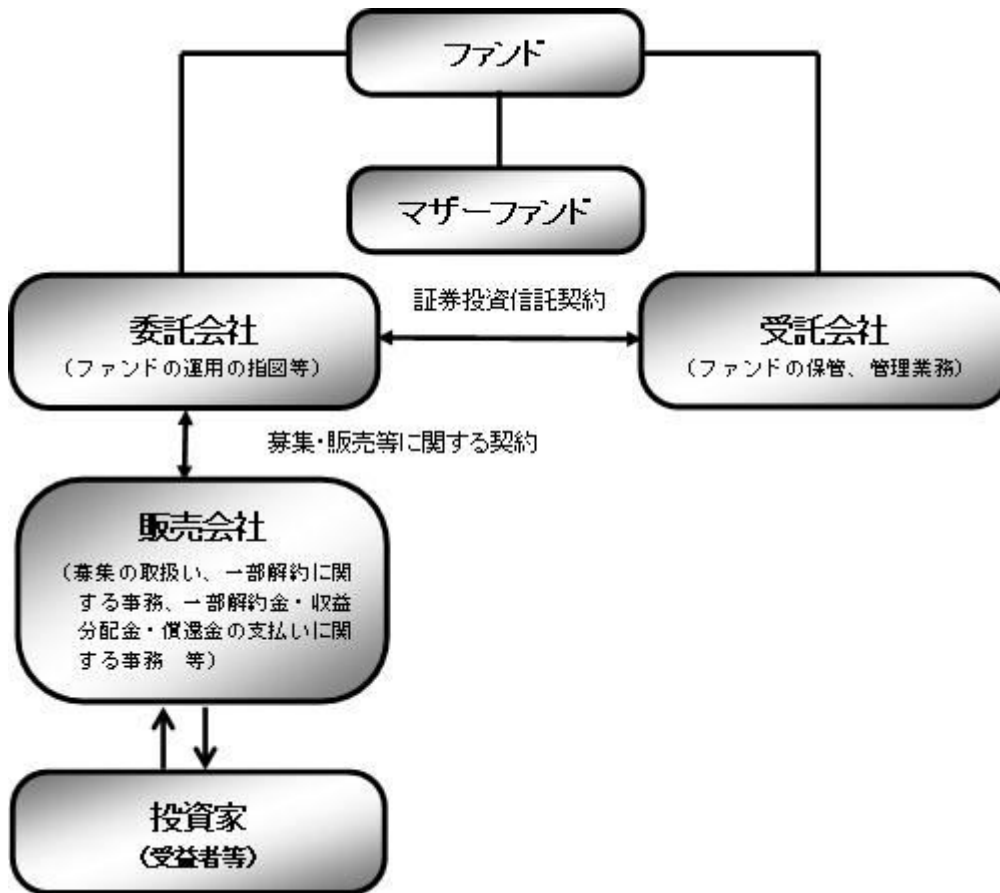
#### [ 特殊型 ]

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

## ( 2 ) 【ファンドの沿革】

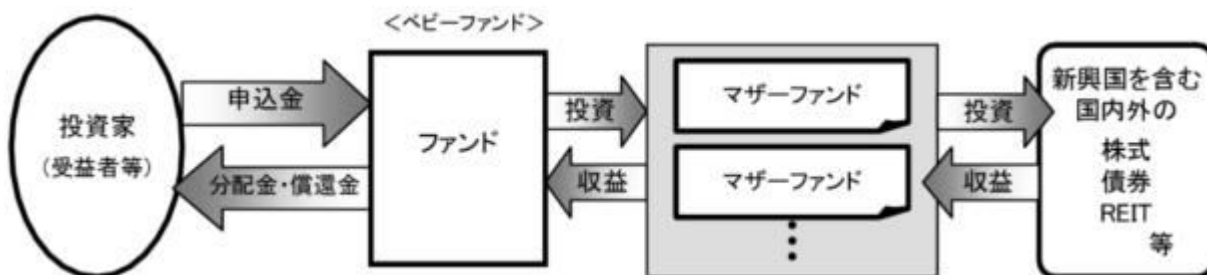
2017年8月31日	信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始
2019年10月1日	「野村資産設計ファンド(DC)2040」から「野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040」へ名称を変更

## ( 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。



<b>ファンド</b>	野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040
<b>マザーファンド (親投資信託)</b>	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
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド
	国内株式マザーファンド
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド
	新興国株式マザーファンド
	J-REITインデックス マザーファンド
	海外REITインデックス マザーファンド
<b>委託会社(委託者)</b>	野村アセットマネジメント株式会社

## 受託会社(受託者)

野村信託銀行株式会社

## 委託会社の概況(2020年7月末現在)

## ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

## ・大株主の状況

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

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

2040年6月の決算日の翌日(第24計算期間開始日)をターゲットイヤー(安定運用開始時期)とし、ターゲットイヤーに近づくにしたがって、リスクを徐々に減らすことを基本とします。

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。

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

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
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI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)

新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債	JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース) ・JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース)をもちに、委託会社が円換算したものです。
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) ・MSCI-KOKUSAI 指数をもちに、委託会社が円換算したものです。
新興国株式マザーファンド	新興国の株式(DR(預託証券) <sup>*1</sup> を含みます。)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース) ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み・ドルベース)をもちに、委託会社が円換算したものです。
J-REITインデックスマザーファンド	J-REIT <sup>*2</sup>	東証REIT指数(配当込み)
海外REITインデックスマザーファンド	日本を除く世界各国のREIT <sup>*3</sup>	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース) ・S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)をもちに、委託会社が円換算したものです。

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

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

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

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、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数をベンチマークとします。

当初設定以降、定期的に各マザーファンドへの基本投資割合を変更し、安定運用開始時期に近づくにしたがって、株式への実質投資割合を徐々に減らし債券への実質投資割合を徐々に増やすことで、リスクを徐々に減らす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、原則年1回行なうことを基本とします。

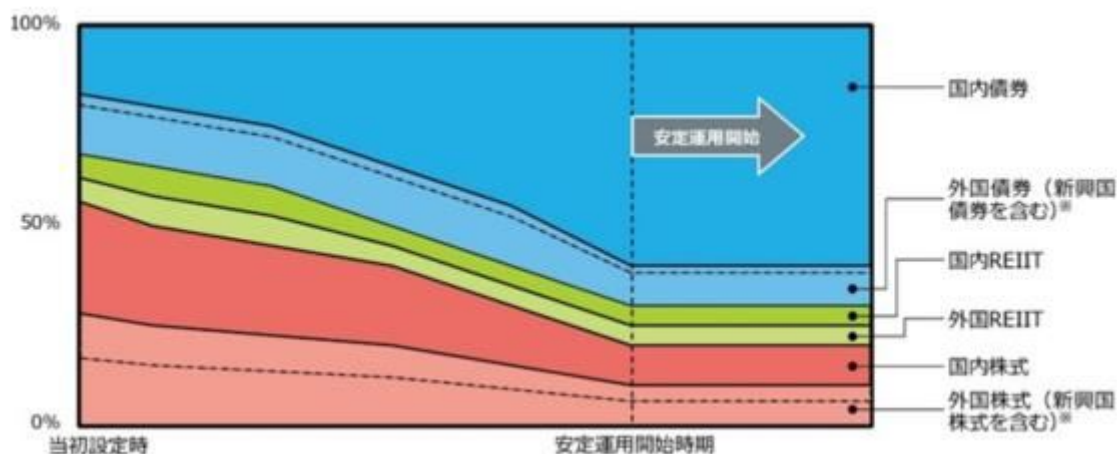
当初設定時および安定運用開始時期以降のマザーファンドを通じた各資産への基本投資割合はそれぞれ以下を基本とします。



## 基本投資割合

		当初設定時	安定運用 開始時期以降	2020年9月 現在
国内債券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	17.0%	60%	20.0%
外国債券	外国債券マザーファンド	12.3%	10%	9.7%
	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2.7%		5.3%
国内株式	国内株式マザーファンド	28.0%	10%	25.0%
外国株式	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16.8%	10%	14.4%
	新興国株式マザーファンド	11.2%		10.6%
国内REIT	J-REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	7.5%
外国REIT	海外REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	7.5%

## 基本投資割合のイメージ図



新興国債券、新興国株式の割合は、各々外国債券、外国株式内に点線で示しています。

\* 上記の図表は現時点で決定している基本投資割合をもとにしたイメージ図です。

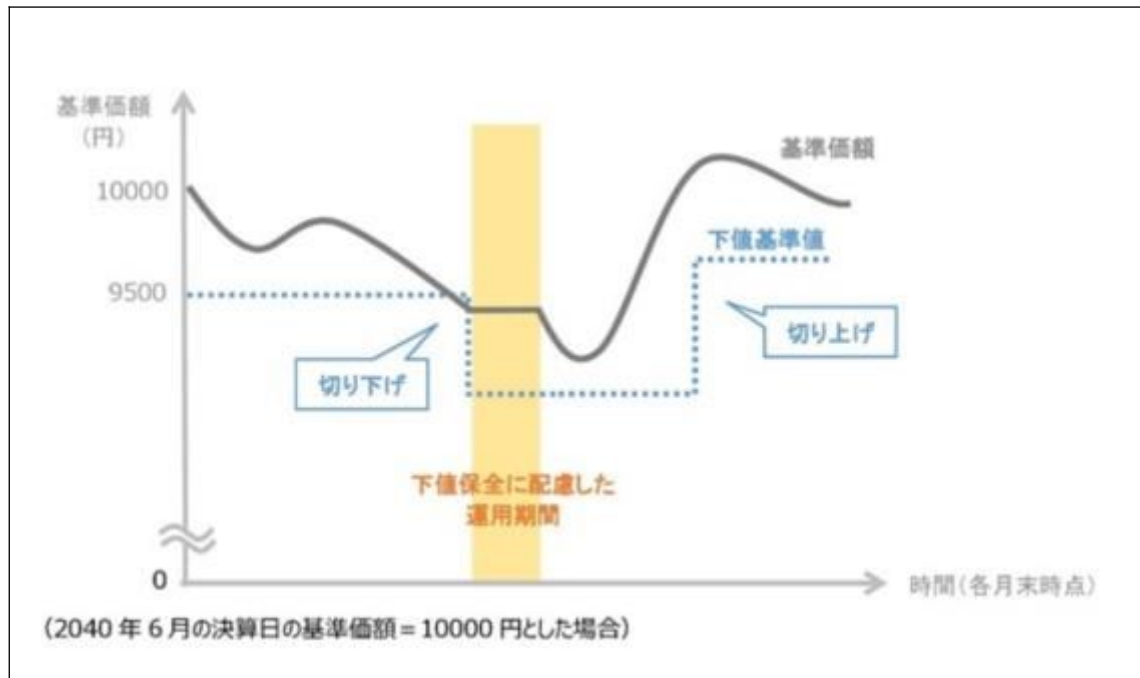
安定運用開始時期以降は、各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する各資産への実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する運用（「下値保全に配慮した運用」といいます。）を行ないます。

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。

下値保全に配慮した運用を行なうにあたっては、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的で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。

- ・ 委託会社の定める下値基準値は、当初、2040年6月の決算日の基準価額の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月の決算日）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。
- ・ 下値保全に配慮した運用に切り替えた場合の、下値保全に配慮した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。
- ・ 下値保全に配慮した運用期間終了後は、安定運用期における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いません。ただし、2040年6月の決算日の翌日以降、下値保全に配慮した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。

各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

## NOMURA-BPI総合

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本、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」

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

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

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

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

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

## 東証株価指数（TOPIX）

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

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

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

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

本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額とTOPIXの指

数値の動向が乖離することがあります。

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

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

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

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

#### 「MSCI-KOKUSAI指数」、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」

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

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

#### 東証REIT指数（配当込み）

東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証REIT指数（配当込み）の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用など東証R

E I T指数(配当込み)に関するすべての権利及び東証R E I T指数(配当込み)の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。

(株)東京証券取引所は、東証R E I T指数(配当込み)の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証R E I T指数(配当込み)の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証R E I T指数(配当込み)の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

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

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

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

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

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

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

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

#### S&P先進国REIT指数

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2)【投資対象】

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(新興国を含む)の各債券、国内および外国(新興国を含む)の各株式、国内および外国の各不動産投資信託証券(REIT)に投資を行ない

ます。なお、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。

#### 各マザーファンドの主要投資対象

マザーファンド名	主要投資対象
国内債券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
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債
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
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT
海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国のREIT

#### 投資の対象とする資産の種類（信託約款）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 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」、「（6）及び（7）」に定めるものに限りません。）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。）

- 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみだす資産

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

#### 有価証券の指図範囲等（信託約款）

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された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。

- 株券または新株引受権証券

- 国債証券

- 地方債証券

- 特別の法律により法人の発行する債券

- 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、新株予約権付社債券のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債券についての社債券であって当該社債券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券を総称して以下「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. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

#### 金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）



## 3. コール・ローン

## 4. 手形割引市場において売買される手形

## 5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

## 6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

## 7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）

## 8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）

## 9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの

## 10. 流動性のある外国の者に対する貸付債権

## その他の投資対象

## 1. 先物取引等

## 2. スワップ取引

## 3. 金利先渡取引

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

## 4. 為替先渡取引

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

## 5. 直物為替先渡取引

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

## (参考)各マザーファンドの概要

## （国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

## （外国債券マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

## (新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド)

### 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建

ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（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いません。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行いません。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行いません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総

額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。

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

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

## (新興国株式マザーファンド)

### 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

##### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

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

## (J-REITインデックス マザーファンド)

### 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

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

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

##### (2) 投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

##### (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

## （海外REITインデックス マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

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

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

## 2. 運用方法

## (1) 投資対象

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

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

## (2) 投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

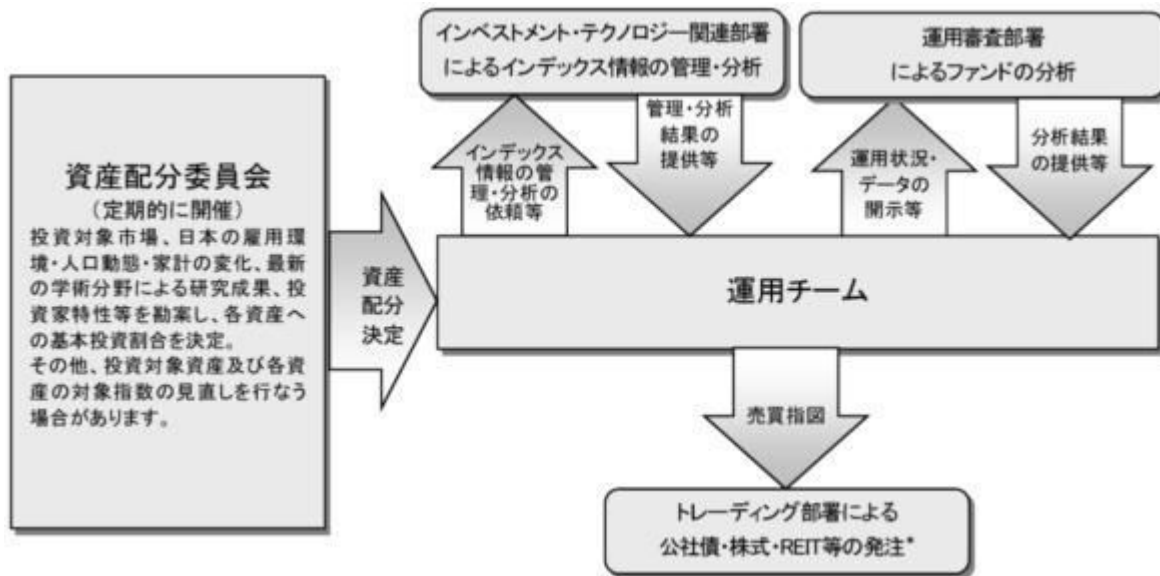
一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

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

## (3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。



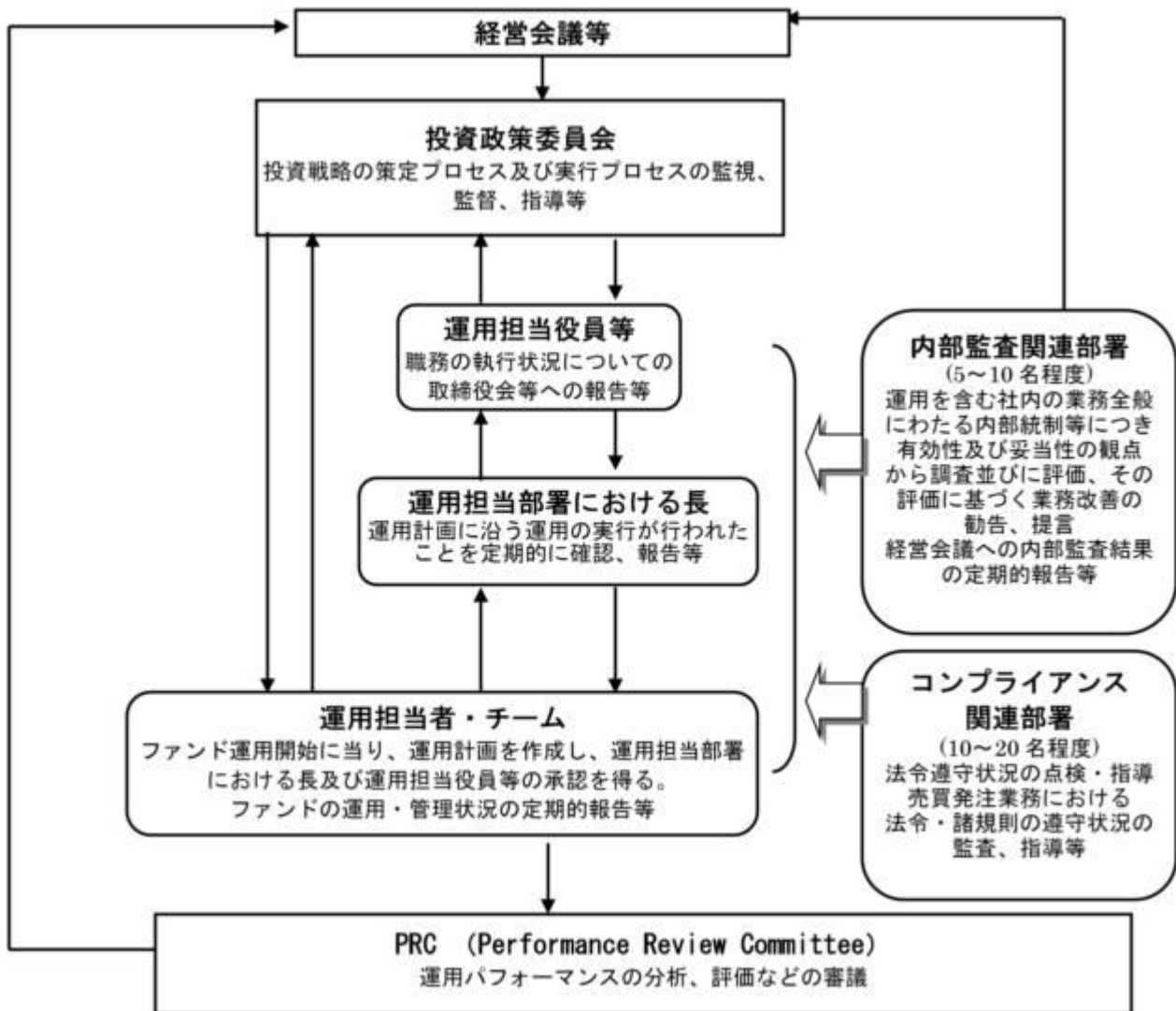


\*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴う裁量権は付与しないものとし、）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドに代行させます。運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

\* 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22日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

## (5) 【投資制限】

運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限 (信託約款)

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

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

#### 先物取引等の運用指図(信託約款)

- ( )委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引ならびに有価証券店頭デリバティブ取引(金融商品取引法第28条第8項第4号イからニに掲げるものをいいます。以下同じ。)を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)
- ( )委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( )委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( )上記( )の店頭デリバティブ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( )委託者は、上記( )の店頭デリバティブ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

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

- ( ) 上記( )に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ( ) 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

#### 公社債の借入れ(信託約款)

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

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

#### 直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

#### 資金の借入れ(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資

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

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

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### 基準価額の変動要因

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

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

#### [株価変動リスク]

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

#### [REITの価格変動リスク]

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

#### [債券価格変動リスク]

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

#### [為替変動リスク]

ファンドは、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。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいもの

になることも想定されます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

#### その他の留意点

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

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、下値保全に配慮した運用期間中は、ファンドの基準価額は合成指数に連動しません。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。

安定運用開始時期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、下値保全に配慮した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

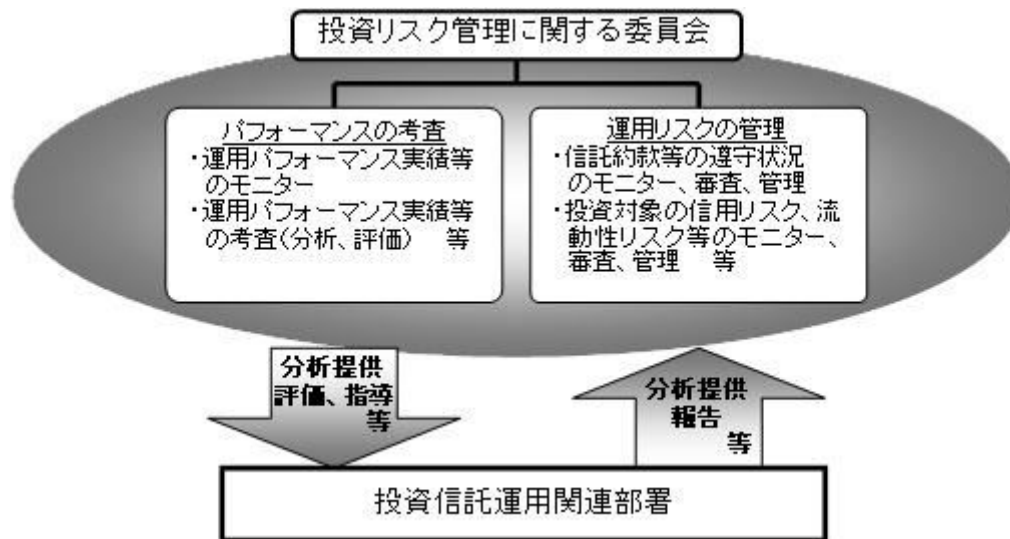
##### パフォーマンスの考査

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。

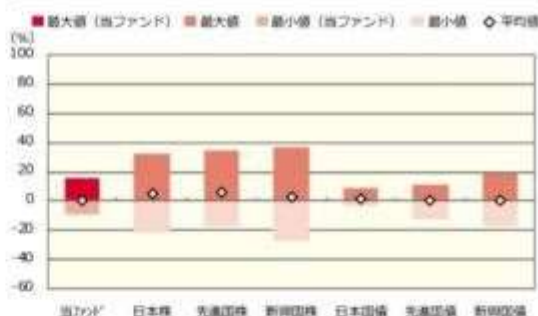


## ■ リスクの定量的比較 (2015年8月末～2020年7月末：月次)

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 (%)	15.3	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 8.7	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	0.9	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、2018 年 8 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 2018 年 8 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-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）

### ■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東東京証券取引所）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、東東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東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、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。両指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、両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、野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。両指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や利益を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを保持したり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての種別、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMS LLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

## 4 【手数料等及び税金】

### （1）【申込手数料】

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。

信託報酬率の配分については、次の通り(税抜)とします。

計算期間	1期～23期 (設定日～2040年決算日)	24期以降 (2040年決算日翌日以降)
信託報酬率	年0.462% (税抜年0.42%)	年0.418% (税抜年0.38%)
委託会社	年0.19%	年0.17%
販売会社	年0.19%	年0.17%
受託会社	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	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

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

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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下記の通りです。

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15.315%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### 換金（解約）時および償還時の課税について

##### [ 個人の投資家の場合 ]

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

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

##### [ 法人の投資家の場合 ]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

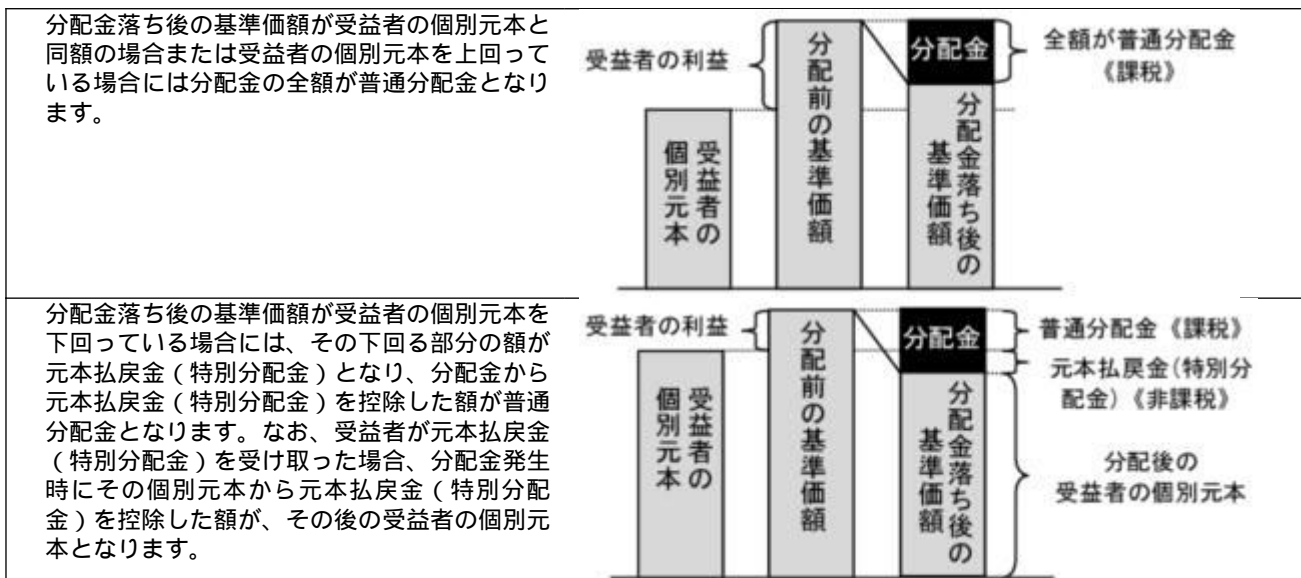
#### 個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

#### 分配金の課税について

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



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

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

\* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(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】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

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	56,978,512	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）		57,632	0.10
合計（純資産総額）		57,036,144	100.00

（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

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	メキシコ	654,865,764	9.74
	ブラジル	635,874,820	9.46
	チリ	156,267,369	2.32
	コロンビア	375,179,621	5.58
	ペルー	230,115,566	3.42
	ウルグアイ	9,490,089	0.14
	ドミニカ共和国	14,131,348	0.21
	トルコ	182,711,970	2.71
	チェコ	341,301,309	5.07
	ハンガリー	247,764,284	3.68
	ポーランド	575,215,113	8.56
	ロシア	533,931,247	7.94
	ルーマニア	198,738,805	2.95
	マレーシア	450,908,378	6.71
	タイ	572,988,829	8.52
	フィリピン	26,940,453	0.40
	インドネシア	617,575,632	9.19
	南アフリカ	474,566,933	7.06
		中国	245,777,633
	小計	6,544,345,163	97.39
現金・預金・その他資産（負債控除後）		175,068,496	2.60
合計（純資産総額）		6,719,413,659	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)新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	6,872,814,031	15.80
	メキシコ	671,279,058	1.54
	ブラジル	2,323,679,195	5.34
	チリ	116,859,945	0.26
	コロンビア	37,410,092	0.08
	ギリシャ	51,735,888	0.11
	イギリス	38,621,184	0.08
	トルコ	161,461,046	0.37
	チェコ	40,556,600	0.09
	ハンガリー	86,911,641	0.19
	ポーランド	293,786,577	0.67
	香港	9,758,471,927	22.44
	マレーシア	731,676,521	1.68
	タイ	835,416,741	1.92
	フィリピン	314,494,635	0.72
	インドネシア	586,120,226	1.34
	韓国	4,841,702,427	11.13
	台湾	5,454,967,989	12.54
	インド	3,393,290,297	7.80
	パキスタン	10,228,502	0.02
カタール	327,807,484	0.75	
エジプト	43,468,641	0.09	
南アフリカ	1,558,250,500	3.58	



	アラブ首長国連邦	200,597,950	0.46
	サウジアラビア	1,042,759,136	2.39
	小計	39,794,368,233	91.51
投資信託受益証券	アメリカ	1,750,484,661	4.02
投資証券	メキシコ	17,614,624	0.04
	南アフリカ	16,497,625	0.03
	小計	34,112,249	0.07
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,907,363,444	4.38
合計(純資産総額)		43,486,328,587	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	1,599,689,640	3.67
	買建	シンガポール	267,841,375	0.61

## (参考) J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	34,518,933,048	96.60
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,213,745,277	3.39
合計(純資産総額)		35,732,678,325	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
REIT指数先物取引	買建	日本	1,212,015,500	3.39

## (参考) 海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	20,196,940,099	74.49
	カナダ	509,460,586	1.87
	ドイツ	73,209,888	0.27
	イタリア	3,792,172	0.01

	フランス	571,512,705	2.10
	オランダ	46,081,400	0.16
	スペイン	129,808,265	0.47
	ベルギー	340,455,944	1.25
	アイルランド	39,260,829	0.14
	イギリス	1,481,591,829	5.46
	オーストラリア	1,753,270,581	6.46
	ニュージーランド	125,723,037	0.46
	香港	474,508,800	1.75
	シンガポール	1,105,707,014	4.07
	韓国	12,843,512	0.04
	イスラエル	16,372,944	0.06
	小計	26,880,539,605	99.15
現金・預金・その他資産(負債控除後)		230,092,042	0.84
合計(純資産総額)		27,110,631,647	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	205,774,350	0.75

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040

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	8,876,245	1.6143	14,329,787	1.5330	13,607,283	23.85
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	8,541,387	1.3297	11,357,534	1.3322	11,378,835	19.95
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	2,903,063	2.8307	8,217,766	2.9070	8,439,204	14.79
4	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	5,063,196	1.1905	6,027,839	1.2629	6,394,310	11.21
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	2,254,071	2.4057	5,422,642	2.4640	5,554,030	9.73
6	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックスマ ザーファンド	2,109,592	2.0341	4,291,143	2.0541	4,333,312	7.59
7	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックスマ ザーファンド	2,022,118	2.1171	4,281,163	2.1087	4,264,040	7.47
8	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	2,285,854	1.3119	2,998,915	1.3157	3,007,498	5.27

## 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
-----	-------

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （%）	償還期限	投資 比率 （%）
1	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,810,000,000	3.57	171,884,244	3.56	171,643,657	9.85	2027/6/28	2.55
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,611.36	161,136,332	1,582.67	158,267,173	3.48	2027/6/29	2.35
3	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,302.38	140,451,395	2,327.35	141,968,711	10	2023/1/1	2.11
4	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000	3,021.74	120,869,627	3,033.31	121,332,520	2.5	2024/4/25	1.80
5	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	23,600,000	458.61	108,232,388	480.57	113,414,879	1	2026/6/26	1.68
6	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,300,000	3,056.32	100,858,680	3,191.46	105,318,472	2.75	2029/10/25	1.56
7	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000	2,393.44	98,371,414	2,420.97	99,502,218	10	2025/1/1	1.48
8	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,100,000	1,862.18	94,971,282	1,903.18	97,062,340		2022/1/1	1.44
9	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,400,000	457.97	93,426,560	473.29	96,552,156	0.45	2023/10/25	1.43
10	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,900,000	3,039.50	88,145,679	3,148.71	91,312,692	4	2023/10/25	1.35
11	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,900,000	1,799.07	88,154,631	1,862.15	91,245,741		2022/7/1	1.35
12	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000	2,970.66	89,119,944	3,021.40	90,642,244	2.25	2024/10/25	1.34
13	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,300,000	704.05	79,558,116	715.51	80,852,856	10.5	2026/12/21	1.20
14	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000	2,469.49	79,029,836	2,459.47	78,703,098	10	2027/1/1	1.17
15	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000	2,618.77	75,944,477	2,703.17	78,392,119	3.733	2028/6/15	1.16
16	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000	158.36	75,541,174	161.97	77,260,110	7.95	2026/10/7	1.14
17	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000	2,920.03	75,921,006	2,919.22	75,899,811	2.25	2022/4/25	1.12
18	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,850,000	498.36	69,023,278	531.94	73,674,763	7.5	2027/6/3	1.09
19	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000	1,621.77	72,979,920	1,603.48	72,156,810	3.6	2030/5/21	1.07
20	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,614.87	67,986,780	2,663.42	69,248,960	4.181	2024/7/15	1.03
21	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,000,000	589.09	70,691,717	574.86	68,983,200	8	2030/1/31	1.02
22	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000	0.74	65,599,560	0.77	68,365,440	8.125	2024/5/15	1.01
23	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000	2,914.26	64,113,926	2,978.46	65,526,187	2.5	2023/1/25	0.97
24	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,300,000	539.03	60,911,401	568.05	64,190,469	8.5	2029/5/31	0.95
25	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,700,000	358.73	63,495,464	359.29	63,595,151	2.125	2026/12/17	0.94
26	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	13,200,000	447.07	59,014,349	475.20	62,727,667	0.95	2030/5/15	0.93
27	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000	2,529.93	63,250,572	2,501.89	62,547,368	10	2029/1/1	0.93

28	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,160,000,000	2.89	62,465,203	2.88	62,331,271	7.75	2021/4/14	0.92
29	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000	552.43	60,215,851	570.16	62,147,603	10	2024/12/5	0.92
30	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	16,700,000	364.27	60,834,593	364.28	60,835,992	3.625	2023/6/16	0.90

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.39
合計	97.39

## (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MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	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 (GENUSSCHEINE)	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) 新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネット販 売・通信販 売	119,390	21,255.22	2,537,661,573	26,436.60	3,156,266,151	7.25
2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	363,800	5,690.01	2,070,026,860	7,222.50	2,627,545,500	6.04
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,564,000	1,062.94	1,662,443,029	1,545.04	2,416,442,560	5.55
4	アメリカ	投資信託受 益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		500,300	2,946.94	1,474,355,514	3,498.87	1,750,484,661	4.02
5	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュー タ・周辺機 器	303,960	4,305.09	1,308,576,523	5,192.00	1,578,160,320	3.62
6	香港	株式	MEITUAN DIANPING B	インター ネット販 売・通信販 売	227,100	1,782.20	404,737,985	2,632.50	597,840,750	1.37
7	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インター ネット販 売・通信販 売	28,410	18,715.79	531,715,748	19,507.87	554,218,729	1.27
8	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	182,600	2,195.98	400,986,126	2,973.47	542,957,174	1.24
9	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,146,000	83.33	512,149,921	77.89	478,742,670	1.10
10	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	378,000	1,062.89	401,773,830	1,115.77	421,762,950	0.96
11	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インター ネット販 売・通信販 売	54,520	5,153.54	280,971,353	6,515.53	355,226,914	0.81
12	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	219,700	958.66	210,618,234	1,355.64	297,835,097	0.68
13	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	238,121	1,002.86	238,803,030	1,242.55	295,878,582	0.68
14	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信 サービス	395,000	796.41	314,583,372	716.85	283,155,750	0.65

15	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	105,800	2,396.31	253,530,621	2,553.01	270,109,146	0.62
16	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	35,170	7,472.23	262,798,438	7,506.40	264,000,088	0.60
17	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	娯楽	5,260	39,090.58	205,616,476	47,197.61	248,259,439	0.57
18	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,910,000	68.98	269,736,377	62.77	245,450,250	0.56
19	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	53,150	3,688.81	196,060,416	4,452.80	236,666,320	0.54
20	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	95,538	1,463.78	139,847,070	2,431.47	232,298,736	0.53
21	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	803,649	273.27	219,614,341	277.67	223,157,254	0.51
22	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラクティブ・メディアおよびサービス	17,700	10,630.24	188,155,421	12,342.80	218,467,560	0.50
23	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	673,300	279.25	188,022,963	308.94	208,010,901	0.47
24	アメリカ	株式	TAL EDUCATION GROUP-ADR	各種消費者サービス	24,830	5,865.80	145,647,969	8,158.80	202,583,004	0.46
25	韓国	株式	NAVER CORP	インタラクティブ・メディアおよびサービス	7,780	18,832.00	146,512,960	25,872.00	201,284,160	0.46
26	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	382,000	529.42	202,240,317	511.91	195,550,537	0.44
27	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	26,860	6,917.21	185,796,402	7,215.30	193,803,173	0.44
28	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	58,400	2,698.08	157,568,324	3,214.09	187,703,148	0.43
29	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	5,139,000	39.24	201,702,619	35.37	181,766,430	0.41
30	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	314,691	458.87	144,404,013	563.98	177,481,570	0.40

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	7.61
		メディア	0.22
		娯楽	1.15
		不動産管理・開発	2.07
		エネルギー設備・サービス	0.06
		石油・ガス・消耗燃料	5.35
		化学	2.03
		建設資材	0.90
		容器・包装	0.04
		金属・鉱業	3.20
		紙製品・林産品	0.16
		航空宇宙・防衛	0.07
		建設関連製品	0.04
		建設・土木	0.48
		電気設備	0.25
		コングロマリット	0.97
		機械	0.36
		商社・流通業	0.02
		商業サービス・用品	0.24
		航空貨物・物流サービス	0.24
		旅客航空輸送業	0.10
		海運業	0.08
		陸運・鉄道	0.24
		運送インフラ	0.55
		自動車部品	0.32
		自動車	1.65
		家庭用耐久財	0.24
		レジャー用品	0.08
		繊維・アパレル・贅沢品	0.69
		ホテル・レストラン・レジャー	0.59
		インターネット販売・通信販売	11.52
		複合小売り	0.49
		専門小売り	0.41
食品・生活必需品小売り	1.41		
飲料	0.82		

	食品	1.74
	タバコ	0.31
	家庭用品	0.51
	パーソナル用品	0.61
	ヘルスケア機器・用品	0.39
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.51
	バイオテクノロジー	0.58
	医薬品	1.21
	銀行	11.16
	各種金融サービス	0.49
	保険	2.99
	情報技術サービス	1.60
	ソフトウェア	0.29
	通信機器	0.13
	コンピュータ・周辺機器	5.28
	電子装置・機器・部品	1.98
	半導体・半導体製造装置	7.75
	各種電気通信サービス	1.20
	無線通信サービス	2.17
	電力	0.81
	ガス	0.52
	総合公益事業	0.04
	水道	0.19
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.63
	消費者金融	0.17
	資本市場	1.06
	各種消費者サービス	0.99
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.41
	ヘルスケア・テクノロジー	0.24
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.55
	専門サービス	0.03
	その他の業種	0.00
投資信託受益証券		4.02
投資証券		0.07
合 計		95.61

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,858	694,003	2,677,464,820	592,000	2,283,936,000	6.39
2	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,028	292,528	1,763,363,801	364,500	2,197,206,000	6.14
3	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,984	595,904	2,374,085,108	540,000	2,151,360,000	6.02
4	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	11,455	142,192	1,628,816,315	175,700	2,012,643,500	5.63
5	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,883	147,446	1,899,549,219	130,800	1,685,096,400	4.71
6	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,684	257,014	1,460,872,313	274,700	1,561,394,800	4.36
7	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,784	311,865	1,180,099,735	341,000	1,290,344,000	3.61
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,938	163,233	1,295,744,148	135,900	1,078,774,200	3.01
9	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,137	161,731	830,816,000	197,400	1,014,043,800	2.83
10	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,530	163,620	1,232,059,282	126,900	955,557,000	2.67
11	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,324	625,517	828,184,859	681,000	901,644,000	2.52
12	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,520	137,378	1,170,465,525	102,900	876,708,000	2.45
13	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,603	277,445	722,190,739	317,000	825,151,000	2.30
14	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,718	72,433	848,780,435	69,100	809,713,800	2.26
15	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,724	154,711	576,144,723	192,700	717,614,800	2.00
16	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,232	644,982	794,618,464	578,000	712,096,000	1.99
17	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,996	421,535	841,384,040	348,500	695,606,000	1.94
18	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,480	365,098	905,445,480	278,300	690,184,000	1.93
19	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,142	439,710	502,148,880	577,000	658,934,000	1.84
20	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,584	144,529	662,522,167	137,100	628,466,400	1.75
21	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,738	312,410	542,970,161	331,000	575,278,000	1.60
22	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,026	98,211	493,610,756	107,000	537,782,000	1.50
23	日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,599	181,709	472,264,058	193,300	502,386,700	1.40
24	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,834	51,415	659,866,550	38,150	489,617,100	1.37
25	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	849	639,747	543,145,614	553,000	469,497,000	1.31
26	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,598	124,162	446,738,192	118,700	427,082,600	1.19
27	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,041	119,259	481,929,311	104,000	420,264,000	1.17
28	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,294	387,211	501,051,226	319,500	413,433,000	1.15
29	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,697	137,642	508,865,127	111,800	413,324,600	1.15
30	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,658	34,469	574,186,810	24,200	403,123,600	1.12



## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.60
合計	96.60

## (参考) 海外REITインデックス マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	168,810	10,179.64	1,718,426,048	11,002.87	1,857,395,160	6.85
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	20,230	72,376.84	1,464,183,582	81,373.56	1,646,187,321	6.07
3	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	61,360	14,810.45	908,769,225	16,603.15	1,018,769,775	3.75
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	34,390	22,069.53	758,971,429	20,680.46	711,201,226	2.62
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	95,600	6,209.09	593,589,519	5,702.79	545,186,915	2.01
6	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,880	16,766.55	484,218,054	18,423.19	532,061,958	1.96
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	32,210	18,181.93	585,640,271	15,815.51	509,417,899	1.87
8	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	78,600	6,567.62	516,215,435	6,333.53	497,815,458	1.83
9	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	372,600	1,122.48	418,236,821	1,282.04	477,689,483	1.76
10	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	70,000	9,002.76	630,193,243	6,654.65	465,825,640	1.71
11	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	80,100	6,822.42	546,476,023	5,643.17	452,017,917	1.66
12	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	124,600	2,976.53	370,876,245	3,119.17	388,648,831	1.43
13	香港	投資証券	LINK REIT	472,000	923.59	435,939,170	814.05	384,231,600	1.41
14	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	123,300	3,036.64	374,417,792	2,905.78	358,283,660	1.32
15	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	272,900	1,183.77	323,051,133	1,305.69	356,322,899	1.31
16	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	84,400	3,859.76	325,764,357	4,180.86	352,864,753	1.30
17	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	22,520	15,124.22	340,597,657	15,448.37	347,897,383	1.28
18	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,990	27,949.14	418,957,653	23,076.85	345,922,011	1.27
19	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	85,500	4,537.72	387,975,416	4,030.23	344,585,349	1.27
20	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,210	13,013.68	341,088,780	12,292.59	322,188,836	1.18
21	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	29,590	10,754.95	318,239,025	10,617.94	314,185,022	1.15
22	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	33,120	10,882.54	360,429,948	9,233.04	305,798,351	1.12
23	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	41,800	6,949.54	290,491,145	7,064.68	295,303,791	1.08
24	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	39,200	7,418.63	290,810,594	7,377.43	289,195,570	1.06
25	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	120,200	2,140.56	257,295,499	2,152.66	258,750,694	0.95
26	アメリカ	投資証券	UDR INC	67,600	4,348.93	293,987,819	3,776.06	255,261,656	0.94
27	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	106,400	2,299.15	244,630,216	2,265.63	241,063,670	0.88
28	アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	26,220	7,956.79	208,627,137	8,699.58	228,103,040	0.84
29	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	22,130	10,439.07	231,016,840	9,724.66	215,206,770	0.79
30	アメリカ	投資証券	AMERICOLD REALTY TRUST	46,000	3,697.24	170,073,324	4,220.61	194,148,060	0.71

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.15

合 計	99.15
-----	-------

**【投資不動産物件】**

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040

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。

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)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)新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)J-REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

**【その他投資資産の主要なもの】**

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040

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。

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）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）新興国株式マザーファンド

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	インター コンチネ タル取 引所	E-mini MSCIエ マージングマ ーケット株 価指数先 物(2020年09月限)	買建	284	米ドル	14,517,650	1,518,546,190	15,293,400	1,599,689,640	3.67

シンガポール	シンガポール取引所	SGX FTSE China A50 指数先物(2020年08月限)	買建	170	米ドル	2,626,075	274,687,445	2,560,625	267,841,375	0.61
--------	-----------	------------------------------------	----	-----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

## (参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数先物 取引	大阪取引所	REIT指数先物(2020年09月限)	買建	733	日本円	1,274,320,500	1,212,015,500	3.39

## (参考) 海外 R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ ボード オブ トレード	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2020年09月限)	買建	61	米ドル	1,921,680	201,007,728	1,967,250	205,774,350	0.75

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040

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22日)	3	3	1.0433	1.0438
第2計算期間	(2019年 6月24日)	11	11	1.0457	1.0462
第3計算期間	(2020年 6月22日)	50	50	1.0454	1.0459
	2019年 7月末日	12		1.0594	
	8月末日	13		1.0364	
	9月末日	20		1.0680	
	10月末日	23		1.1009	
	11月末日	26		1.1119	

12月末日	29		1.1267
2020年 1月末日	33		1.1202
2月末日	35		1.0639
3月末日	35		0.9592
4月末日	41		0.9968
5月末日	46		1.0306
6月末日	52		1.0426
7月末日	57		1.0470

## 【分配の推移】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 8月31日～2018年 6月22日	0.0005円
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24日	0.0005円
第3計算期間	2019年 6月25日～2020年 6月22日	0.0005円

## 【収益率の推移】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 8月31日～2018年 6月22日	4.4%
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24日	0.3%
第3計算期間	2019年 6月25日～2020年 6月22日	0.0%

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

## （4）【設定及び解約の実績】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 8月31日～2018年 6月22日	3,834,123	59,096	3,775,027
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24日	7,911,071	907,263	10,778,835
第3計算期間	2019年 6月25日～2020年 6月22日	39,475,833	2,269,171	47,985,497

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	5 円
2018年6月	5 円
--	--
--	--
設定来累計	15 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	23.9
2	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	20.0
3	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	14.8
4	新興国株式マザーファンド	11.2
5	外国債券マザーファンド	9.7
6	海外REITインデックス マザーファンド	7.6
7	J-REITインデックス マザーファンド	7.5
8	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	5.3

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「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	0.2
2	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付（10年）第352回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付（5年）第133回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付（10年）第329回	国債証券	0.2

・「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

・「新興国債券（現地通貨建て）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	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
3	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1
4	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
5	CZECH REPUBLIC	国債証券	0.1

## ・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.8
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.6
3	ソニー	電気機器	0.6
4	キーエンス	電気機器	0.4
5	日本電信電話	情報・通信業	0.4

## ・「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	0.6
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.5
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.5
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.2
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.2

## ・「新興国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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.8
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.7
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.6
4	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	0.5
5	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.4

## ・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.5
2	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.5
3	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.4
4	G L P 投資法人 投資証券	投資証券	0.4
5	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.4

## ・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.5
2	EQUINIX INC	投資証券	0.5
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.3
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.2
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.2

## ■ 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。
- ・2017年は設定日（2017年8月31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。

#### 積立方式

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

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

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 取得申込日の翌々営業日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。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け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### < 基準価額の計算方法 >

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当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
公社債等	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup> 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額
株式	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> の金融商品取引所の最終相場で評価します。
REIT (不動産投資信託)	原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。

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】

2065年6月22日までとします(2017年8月31日設定)。

なお、委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

## （４）【計算期間】

原則として、毎年6月23日から翌年6月22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、信託終了前に、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

### （b）信託期間の終了

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

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

は、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

#### (c)運用報告書

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

#### (d)信託約款の変更等

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

た場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

( ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d) 信託約款の変更等」にしたがい、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。

( ) 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。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

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

して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

累積投資契約を結んでいる場合には、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### 収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

#### 償還金に対する請求権

##### 償還金の支払い開始日

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

##### 償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

#### 換金(解約)請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2019年6月25日から2020年6月22日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 (2019年 6月24日現在)	第3期 (2020年 6月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	34,288	311,822
親投資信託受益証券	11,259,476	50,112,756
未収入金	11,929	403,158
流動資産合計	11,305,693	50,827,736
資産合計	11,305,693	50,827,736
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	5,389	23,992
未払解約金	10,473	552,666
未払受託者報酬	1,784	8,224
未払委託者報酬	16,864	78,075
その他未払費用	143	564
流動負債合計	34,653	663,521
負債合計	34,653	663,521
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,778,835	47,985,497
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	492,205	2,178,718
(分配準備積立金)	154,341	651,333
元本等合計	11,271,040	50,164,215
純資産合計	11,271,040	50,164,215
負債純資産合計	11,305,693	50,827,736



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第2期		第3期	
	自	2018年 6月23日 至 2019年 6月24日	自	2019年 6月25日 至 2020年 6月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		105,204		73,569
営業収益合計		105,204		73,569
営業費用				
受託者報酬		2,842		12,316
委託者報酬		26,786		116,846
その他費用		271		829
営業費用合計		29,899		129,991
営業利益又は営業損失( )		75,305		56,422
経常利益又は経常損失( )		75,305		56,422
当期純利益又は当期純損失( )		75,305		56,422
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( )		13,010		21,349
期首剰余金又は期首欠損金( )		163,415		492,205
剰余金増加額又は欠損金減少額		309,260		1,910,483
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		309,260		1,910,483
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,376		122,207
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,376		122,207
分配金		5,389		23,992
期末剰余金又は期末欠損金( )		492,205		2,178,718

## (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25日から2020年6月22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24日現在	第3期 2020年6月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 10,778,835口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 47,985,497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 1.0457円 (10,000口当たり純資産額) (10,457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 1.0454円 (10,000口当たり純資産額) (10,454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23日 至 2019年 6月24日	第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>133,485円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>337,864円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>26,245円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>497,594円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>10,778,835口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>461円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>5,389円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	133,485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	337,864円	分配準備積立金額	D	26,245円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	497,594円	当ファンドの期末残存口数	F	10,778,835口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	461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	5,389円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>533,758円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,527,385円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>141,567円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>2,202,710円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>47,985,497口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>459円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>23,992円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	533,758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	1,527,385円	分配準備積立金額	D	141,567円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,202,710円	当ファンドの期末残存口数	F	47,985,497口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	459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	23,992円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	133,485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	337,864円																																																											
分配準備積立金額	D	26,245円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	497,594円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	10,778,835口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	461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	5,389円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	533,758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	1,527,385円																																																											
分配準備積立金額	D	141,567円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,202,710円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	47,985,497口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	459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	23,992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23日 至 2019年 6月24日	第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2019年 6月24日現在	第3期 2020年 6月22日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日	第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22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23日 至 2019年 6月24日	第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22日
期首元本額 3,775,027円	期首元本額 10,778,835円
期中追加設定元本額 7,911,071円	期中追加設定元本額 39,475,833円
期中一部解約元本額 907,263円	期中一部解約元本額 2,269,171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23日 至 2019年 6月24日	第3期 自 2019年 6月25日 至 2020年 6月22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	87,079	91,754
合計	87,079	91,754

## 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22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22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	8,023,755	12,962,376	
		外国債券マザーファンド	2,509,316	6,025,620	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,701,737	7,627,273	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	7,036,876	9,359,748	
		J-REITインデックスマザーファンド	1,615,459	3,425,096	
		海外REITインデックスマザーファンド	1,733,512	3,532,724	
		新興国株式マザーファンド	4,891,370	5,792,849	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,061,263	1,387,070	
	小計	銘柄数:8 組入時価比率:99.9%	29,573,288	50,112,756 100.0%	
合計			50,112,756		

(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」、「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」および「海外REITインデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2020年6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,730,761,370

(2020年 6月22日現在)

国債証券	542,442,014,790
地方債証券	48,225,293,963
特殊債券	63,011,430,074
社債券	29,250,651,350
未収利息	922,469,087
前払費用	23,145,790
流動資産合計	688,605,766,424
資産合計	688,605,766,424
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	433,717,030
未払利息	5,671
流動負債合計	633,722,701
負債合計	633,722,701
純資産の部	
元本等	
元本	517,242,060,542
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	170,729,983,181
元本等合計	687,972,043,723
純資産合計	687,972,043,723
負債純資産合計	688,605,766,424

## 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22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	1.3301円
(10,000口当たり純資産額)	(13,301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25日  
至 2020年 6月22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22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

## 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22日現在

期首	2019年 6月25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	491,635,597,595円
同期中における追加設定元本額	115,947,184,980円
同期中における一部解約元本額	90,340,722,033円
期末元本額	517,242,060,542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	465,683,807円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	38,514,549,897円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	16,837,238,844円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,650,412,948円
野村資産設計ファンド2015	345,802,726円
野村資産設計ファンド2020	337,479,573円

野村資産設計ファンド2025	289,677,854円
野村資産設計ファンド2030	213,703,151円
野村資産設計ファンド2035	107,810,298円
野村資産設計ファンド2040	156,549,670円
野村日本債券インデックスファンド	909,171,288円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	154,278,261,835円
のむらップ・ファンド（保守型）	12,709,631,678円
のむらップ・ファンド（普通型）	9,010,629,020円
のむらップ・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）	10,843,404,236円
野村資産設計ファンド2045	15,543,151円
野村円債投資インデックスファンド	1,040,079,168円
野村インデックスファンド・国内債券	3,130,435,357円
マイ・ロード	34,384,402,140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	1,169,107,125円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	14,618,251,953円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	3,843,196,593円
野村資産設計ファンド2050	19,341,357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	5,091,346円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	3,078,972円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,715,520円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	765,916,069円
のむらップ・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 ）	58,137,768円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	29,290,775円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	73,965,585円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	13,936,061円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	14,435,319円
野村6資産均等バランス	1,542,207,294円
世界6資産分散ファンド	144,793,382円
野村資産設計ファンド2060	5,617,310円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	1,436,646,549円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	16,573,603,380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）	608,221,277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）	143,286,227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）	1,954,807,115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）	1,343,185,063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）	18,039,499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）	3,478,424,098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）	12,175,927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）	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）	78,444,904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）	332,007,181円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	315,745,495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）	774,762,896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)	288,595,622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)	3,064,522,466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)	1,412,928円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	33,478,298,341円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	41,114,863,694円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	14,666,993,833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)	49,141,387,374円
マイバランスDC30	11,107,915,273円
マイバランスDC50	8,366,913,750円
マイバランスDC70	2,642,277,011円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	12,509,379,961円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	626,071,091円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,436,449,824円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	630,816,240円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	103,737,229円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	17,143,325円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	15,940,024円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	20,558,655円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	7,036,876円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	3,318,838円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	385,663,127円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	182,294,795円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	56,509,428円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	65,535,699円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,191,586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22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22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	1,504,395,000	
		国庫債券 利付(2年)第406回	4,000,000,000	4,014,680,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	7,200,000,000	7,223,328,000	
		国庫債券 利付(5年)第130回	7,500,000,000	7,529,700,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	5,300,000,000	5,324,009,000	

国庫債券 利付(5年)第132回	3,000,000,000	3,015,570,000	
国庫債券 利付(5年)第133回	6,200,000,000	6,235,588,000	
国庫債券 利付(5年)第134回	3,000,000,000	3,019,140,000	
国庫債券 利付(5年)第135回	3,500,000,000	3,524,535,000	
国庫債券 利付(5年)第136回	3,300,000,000	3,325,278,000	
国庫債券 利付(5年)第137回	4,000,000,000	4,032,560,000	
国庫債券 利付(5年)第138回	4,900,000,000	4,942,140,000	
国庫債券 利付(5年)第139回	4,400,000,000	4,439,688,000	
国庫債券 利付(5年)第140回	3,400,000,000	3,432,062,000	
国庫債券 利付(5年)第141回	4,000,000,000	4,039,240,000	
国庫債券 利付(5年)第143回	2,970,000,000	3,000,412,800	
国庫債券 利付(40年)第1回	2,360,000,000	3,499,219,200	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,295,865,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,306,260,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,130,000,000	1,652,839,700	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,700,040,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,817,153,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,885,002,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,891,170,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,500,000,000	2,359,775,000	
国庫債券 利付(40年)第10回	2,300,000,000	2,546,031,000	
国庫債券 利付(40年)第11回	1,900,000,000	2,042,063,000	
国庫債券 利付(40年)第12回	2,070,000,000	2,014,420,500	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,828,368,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,246,464,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,885,020,500	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,561,005,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,264,736,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,444,376,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	1,700,000,000	1,736,006,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,261,376,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,494,600,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,144,919,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,174,090,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,250,000,000	5,359,042,500	

国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,451,315,000
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,917,648,000
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,946,436,000
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,541,210,000
国庫債券 利付(10年)第333回	3,600,000,000	3,700,116,000
国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	6,794,634,000
国庫債券 利付(10年)第335回	5,200,000,000	5,339,776,000
国庫債券 利付(10年)第336回	1,700,000,000	1,748,008,000
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,770,189,000
国庫債券 利付(10年)第338回	5,000,000,000	5,123,900,000
国庫債券 利付(10年)第339回	4,000,000,000	4,103,400,000
国庫債券 利付(10年)第340回	4,200,000,000	4,314,072,000
国庫債券 利付(10年)第341回	5,300,000,000	5,421,582,000
国庫債券 利付(10年)第342回	2,750,000,000	2,784,155,000
国庫債券 利付(10年)第343回	5,900,000,000	5,976,523,000
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,878,416,000
国庫債券 利付(10年)第345回	5,000,000,000	5,068,650,000
国庫債券 利付(10年)第346回	4,900,000,000	4,969,825,000
国庫債券 利付(10年)第347回	5,400,000,000	5,477,922,000
国庫債券 利付(10年)第348回	4,600,000,000	4,668,816,000
国庫債券 利付(10年)第349回	4,100,000,000	4,161,869,000
国庫債券 利付(10年)第350回	5,850,000,000	5,936,580,000
国庫債券 利付(10年)第351回	5,600,000,000	5,681,032,000
国庫債券 利付(10年)第352回	6,600,000,000	6,692,994,000
国庫債券 利付(10年)第353回	5,100,000,000	5,167,422,000
国庫債券 利付(10年)第354回	4,350,000,000	4,405,332,000
	5,100,000,000	5,159,772,000

国庫債券 利付(10年)第355回			
国庫債券 利付(10年)第356回	4,400,000,000	4,448,884,000	
国庫債券 利付(10年)第357回	1,900,000,000	1,918,943,000	
国庫債券 利付(10年)第358回	4,870,000,000	4,914,998,800	
国庫債券 利付(30年)第1回	500,000,000	629,995,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	500,000,000	615,955,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	196,262,400	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,168,074,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	184,782,000	
国庫債券 利付(30年)第6回	600,000,000	757,398,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	754,872,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	120,479,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	306,371,800	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	279,862,500	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	191,603,200	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	275,530,200	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	360,238,000	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,039,520,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,184,967,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,208,129,400	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,571,832,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,948,215,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,084,496,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,400,000,000	1,869,406,000	
国庫債券 利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,832,166,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	805,656,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	840,000,000	1,131,488,400	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	945,112,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	661,310,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,140,878,500	
国庫債券 利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,116,029,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,647,432,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	1,500,000,000	2,043,090,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,297,108,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,200,000,000	1,607,496,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	1,400,000,000	1,909,348,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	2,400,000,000	3,148,608,000	
国庫債券 利付(30年)第34回	2,100,000,000	2,848,440,000	
国庫債券 利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,041,382,000	
国庫債券 利付(30年)第36回	2,300,000,000	3,051,272,000	

国庫債券	利付(30年)第37回	2,300,000,000	3,013,943,000
国庫債券	利付(30年)第38回	1,600,000,000	2,069,056,000
国庫債券	利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,107,536,000
国庫債券	利付(30年)第40回	1,300,000,000	1,685,255,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,914,645,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,600,000,000	2,044,304,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,664,481,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,794,296,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	2,103,070,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,228,166,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	2,146,420,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,311,787,000
国庫債券	利付(30年)第49回	1,900,000,000	2,312,794,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,600,000,000	1,717,280,000
国庫債券	利付(30年)第51回	2,650,000,000	2,519,381,500
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,897,796,000
国庫債券	利付(30年)第53回	1,700,000,000	1,737,723,000
国庫債券	利付(30年)第54回	1,700,000,000	1,822,434,000
国庫債券	利付(30年)第55回	1,500,000,000	1,607,010,000
国庫債券	利付(30年)第56回	1,900,000,000	2,036,667,000
国庫債券	利付(30年)第57回	1,600,000,000	1,713,936,000
国庫債券	利付(30年)第58回	2,100,000,000	2,247,987,000
国庫債券	利付(30年)第59回	1,600,000,000	1,670,368,000
国庫債券	利付(30年)第60回	1,150,000,000	1,259,169,500
国庫債券	利付(30年)第61回	1,000,000,000	1,042,080,000
国庫債券	利付(30年)第62回	500,000,000	494,405,000
国庫債券	利付(30年)第63回	1,400,000,000	1,345,806,000
国庫債券	利付(30年)第64回	1,500,000,000	1,439,685,000
国庫債券	利付(30年)第65回	1,200,000,000	1,149,936,000
国庫債券	利付(30年)第66回	2,900,000,000	2,778,142,000
国庫債券	利付(20年)第52回	100,000,000	102,829,000
国庫債券	利付(20年)第53回	250,000,000	258,455,000
国庫債券	利付(20年)第54回	100,000,000	103,532,000
国庫債券	利付(20年)第55回	231,000,000	239,717,940
国庫債券	利付(20年)第56回	120,000,000	125,179,200
国庫債券	利付(20年)第57回	210,000,000	218,643,600
国庫債券	利付(20年)第58回	180,000,000	188,328,600
国庫債券	利付(20年)第59回	230,000,000	240,676,600
国庫債券	利付(20年)第60回	780,000,000	810,349,800
国庫債券	利付(20年)第61回	300,000,000	309,531,000
国庫債券	利付(20年)第62回	440,000,000	452,562,000
国庫債券	利付(20年)第63回	300,000,000	317,580,000
国庫債券	利付(20年)第64回	400,000,000	426,656,000

国庫債券 利付（20年）第65回	455,000,000	487,582,550	
国庫債券 利付（20年）第66回	300,000,000	320,430,000	
国庫債券 利付（20年）第67回	310,000,000	333,708,800	
国庫債券 利付（20年）第68回	290,000,000	315,450,400	
国庫債券 利付（20年）第69回	560,000,000	607,040,000	
国庫債券 利付（20年）第70回	540,000,000	594,815,400	
国庫債券 利付（20年）第71回	200,000,000	218,698,000	
国庫債券 利付（20年）第72回	670,000,000	733,757,200	
国庫債券 利付（20年）第73回	1,600,000,000	1,753,232,000	
国庫債券 利付（20年）第74回	900,000,000	990,252,000	
国庫債券 利付（20年）第75回	600,000,000	663,336,000	
国庫債券 利付（20年）第76回	910,000,000	997,378,200	
国庫債券 利付（20年）第77回	700,000,000	770,553,000	
国庫債券 利付（20年）第78回	800,000,000	880,704,000	
国庫債券 利付（20年）第79回	860,000,000	951,074,000	
国庫債券 利付（20年）第80回	900,000,000	999,828,000	
国庫債券 利付（20年）第81回	360,000,000	400,060,800	
国庫債券 利付（20年）第82回	820,000,000	915,579,200	
国庫債券 利付（20年）第83回	1,370,000,000	1,537,318,100	
国庫債券 利付（20年）第84回	1,200,000,000	1,339,932,000	
国庫債券 利付（20年）第85回	400,000,000	451,188,000	
国庫債券 利付（20年）第86回	1,400,000,000	1,595,342,000	
国庫債券 利付（20年）第87回	500,000,000	566,875,000	
国庫債券 利付（20年）第88回	1,100,000,000	1,259,885,000	
国庫債券 利付（20年）第89回	470,000,000	535,480,400	
国庫債券 利付（20年）第90回	1,500,000,000	1,717,845,000	
国庫債券 利付（20年）第91回	250,000,000	287,877,500	
国庫債券 利付（20年）第92回	650,000,000	743,697,500	
国庫債券 利付（20年）第93回	300,000,000	342,864,000	
国庫債券 利付（20年）第94回	200,000,000	229,934,000	
国庫債券 利付（20年）第95回	700,000,000	818,286,000	
国庫債券 利付（20年）第96回	400,000,000	461,960,000	
国庫債券 利付（20年）第97回	600,000,000	700,692,000	
国庫債券 利付（20年）第98回	300,000,000	348,156,000	
国庫債券 利付（20年）第99回	2,100,000,000	2,447,865,000	
国庫債券 利付（20年）第100回	1,520,000,000	1,790,590,400	
国庫債券 利付（20年）第101回	250,000,000	298,400,000	
国庫債券 利付（20年）第102回	500,000,000	599,490,000	
国庫債券 利付（20年）第103回	600,000,000	714,564,000	
	400,000,000	469,944,000	

国庫債券 利付(20年)第104回			
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,240,936,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	475,088,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	355,014,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,866,112,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,053,126,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,306,448,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	960,840,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,145,672,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,392,660,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	2,039,864,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	1,000,000,000	1,209,420,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,335,048,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,685,516,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	599,020,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	942,464,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	926,504,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,700,000,000	2,024,649,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,298,836,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,822,875,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,204,800,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,106,703,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,208,300,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	1,200,000,000	1,437,144,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,800,000,000	2,160,468,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	800,000,000	951,480,000	
	1,400,000,000	1,669,262,000	

国庫債券 利付(20年)第130回			
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	944,944,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,538,953,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,673,280,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,676,150,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	829,955,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	821,835,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,188,180,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	931,608,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,176,350,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,738,495,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	2,600,000,000	3,101,800,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,145,035,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,537,562,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,521,286,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,754,296,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,879,328,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	4,200,000,000	4,992,204,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,471,658,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	3,850,000,000	4,537,379,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,330,000,000	3,883,412,700	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,500,000,000	2,848,100,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	2,650,000,000	3,020,761,500	
国庫債券 利付(20年)第153回	2,450,000,000	2,829,897,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	1,720,000,000	1,962,812,400	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,600,000,000	2,890,836,000	
	2,850,000,000	2,905,917,000	



	国庫債券 利付(20年)第156回			
	国庫債券 利付(20年)第157回	3,190,000,000	3,150,922,500	
	国庫債券 利付(20年)第158回	2,100,000,000	2,170,077,000	
	国庫債券 利付(20年)第159回	2,000,000,000	2,097,580,000	
	国庫債券 利付(20年)第160回	2,300,000,000	2,448,580,000	
	国庫債券 利付(20年)第161回	2,100,000,000	2,200,065,000	
	国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,779,237,000	
	国庫債券 利付(20年)第163回	2,750,000,000	2,877,545,000	
	国庫債券 利付(20年)第164回	2,600,000,000	2,674,048,000	
	国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,261,578,000	
	国庫債券 利付(20年)第166回	2,300,000,000	2,442,232,000	
	国庫債券 利付(20年)第167回	2,600,000,000	2,667,730,000	
	国庫債券 利付(20年)第168回	2,700,000,000	2,718,954,000	
	国庫債券 利付(20年)第169回	2,530,000,000	2,498,552,100	
	国庫債券 利付(20年)第170回	2,000,000,000	1,973,060,000	
	国庫債券 利付(20年)第171回	1,300,000,000	1,281,124,000	
	国庫債券 利付(20年)第172回	3,540,000,000	3,549,735,000	
	メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)	100,000,000	98,055,000	
小計	銘柄数: 258 組入時価比率: 78.8%	497,436,000,000	542,442,014,790 79.4%	
合計			542,442,014,790	
地方債証券	日本円			
	東京都 公募第703回	100,000,000	101,450,000	
	東京都 公募第707回	100,000,000	101,476,000	
	東京都 公募第708回	100,000,000	101,736,000	
	東京都 公募第710回	100,000,000	101,577,000	
	東京都 公募第712回	100,000,000	101,686,000	
	東京都 公募第715回	100,000,000	101,844,000	
	東京都 公募第716回	200,000,000	203,738,000	
	東京都 公募第731回	100,000,000	102,298,000	
	東京都 公募第736回	100,000,000	102,057,000	
	東京都 公募第745回	300,000,000	307,755,000	
	東京都 公募第760回	100,000,000	99,906,000	

東京都	公募第761回	100,000,000	100,093,000
東京都	公募第769回	500,000,000	505,215,000
東京都	公募第778回	100,000,000	100,692,000
東京都	公募(30年)第7回	100,000,000	136,086,000
東京都	公募第10回	200,000,000	268,484,000
東京都	公募第1回	300,000,000	313,647,000
東京都	公募(20年)第3回	200,000,000	216,742,000
東京都	公募第7回	100,000,000	111,063,000
東京都	公募(20年)第13回	100,000,000	115,464,000
東京都	公募(20年)第16回	200,000,000	232,468,000
東京都	公募(20年)第17回	200,000,000	233,818,000
東京都	公募第23回	100,000,000	120,047,000
東京都	公募(20年)第26回	100,000,000	117,476,000
北海道	公募平成24年度第6回	100,000,000	101,754,000
北海道	公募平成24年度第9回	100,000,000	101,768,000
北海道	公募平成25年度第1回	300,000,000	304,599,000
北海道	公募平成26年度第13回	100,000,000	101,897,000
北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	102,396,000
北海道	公募平成28年度第13回	200,000,000	199,934,000
北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	201,184,000
北海道	公募平成29年度第6回	700,000,000	699,573,000
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	100,821,000
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,802,000
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	100,281,000
神奈川県	公募第188回	200,000,000	203,576,000
神奈川県	公募第196回	100,000,000	101,803,000
神奈川県	公募第200回	100,000,000	102,612,000
神奈川県	公募第205回	100,000,000	102,406,000
神奈川県	公募第206回	100,000,000	102,530,000
神奈川県	公募第210回	200,000,000	203,872,000
神奈川県	公募第231回	200,000,000	202,160,000
神奈川県	公募(30年)第3回	100,000,000	135,563,000
神奈川県	公募第7回	300,000,000	343,488,000
神奈川県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,989,000
神奈川県	公募(20年)第17回	200,000,000	238,518,000
神奈川県	公募(20年)第26回	100,000,000	115,663,000
大阪府	公募第356回	100,000,000	101,552,000
大阪府	公募第378回	104,000,000	106,373,280
大阪府	公募第381回	100,000,000	102,384,000
大阪府	公募第382回	100,000,000	102,402,000
大阪府	公募第383回	100,000,000	102,533,000
大阪府	公募第384回	100,000,000	102,494,000

大阪府 公募第387回	300,000,000	306,090,000
大阪府 公募第389回	100,000,000	102,153,000
大阪府 公募第417回	102,000,000	103,206,660
大阪府 公募第423回	100,000,000	100,714,000
大阪府 公募第429回	179,000,000	180,528,660
大阪府 公募第452回	100,000,000	99,255,000
大阪府 公募第5回	100,000,000	119,723,000
大阪府 公募第8回	100,000,000	117,996,000
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	101,776,000
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	101,819,000
京都府 公募平成25年度第15回	200,000,000	204,782,000
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	115,437,000
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	204,612,000
京都府 公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	106,070,000
京都府 公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	98,895,000
京都府 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,905,000
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	102,004,000
兵庫県 公募平成29年度第22回	100,000,000	100,791,000
兵庫県 公募(30年)第2回	200,000,000	270,950,000
兵庫県 公募(15年)第1回	300,000,000	328,974,000
兵庫県 公募(15年)第3回	200,000,000	217,766,000
兵庫県 公募(12年)第3回	300,000,000	307,644,000
兵庫県 公募第2回	100,000,000	116,436,000
兵庫県 公募第9回	100,000,000	119,814,000
兵庫県 公募(20年)第11回	200,000,000	233,436,000
兵庫県 公募(20年)第14回	100,000,000	117,080,000
兵庫県 公募(20年)第22回	100,000,000	114,539,000
静岡県 公募平成24年度第5回	100,060,000	101,784,033
静岡県 公募平成24年度第10回	100,000,000	101,807,000
静岡県 公募平成25年度第5回	101,000,000	103,825,980
静岡県 公募平成26年度第3回	165,000,000	169,268,550
静岡県 公募平成26年度第8回	100,000,000	102,315,000
静岡県 公募平成26年度第9回	200,000,000	204,630,000
静岡県 公募平成27年度第11回	115,400,000	115,829,288
静岡県 公募平成28年度第2回	300,000,000	300,600,000
静岡県 公募平成29年度第3回	100,000,000	100,738,000
静岡県 公募(31年)第1回	174,000,000	174,000,000
静岡県 公募(15年)第5回	200,000,000	216,738,000
静岡県 公募(15年)第9回	100,000,000	105,676,000

静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	116,950,000
静岡県	公募(20年)第14回	200,000,000	234,860,000
静岡県	公募(20年)第18回	100,000,000	115,590,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	116,487,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	101,663,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,776,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	116,832,000
愛知県	公募平成24年度第8回	150,000,000	152,674,500
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	436,840,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	119,189,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	157,244,400
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	126,946,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	114,279,000
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	100,000,000	105,824,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,308,000
愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,894,000
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,539,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	101,923,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	205,082,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,222,381
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	213,560,910
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	305,145,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,780,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	151,796,200
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	102,391,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	102,385,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	102,539,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	204,548,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	408,220,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,929,000
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	101,076,000
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,939,000
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	201,908,000
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	107,623,000
埼玉県	公募(15年)第3回	100,000,000	102,183,000
埼玉県	公募(20年)第6回	100,000,000	117,814,000
埼玉県	公募(20年)第16回	100,000,000	112,378,000
埼玉県	公募(20年)第20回	100,000,000	103,332,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	101,342,000

福岡県 公募平成26年度第1回	100,000,000	102,541,000
福岡県 公募平成27年度第1回	300,000,000	308,301,000
福岡県 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,976,000
福岡県 公募平成23年度第1回	100,000,000	109,168,000
福岡県 公募(15年)令和元年度第1回	100,000,000	98,932,000
福岡県 公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	136,344,000
福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	127,222,000
福岡県 公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	100,000,000	107,958,000
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	116,571,000
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,474,000
千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,896,000
千葉県 公募平成24年度第2回	100,000,000	101,712,000
千葉県 公募平成24年度第7回	100,000,000	101,799,000
千葉県 公募平成24年度第8回	100,000,000	102,125,000
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	102,610,000
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	102,779,000
千葉県 公募平成26年度第3回	200,000,000	204,830,000
千葉県 公募平成28年度第4回	200,000,000	200,310,000
千葉県 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,541,000
千葉県 公募平成29年度第8回	100,000,000	100,963,000
千葉県 公募(20年)第1回	400,000,000	444,160,000
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	119,882,000
千葉県 公募(20年)第16回	200,000,000	233,286,000
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	114,748,000
群馬県 公募第8回	100,000,000	101,441,000
群馬県 公募第12回	100,000,000	102,434,000
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	116,954,000
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	190,926,076
大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	913,960,520
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	303,630,000
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	151,903,500
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	101,315,000
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	202,882,000
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	203,476,000
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	203,348,000

共同発行市場地方債 回	公募第 1 1 1	200,000,000	203,492,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 1 2	100,000,000	101,715,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 1 3	800,000,000	813,064,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 1 4	243,700,000	248,093,911
共同発行市場地方債 回	公募第 1 1 5	100,000,000	101,827,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 1 6	200,000,000	203,784,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 1 8	100,000,000	102,125,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 1 9	200,000,000	204,172,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 2 0	300,000,000	305,448,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 2 1	100,000,000	101,561,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 2 2	400,000,000	407,008,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 2 4	300,000,000	308,244,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 2 6	100,000,000	102,574,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 2 8	700,000,000	715,330,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 2 9	100,000,000	102,420,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 3 0	100,000,000	102,658,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 3 2	100,000,000	102,402,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 3 6	200,000,000	204,830,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 3 7	200,000,000	204,550,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 3 9	155,000,000	158,523,150
共同発行市場地方債 回	公募第 1 4 3	540,000,000	550,897,200
共同発行市場地方債 回	公募第 1 4 5	1,000,000,000	1,018,910,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 5 6	200,000,000	200,630,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 5 7	300,000,000	300,609,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 6 1	300,000,000	299,997,000
共同発行市場地方債 回	公募第 1 7 2	600,000,000	606,342,000
		100,000,000	100,723,000

共同発行市場地方債 公募第184回			
共同発行市場地方債 公募第190回	610,000,000	613,635,600	
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	100,387,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	118,171,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	124,225,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,972,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,128,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	204,210,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,164,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	144,989,100	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,878,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,164,000	
熊本市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,850,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	238,927,392	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	101,007,000	
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,972,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,452,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	102,303,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,442,000	
大阪市 公募（5年）平成28年度第5回	100,000,000	99,972,000	
大阪市 公募（15年）第1回	100,000,000	110,235,000	
大阪市 公募（20年）第1回	300,000,000	349,113,000	
大阪市 公募（20年）第5回	100,000,000	119,534,000	
大阪市 公募（20年）第6回	100,000,000	117,921,000	
大阪市 公募（20年）第17回	100,000,000	117,759,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	101,811,000	
名古屋市 公募第481回	100,000,000	101,804,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	307,356,000	
名古屋市 公募第503回	100,000,000	101,002,000	
名古屋市 公募第504回	200,000,000	202,064,000	
名古屋市 公募（12年）第1回	200,000,000	210,160,000	
名古屋市 公募（15年）第2回	100,000,000	107,294,000	
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	101,571,000	
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,963,000	
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	102,505,488	
京都市 公募（20年）第2回	100,000,000	110,854,000	
京都市 公募（20年）第5回	200,000,000	229,736,000	
京都市 公募（20年）第6回	100,000,000	116,591,000	
京都市 公募（20年）第13回	100,000,000	114,169,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	303,612,000	

神戸市	公募平成28年度第1回	200,000,000	200,406,000
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	203,690,000
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	203,740,000
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	204,322,000
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	204,034,000
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	303,384,000
横浜市	公募平成29年度第3回	100,000,000	101,030,000
横浜市	公募(30年)第2回	200,000,000	261,116,000
横浜市	公募(20年)第18回	100,000,000	118,710,000
横浜市	公募(20年)第26回	100,000,000	118,571,000
横浜市	公募(20年)第30回	100,000,000	114,396,000
札幌市	公募(15年)平成23年度第9回	100,000,000	109,481,000
札幌市	公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	117,970,000
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	118,838,000
札幌市	公募平成26年度第4回	100,000,000	102,075,000
札幌市	公募平成26年度第9回	200,000,000	203,682,000
川崎市	公募第85回	100,000,000	101,745,000
川崎市	公募(20年)第17回	100,000,000	115,649,000
川崎市	公募(20年)第19回	100,000,000	114,209,000
北九州市	公募(20年)第3回	200,000,000	232,176,000
北九州市	公募(20年)第14回	100,000,000	117,535,000
福岡市	公募(20年)平成23年度第4回	100,000,000	118,448,000
福岡市	公募平成26年度第2回	100,000,000	115,838,000
福岡市	公募平成26年度第5回	100,000,000	102,256,000
福岡市	公募平成26年度第8回	160,000,000	163,420,800
広島市	公募平成26年度第2回	100,000,000	101,965,000
広島市	公募平成27年度第2回	500,000,000	511,510,000
広島市	公募(10年)平成30年度第6回	241,000,000	242,055,580
千葉市	公募平成24年度第1回	100,000,000	101,896,000
三重県	公募平成24年度第1回	140,660,000	143,232,671
三重県	公募平成28年度第1回	155,000,000	156,054,000
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	101,250,000
福井県	公募平成27年度第4回	200,000,000	200,466,000
山梨県	公募平成24年度第1回	200,000,000	203,666,000
岡山県	公募平成28年度第2回	168,900,000	170,550,153
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	117,335,000
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	356,121,000



小計	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	116,670,000		
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	105,043,000		
	銘柄数：275 組入時価比率：7.0%	45,862,820,000	48,225,293,963	7.1%	
	合計		48,225,293,963		
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	101,654,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	153,746,690	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	196,050,040	
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,868,140	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,026,000	
		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	106,677,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	305,133,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	108,055,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	302,607,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	100,000,000	100,558,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	103,948,200	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	162,028,950	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,501,215,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	302,685,000	
		道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	311,370,000	
		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	132,720,000	
		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	227,012,000	
		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	113,988,000	
		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	348,021,000	
		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	313,186,000	
		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	236,642,000	
		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	119,894,000	

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	101,600,000	
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	406,948,000	
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	203,210,000	
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	117,070,000	
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	203,808,000	
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	101,770,000	
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	410,676,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	119,414,000	
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	102,722,000	
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	409,044,000	
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	102,537,000	
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	102,484,000	
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	204,146,000	
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	203,900,000	
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	204,604,000	
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	359,511,000	
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	121,751,000	
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	106,645,000	
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	111,160,000	
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	94,963,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回	100,000,000	102,954,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	237,632,000	
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	238,134,000	
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	240,304,000	
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	239,142,000	
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	236,012,000	
	100,000,000	130,755,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回			
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	850,726,800	
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	142,119,600	
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	101,531,000	
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	142,245,600	
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	1,018,470,000	
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	126,660,000	
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	101,829,000	
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	117,087,000	
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	221,976,320	
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	116,261,000	
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	385,761,000	
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	203,866,000	
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	203,876,000	
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	203,846,000	
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	920,304,000	
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	118,623,000	
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	199,190,880	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	407,472,000	
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	1,026,490,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	279,208,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	307,260,000	
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	140,308,550	
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	148,494,500	
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	116,351,000	
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	125,560,000	
	100,000,000	116,314,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	100,000,000	102,565,000	
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	125,650,000	
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	194,385,200	
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	644,660,100	
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	102,083,000	
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	561,325,000	
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	408,967,870	
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	151,042,280	
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	100,325,000	
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	405,994,290	
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	100,665,000	
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	605,160,000	
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	100,398,000	
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	105,923,000	
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	506,130,000	
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	132,116,120	
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	100,799,000	
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	201,372,000	
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	101,338,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	130,000,000	136,600,100	
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	530,884,000	
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	134,698,000	
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	1,094,110,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	134,726,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回	100,000,000	116,299,000	
	100,000,000	118,417,000	

地方公共団体金融機構債券 20年 第4回			
地方公共団体金融機構債券 F16 回	100,000,000	112,553,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第6回	300,000,000	359,862,000	
地方公共団体金融機構債券 F24 回	100,000,000	104,539,000	
地方公共団体金融機構債券（20 年）第10回	300,000,000	347,496,000	
地方公共団体金融機構債券 第27 回	300,000,000	303,627,000	
地方公共団体金融機構債券 第28 回	500,000,000	506,580,000	
地方公共団体金融機構債券 F10 4回	100,000,000	106,055,000	
地方公共団体金融機構債券 F10 6回	100,000,000	104,610,000	
地方公共団体金融機構債券 F12 2回	100,000,000	109,029,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第37回	604,000,000	615,355,200	
地方公共団体金融機構債券 第37 回	400,000,000	406,716,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	197,482,300	
地方公共団体金融機構債券 F13 2回	500,000,000	525,800,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	101,788,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	102,920,010	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	103,947,180	
地方公共団体金融機構債券 第41 回	600,000,000	610,944,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 2回	100,000,000	104,367,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 5回	200,000,000	209,788,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 7回	100,000,000	107,863,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第42回	108,000,000	110,163,240	
地方公共団体金融機構債券 第42 回	100,000,000	101,900,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回	202,000,000	205,833,960	
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回	145,000,000	148,233,500	
地方公共団体金融機構債券 第44 回	100,000,000	102,002,000	
	223,000,000	228,008,580	

政保 地方公共団体金融機構債券 第45回			
地方公共団体金融機構債券 F16 0回	100,000,000	107,358,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第48回	500,000,000	509,210,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回	13,000,000	13,353,990	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	102,773,000	
地方公共団体金融機構債券 第51 回	600,000,000	615,570,000	
地方公共団体金融機構債券 第52 回	300,000,000	307,719,000	
地方公共団体金融機構債券(15 年) 第2回	200,000,000	217,276,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回	591,000,000	606,691,050	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	118,931,320	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第38回	100,000,000	115,520,000	
地方公共団体金融機構債券 F24 0回	300,000,000	325,848,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	102,278,000	
地方公共団体金融機構債券 第64 回	100,000,000	102,317,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第39回	100,000,000	114,775,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	409,220,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	320,000,000	326,147,200	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	193,730,670	
地方公共団体金融機構債券 第74 回	300,000,000	306,762,000	
地方公共団体金融機構債券 第77 回	100,000,000	102,135,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	519,062,930	
地方公共団体金融機構債券 第79 回	400,000,000	408,752,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回	500,000,000	503,025,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	116,033,640	
地方公共団体金融機構債券 第95 回	200,000,000	201,154,000	
地方公共団体金融機構債券 第10 1回	400,000,000	403,496,000	
	157,000,000	158,361,190	

政保 地方公共団体金融機構債券 第108回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	100,000,000	100,683,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	111,585,100	
公営企業債券(20年) 第2回財 投機関債	100,000,000	103,566,000	
公営企業債券(20年) 第5回財 投機関債	200,000,000	213,526,000	
公営企業債券(20年) 第19回 財投機関債	100,000,000	114,599,000	
公営企業債券(20年) 第20回 財投機関債	100,000,000	114,305,000	
公営企業債券(20年) 第24回 財投機関債	100,000,000	116,899,000	
公営企業債券(20年) 第25回 財投機関債	100,000,000	118,796,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	101,304,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	204,738,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,964,000	
都市再生債券 財投機関債第101 回	100,000,000	107,182,000	
都市再生債券 財投機関債第109 回	100,000,000	107,244,000	
都市再生債券 財投機関債第113 回	300,000,000	320,247,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7回	100,000,000	110,954,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 16回	360,000,000	368,316,000	
東京交通債券 第342回	200,000,000	209,318,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	168,344,820	
関西国際空港社債 財投機関債第3 2回	100,000,000	101,423,000	
関西国際空港社債 財投機関債第3 8回	100,000,000	101,648,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機 関債	100,000,000	101,816,000	
中部国際空港債券 政府保証第18 回	368,000,000	375,061,920	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第3回	200,000,000	228,686,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	106,893,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	109,012,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第49回	100,000,000	118,992,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	118,075,000	
	100,000,000	120,041,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回			
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	329,691,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	120,005,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	101,292,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	202,540,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	219,136,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	118,853,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	100,000,000	118,356,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	135,074,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	214,976,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	109,378,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	108,793,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	255,382,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	300,771,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	101,423,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	131,562,600	
成田国際空港 第10回	100,000,000	101,336,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	204,060,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	408,048,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,225,000	
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	100,269,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,262,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	300,900,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,158,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	199,750,000	
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,740,000	
しんきん中金債券 利付第327回	200,000,000	200,116,000	
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	200,258,000	
商工債券 利付(3年)第223回	500,000,000	500,470,000	
商工債券 利付(3年)第231回	200,000,000	200,166,000	
商工債券 利付(3年)第236回	500,000,000	499,500,000	
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	203,486,000	



国際協力機構債券 第6回財投機関債	200,000,000	239,568,000	
東日本高速道路 第6 1回	200,000,000	199,202,000	
中日本高速道路 第6 3回	100,000,000	102,389,000	
中日本高速道路 第6 6回	1,200,000,000	1,200,072,000	
西日本高速道路 第2 0回	200,000,000	204,662,000	
西日本高速道路 第2 2回	400,000,000	410,512,000	
西日本高速道路 第2 3回	100,000,000	102,200,000	
西日本高速道路 第3 0回	300,000,000	300,702,000	
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	102,406,000	
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	204,492,000	
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	114,920,000	
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	510,730,000	
貸付債権担保第1 2回住宅金融公庫債券	31,062,000	31,292,790	
貸付債権担保第1 9回住宅金融公庫債券	57,405,000	58,356,200	
貸付債権担保第5 回S種住宅金融公庫債券	35,235,000	35,857,954	
貸付債権担保第4 2回住宅金融公庫債券	38,802,000	40,461,173	
貸付債権担保第7 回S種住宅金融公庫債券	12,211,000	12,563,287	
貸付債権担保第3 9回住宅金融公庫債券	26,256,000	27,115,621	
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	34,277,248	
貸付債権担保第3 2回住宅金融公庫債券	55,912,000	57,626,821	
貸付債権担保第2 0回住宅金融公庫債券	58,020,000	59,256,986	
貸付債権担保第4 4回住宅金融公庫債券	51,888,000	53,912,669	
貸付債権担保第8 回住宅金融支援機構債券	86,166,000	89,517,857	
貸付債権担保第7 回住宅金融支援機構債券	14,503,000	15,133,735	
貸付債権担保第2 5回住宅金融支援機構債券	22,940,000	24,779,329	
貸付債権担保第2 8回住宅金融支援機構債券	73,389,000	78,583,473	
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	14,666,152	
貸付債権担保第4 2回住宅金融支援機構債券	78,074,000	82,399,299	

貸付債権担保S種第17回住宅金融 支援機構債券	28,946,000	29,493,658	
貸付債権担保第45回住宅金融支援 機構債券	93,300,000	99,271,200	
貸付債権担保第52回住宅金融支援 機構債券	70,400,000	74,388,160	
貸付債権担保第24回住宅金融支援 機構債券	40,690,000	43,613,983	
貸付債権担保第48回住宅金融支援 機構債券	88,227,000	93,851,471	
貸付債権担保第40回住宅金融支援 機構債券	97,635,000	102,249,230	
貸付債権担保第62回住宅金融支援 機構債券	134,619,000	141,288,025	
貸付債権担保第60回住宅金融支援 機構債券	130,245,000	137,358,981	
貸付債権担保第61回住宅金融支援 機構債券	84,148,000	88,432,816	
貸付債権担保第51回住宅金融支援 機構債券	32,518,000	34,438,513	
貸付債権担保第43回住宅金融支援 機構債券	75,756,000	80,425,599	
貸付債権担保第79回住宅金融支援 機構債券	43,674,000	45,548,051	
貸付債権担保第81回住宅金融支援 機構債券	93,988,000	98,127,231	
貸付債権担保第72回住宅金融支援 機構債券	42,494,000	44,325,916	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫 債券	24,484,000	25,061,822	
貸付債権担保第70回住宅金融支援 機構債券	127,362,000	133,807,790	
貸付債権担保第33回住宅金融支援 機構債券	27,579,000	29,550,071	
貸付債権担保第34回住宅金融支援 機構債券	29,849,000	32,038,125	
貸付債権担保第35回住宅金融支援 機構債券	28,306,000	30,138,530	
貸付債権担保第46回住宅金融支援 機構債券	31,540,000	33,597,985	
貸付債権担保第55回住宅金融支援 機構債券	85,728,000	90,649,644	
貸付債権担保第56回住宅金融支援 機構債券	121,947,000	128,906,515	
貸付債権担保第57回住宅金融支援 機構債券	40,735,000	43,102,925	
貸付債権担保第76回住宅金融支援 機構債券	82,484,000	86,460,553	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公 庫債券	11,267,000	11,460,229	
貸付債権担保S種第14回住宅金融 支援機構債券	59,315,000	59,941,366	
	24,310,000	24,565,011	

貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	78,880,000	84,282,491	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	79,836,000	85,196,987	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	157,090,000	165,285,385	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	86,866,000	91,866,875	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	141,735,000	148,543,949	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	123,984,000	129,229,763	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	95,906,000	101,230,701	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	82,298,000	86,481,207	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	199,244,000	207,819,461	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	343,483,000	357,765,023	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	52,100,000	54,076,674	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	54,658,000	56,797,860	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	55,935,000	57,924,607	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	116,290,000	119,651,943	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	122,330,000	124,936,852	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	65,295,000	67,407,293	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	68,912,000	70,933,188	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	204,633,000	211,670,328	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	211,791,000	219,936,481	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	141,638,000	146,936,677	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	69,566,000	72,046,027	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	69,818,000	72,505,294	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	253,635,000	256,064,823	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	170,178,000	172,686,423	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	171,128,000	173,395,446	
	85,660,000	86,857,526	

		貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	171,578,000	173,856,555	
		貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	86,703,000	87,520,609	
		貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	86,877,000	87,862,185	
		貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	88,265,000	89,431,863	
		貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	353,984,000	357,665,433	
		貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	266,928,000	269,864,208	
		貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	178,114,000	179,946,793	
		貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	180,400,000	182,725,356	
		貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	184,678,000	186,133,262	
		貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	92,384,000	93,105,519	
		貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	92,891,000	93,949,028	
		貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	93,925,000	94,633,194	
		貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	285,318,000	286,136,862	
		貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	286,506,000	287,474,390	
		貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	488,055,000	484,658,137	
		貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	197,092,000	197,582,759	
		貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	198,528,000	198,478,368	
		貸付債権担保第158回住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,178,000	
	小計	銘柄数：314 組入時価比率：9.2%	60,065,824,000	63,011,430,074 9.2%	
	合計			63,011,430,074	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFCM)第14回円貨社債	200,000,000	199,798,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第29回円貨社債	200,000,000	196,312,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第31回円貨社債	100,000,000	95,518,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債	100,000,000	99,158,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第1回非上位円貨社債	200,000,000	200,334,000	

クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	101,723,000	
クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債(2018)	100,000,000	99,644,000	
クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債(2018)	100,000,000	98,931,000	
スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015)	100,000,000	100,282,000	
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	99,705,000	
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	98,440,000	
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	99,739,000	
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	98,128,000	
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	93,882,000	
サンタンデル銀行 第1回円貨社債	100,000,000	98,674,000	
フランス電力 第4回円貨社債(2017)	100,000,000	102,568,000	
現代キャピタル・サービス・インク 第15回円貨社債	200,000,000	194,776,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債(2017)	100,000,000	99,755,000	
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	200,410,000	
オーストラリア・ニューゼaland銀行 第10回円貨社債	200,000,000	199,428,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債(2017)	100,000,000	99,542,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,158,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,311,000	
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	99,827,000	
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	100,380,000	
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	203,174,000	
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,778,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,360,000	
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	98,793,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,619,000	
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	103,010,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	196,372,000	

森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,674,000	
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	102,269,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,520,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,262,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,908,000	
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	100,333,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,343,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,860,000	
三井化学 第47回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,656,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,730,000	
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	99,569,000	
電通 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,612,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,195,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,898,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,003,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,698,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,781,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,346,000	
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	102,105,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,270,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,800,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,980,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,727,000	
新日鐵住金 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,815,000	
新日鐵住金 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,411,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	297,351,000	
	100,000,000	99,696,000	

神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付			
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFEス保証)	100,000,000	101,282,000	
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	100,000,000	98,420,000	
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	99,577,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,152,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	217,704,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,769,000	
日本電産 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,451,000	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,880,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,413,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,098,000	
ソニー 第32回	200,000,000	200,256,000	
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	99,527,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,992,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,407,000	
J A 三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,943,000	
J A 三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,851,000	
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	100,103,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	102,486,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,325,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,848,000	
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	100,143,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,777,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,250,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,471,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,728,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,974,000	

住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,669,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,104,000	
住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,724,000	
高島屋 第11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28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,940,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,132,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,136,000	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,314,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,356,000	
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	101,526,000	
りそなホールディングス 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,853,000	
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,700,000	
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	201,960,000	
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	114,767,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,893,000	
三菱東京UFJ銀行 第159回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,542,000	
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	302,694,000	
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	101,118,000	
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	103,809,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	307,629,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,862,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,585,000	
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,420,000	
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	201,570,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	113,590,000	
NTTファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,256,000	
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	100,036,000	
リコーリース 第28回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,417,000	
アコム 第76回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,899,000	
アコム 第77回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,660,000	
ジャックス 第12回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,477,000	
ジャックス 第19回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,875,000	
日立キャピタル 第57回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	101,287,000	
日立キャピタル 第61回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,444,000	
日立キャピタル 第80回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	97,997,000	
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	99,227,000	
三菱UFJリース 第52回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,104,000	
三菱UFJリース 第75回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	99,726,000	
三菱UFJリース 第30回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,355,000	
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	102,280,000	
三井不動産 第71回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	197,184,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等 財務上特約無	100,000,000	104,555,000	
三菱地所 第111回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	101,764,000	
三菱地所 第120回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	99,317,000	
東京建物 第25回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,229,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	96,863,000	
住友不動産 第95回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	102,640,000	
住友不動産 第97回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	204,736,000	
住友不動産 第100回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,137,000	
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	102,446,000	
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	116,015,000	
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	101,665,000	
	200,000,000	210,748,000	

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	202,492,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,634,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,631,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,626,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,431,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,700,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,445,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	235,374,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	116,213,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,698,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,645,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,477,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,144,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	345,123,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	237,206,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,774,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,238,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,103,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	101,412,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	106,285,000	
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	202,264,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,260,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,325,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,139,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,321,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,106,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,390,000	

九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,484,000	
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	92,335,000	
滋澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,288,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,247,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,328,000	
東京電力 第548回	100,000,000	109,954,000	
東京電力 第560回	100,000,000	108,132,000	
中部電力 第500回	200,000,000	205,650,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,849,000	
中部電力 第530回	200,000,000	199,720,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,013,000	
関西電力 第497回	200,000,000	207,112,000	
関西電力 第509回	100,000,000	100,709,000	
関西電力 第511回	100,000,000	100,246,000	
関西電力 第514回	200,000,000	200,308,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,608,000	
中国電力 第377回	400,000,000	412,404,000	
中国電力 第378回	100,000,000	102,874,000	
中国電力 第400回	100,000,000	100,248,000	
中国電力 第402回	300,000,000	300,774,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	102,820,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	102,790,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	104,486,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	102,446,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	100,226,000	
東北電力 第475回	100,000,000	102,615,000	
東北電力 第481回	200,000,000	205,714,000	
東北電力 第484回	100,000,000	101,487,000	
東北電力 第491回	100,000,000	100,818,000	
四国電力 第281回	200,000,000	206,436,000	
九州電力 第424回	300,000,000	310,962,000	
九州電力 第428回	105,000,000	108,157,350	
九州電力 第449回	200,000,000	201,538,000	
九州電力 第451回	100,000,000	100,880,000	
九州電力 第476回	100,000,000	100,562,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	102,860,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	108,288,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	101,542,000	
北海道電力 第345回	300,000,000	300,504,000	

	電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,033,000
	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,741,000
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,746,000
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,377,000
	電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,519,000
	電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,233,000
	東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,708,000
	東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	100,752,000
	東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	300,216,000
	東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,560,000
	東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	100,964,000
	東京瓦斯 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,256,000
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	126,301,000
	東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,843,000
	大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,723,000
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,371,000
	北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,161,000
	北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,529,000
	広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,961,000
	東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,753,000
	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	100,704,000
	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	102,204,000
	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	99,770,000
	ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,631,000
小計	銘柄数：229	28,705,000,000	29,250,651,350
	組入時価比率：4.3%		4.3%
合計			29,250,651,350
合計			682,929,390,177

(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22日現在）

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	51,611,493
コール・ローン	560,873,262
国債証券	573,655,875,374
派生商品評価勘定	681,098
未収入金	253,578,933
未収利息	4,554,303,642
前払費用	385,996,670
その他未収収益	8,643,432
流動資産合計	579,471,563,904
資産合計	579,471,563,904
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,569,735
未払金	345,122,434
未払解約金	375,911,188
未払利息	672
その他未払費用	7,312,226
流動負債合計	729,916,255
負債合計	729,916,255
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	241,015,940,773
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	337,725,706,876
元本等合計	578,741,647,649
純資産合計	578,741,647,649
負債純資産合計	579,471,563,904

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 6月22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	2.4013円
(10,000口当たり純資産額)	(24,013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	
	151,811,953,878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	159,754,155,029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25日 至 2020年 6月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 6月22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22日現在

	2019年 6月25日
期首	
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	266,092,316,762円
同期中における追加設定元本額	36,622,410,788円
同期中における一部解約元本額	61,698,786,777円
期末元本額	241,015,940,773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	289,736,439円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,565,421,984円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,380,202,348円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,472,029,490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	29,596,852円
野村資産設計ファンド2025	45,650,349円
野村資産設計ファンド2030	43,882,777円
野村資産設計ファンド2035	30,433,430円
野村資産設計ファンド2040	55,834,017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）	102,904,245,225円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	5,709,278,603円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	12,150,378,464円
のむらっぴ・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）	588,325,145円
野村資産設計ファンド2045	7,025,688円
野村インデックスファンド・外国債券	816,244,600円
マイ・ロード	8,646,825,984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	147,824,328円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	6,159,016,150円

野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,084,522,295円
野村資産設計ファンド2050	8,771,499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	2,129,213円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,533,798円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,054,173円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	499,599,978円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	370,618,294円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,073,890円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,356,145円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,316,218円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,442,888円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,372,002円
野村6資産均等バランス	856,603,986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)	7,400,462,235円
世界6資産分散ファンド	80,424,142円
野村資産設計ファンド2060	2,558,461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	1,984,386,398円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,615,871,854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)	9,010,764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)	1,351,323,412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)	318,278,286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)	1,520,090,474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)	1,243,431,790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)	3,220,098,289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)	15,216,778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)	16,335,093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)	161,323,458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)	175,387,885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)	1,721,338,397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)	671,003,405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)	1,596,621,484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)	588,463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)	579,807,538円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,034,928,722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)	4,055,816,335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)	16,481,379,551円



マイバランスDC30	1,668,007,695円
マイバランスDC50	1,145,439,037円
マイバランスDC70	726,879,219円
野村DC外国債券インデックスファンド	6,080,731,953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)	145,876,135円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	208,370,309円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	103,179,599円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	9,601,202円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	23,803,981円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	8,852,537円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	4,221,609円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,509,316円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,505,441円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	54,840,312円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	35,312,873円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	15,693,180円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	18,200,514円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	540,075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22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22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	56,005,681.70	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	46,162,905.28	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	48,993,397.31	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	94,739,937.50	
		US TREASURY BOND	10,800,000.00	15,197,625.00	
		US TREASURY BOND	46,200,000.00	64,337,108.22	
		US TREASURY BOND	49,300,000.00	68,157,250.00	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	38,293,750.00	

US TREASURY BOND	100,000.00	154,414.06	
US TREASURY BOND	17,500,000.00	22,646,093.75	
US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,949,687.40	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,051,327.90	
US TREASURY N/B	900,000.00	921,621.06	
US TREASURY N/B	32,500,000.00	33,147,458.50	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,615,624.96	
US TREASURY N/B	28,300,000.00	28,720,076.71	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,591,191.10	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,660,062.50	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,345,183.54	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	26,681,132.16	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,463,062.50	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,343,304.24	
US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,766,101.08	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	31,145,748.48	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,927,312.50	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,232,069.50	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,688,964.75	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,024,179.60	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,782,960.66	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,757,468.44	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,883,202.79	
US TREASURY N/B	80,000,000.00	82,865,624.00	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,534,000.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,377,343.40	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,343,753.82	
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	3,598,437.50	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,007,859.18	
US TREASURY N/B	500,000.00	514,804.65	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,348,292.92	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,758,373.36	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	26,082,718.75	

US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,058,843.20	
US TREASURY N/B	200,000.00	206,515.62	
US TREASURY N/B	900,000.00	927,070.29	
US TREASURY N/B	16,400,000.00	17,038,061.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,117.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,781.25	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,035,156.20	
US TREASURY N/B	900,000.00	927,667.89	
US TREASURY N/B	19,100,000.00	19,801,327.17	
US TREASURY N/B	900,000.00	931,640.58	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,563,515.55	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,857,984.28	
US TREASURY N/B	10,200,000.00	10,691,671.62	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	49,823,481.98	
US TREASURY N/B	400,000.00	418,937.48	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,695,312.00	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,227,264.91	
US TREASURY N/B	400,000.00	414,312.48	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,603,514.50	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,349,685.76	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,580,218.52	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,953,000.00	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	44,317,357.32	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,965,663.90	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,300,233.83	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,522,749.12	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	12,348,514.74	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	46,204,356.18	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,792,250.00	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,690,625.00	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	46,023,437.50	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,404,812.50	
US TREASURY N/B	800,000.00	872,624.96	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,819,265.54	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	23,906,093.20	

US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,922,406.25	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,087,671.78	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	46,009,250.00	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,903,750.00	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	37,109,671.02	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,484,359.26	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,211,069.89	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,114,640.53	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	36,258,678.87	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	38,723,552.10	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,748,714.24	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,590,398.13	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	29,257,029.90	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	21,840,000.00	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	55,330,000.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,136,406.20	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,569,514.98	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,924,734.24	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,428,639.57	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,663,750.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	6,001,624.72	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,242,108.40	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,160,936.00	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,590,671.31	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,977,420.60	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	42,776,717.80	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	9,410,625.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	581,835.90	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,118,796.74	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,447,218.72	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,153,750.00	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,613,351.52	
US TREASURY N/B	36,700,000.00	54,402,013.79	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	9,436,109.22	
US TREASURY N/B	200,000.00	326,156.24	

US TREASURY N/B	100,000.00	156,726.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	140,546.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	153,515.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	158,210.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	156,125.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	161,054.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	156,765.62	
US TREASURY N/B	200,000.00	295,812.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	155,078.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	164,562.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	157,734.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	146,039.06	
US TREASURY N/B	300,000.00	402,445.29	
US TREASURY N/B	100,000.00	134,406.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,828.12	
US TREASURY N/B	200,000.00	253,781.24	
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,886,206.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	144,679.68	
US TREASURY N/B	7,400,000.00	10,737,515.44	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	21,294,250.00	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	31,067,967.60	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	48,924,208.17	
US TREASURY N/B	39,400,000.00	48,095,702.14	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	29,109,889.53	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	22,825,194.00	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,937,187.50	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	63,099,566.45	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	34,595,669.76	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	40,440,468.75	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	18,680,764.56	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,291,679.56	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	14,736,280.68	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	12,030,421.41	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	12,862,850.85	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	7,067,882.43	

小計	US TREASURY N/B	10,500,000.00	14,275,077.60	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	3,371,163.93	
	US TREASURY N/B	100,000.00	133,703.12	
	US TREASURY N/B	9,400,000.00	11,161,764.92	
	US TREASURY N/B	300,000.00	365,789.04	
	銘柄数：153	2,143,620,000.00	2,445,661,700.10	(261,123,299,719)
	組入時価比率：45.1%			45.4%
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,765,760.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,750,000.00	12,091,455.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,600,000.00	11,768,432.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,006,570.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,335.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,806,932.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	311,655.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,614,717.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,158,586.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	535,200.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,376,164.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,707,540.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,040,992.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	319,602.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,250,000.00	10,984,692.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	207,722.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	111,986.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,702,788.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,153,520.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,819,330.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	6,291,622.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	11,228,863.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	15,537,323.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,859,741.00	
CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	760,014.00		
CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	162,058.00		
小計	銘柄数：26	116,690,000.00	143,624,600.70	

			(11,255,859,956)	
	組入時価比率：1.9%		2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	95,300,000.00	96,708,448.23	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	84,700,000.00	87,574,870.46	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,766,085.88	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	314,256.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	59,160,335.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	47,779,200.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	52,194,672.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	124,073,532.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	53,347,545.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,500,000.00	77,118,670.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,306,600.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	75,637,361.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,800,000.00	42,161,302.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	66,500,000.00	72,222,990.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	47,944,140.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	87,100,000.00	95,535,635.00	
	小計	銘柄数：16	894,100,000.00	988,845,642.57 (4,667,351,432)
	組入時価比率：0.8%		0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	742,581.00	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	865,244.00	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	653,940.00	
	BELGIUM KINGDOM	11,100,000.00	12,044,721.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,969,890.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,500,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,042,795.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,187,428.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,000,000.00	7,708,224.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,572,158.92	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,153,776.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,083,370.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,289,779.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,670,190.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,143,414.50	

BELGIUM KINGDOM	100,000.00	115,360.00	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	596,214.00	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	127,415.70	
BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	5,961,220.00	
BELGIUM KINGDOM	4,400,000.00	7,724,992.00	
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,530,248.40	
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	5,190,180.00	
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,824,607.20	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,569,437.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,686,891.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,746,970.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,100,000.00	5,166,789.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,700,000.00	10,761,781.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,650,000.00	20,529,584.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,414,728.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,057,300.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	17,355,064.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,278,804.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,133,520.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,260,718.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,965,015.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	507,090.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	974,142.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,750,711.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,588,005.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,457,182.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,396,665.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,376,675.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,181,564.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,454,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,018,140.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,297,644.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,527,520.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,561,353.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	9,638,540.40	



BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	16,781,359.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,410,032.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	11,809,010.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	2,774,120.69	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	100,828.00	
BUNDES OblIGATION	3,700,000.00	3,744,511.00	
BUNDES OblIGATION	750,000.00	761,805.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,019,890.00	
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,057,940.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	364,042.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	413,840.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,197,640.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	734,041.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	412,943.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,200,000.00	9,789,904.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,801,002.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	23,900,000.00	29,844,169.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,853,204.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,800,000.00	11,728,908.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,670,483.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,849,499.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,892,337.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,800,000.00	22,176,752.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,039,830.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	741,356.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	30,481,396.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	216,014.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	26,840,086.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,517,656.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,466,448.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,500,000.00	32,314,620.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,152,686.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,600,000.00	14,872,023.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	14,407,155.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	7,066,407.04	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	10,826,335.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,430,000.00	2,510,495.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,444,724.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,200,000.00	18,681,040.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,450,000.00	16,853,565.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,500,000.00	1,514,655.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,700,000.00	1,717,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,126,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,340,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	17,454,525.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,900,000.00	6,085,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,050,000.00	10,105,275.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,683,876.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	20,487,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	6,322,388.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,941,496.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	406,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,163,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,187,847.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000.00	34,950,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,891,925.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,231,943.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	568,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	24,074,380.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,844,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	315,030.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,548,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,867,790.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,080,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,131,503.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	810,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,110,793.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,620,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,189,000.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,808,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,140,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,108,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	24,115,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,417,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	40,281,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	23,248,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	508,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	15,989,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,534,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	21,652,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,601,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	906,290.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	569,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,366,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	234,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	17,278,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	12,972,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	4,184,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,441,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,275,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	9,263,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,833,863.10	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	505,449.50	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,011.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,935.80	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	407,594.80	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	769,370.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,429,620.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,259.20	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,112,904.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,123,926.51	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,565,427.20	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	880,620.00	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	231,380.60	

FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,041,960.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	616,780.40	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	391,016.10	
FRANCE (GOVT OF)	6,000,000.00	6,059,088.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,641,080.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,677,485.02	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	102,035.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,600,000.00	10,667,110.08	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,842,343.20	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,547,888.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,896,120.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,810,720.00	
FRANCE (GOVT OF)	7,700,000.00	8,421,721.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,163,324.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,575,629.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,127,216.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,500,000.00	12,012,341.50	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	12,174,372.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	116,440.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	126,920.40	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	14,522,000.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,761,022.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	519,771.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,400,000.00	3,575,419.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	9,066,066.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,100,000.00	5,159,364.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	18,782,227.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,763,430.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	31,395,600.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,306,256.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	26,741,979.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,478,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	42,035,070.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,530,050.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,837,419.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	15,847,407.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	34,469,972.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,300,000.00	17,352,492.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	501,210.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,100,000.00	14,843,250.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,700,000.00	49,044,382.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,900,000.00	10,093,558.51	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	10,205,392.00	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,096,479.98	
IRISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,327,196.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,227,481.80	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	662,470.20	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,749,319.52	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,278,039.40	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,838,814.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	700,000.00	855,146.11	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,945,096.60	
IRISH TSY 2.4% 2030	3,700,000.00	4,578,454.00	
IRISH TSY 2% 2045	3,100,000.00	4,164,744.60	
IRISH TSY 2022	9,000,000.00	9,106,317.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,976,033.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	52,065.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,514,362.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	106,019.42	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	222,680.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,700,000.00	6,900,990.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	429,250.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,223.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	8,700,000.00	9,635,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,562,700.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	2,016,755.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,714,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,892,810.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,093,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	3,580,200.00	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	9,500,000.00	12,765,910.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,200,000.00	3,706,146.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	551,142.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	2,723,157.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	7,500,000.00	12,894,120.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,557,624.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	735,149.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,448,960.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,355.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	219,498.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	915,615.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	161,754.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,328,405.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	768,044.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,418,978.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,066,440.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,150,212.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,181,507.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	8,095,520.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	6,391,416.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	669,694.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,396,248.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,100,000.00	9,278,280.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,231,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	1,028,276.50	
	REPUBLIC OF IRELAND	4,450,000.00	4,986,710.05	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,718,640.00	
	SPANISH GOVERNMENT	31,400,000.00	50,381,300.00	
	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	759,738.20	
小計	銘柄数：254	1,488,750,000.00	1,921,027,778.50 (229,313,085,919)	
	組入時価比率：39.6%		40.0%	
英債券	UK TREASURY	40,000.00	43,055.20	
	UK TREASURY	470,000.00	491,197.00	
	UK TREASURY	650,000.00	694,895.50	

UK TREASURY	2,800,000.00	2,832,032.00	
UK TREASURY	400,000.00	415,844.00	
UK TREASURY	6,000,000.00	6,017,640.00	
UK TREASURY	14,000,000.00	14,332,780.00	
UK TREASURY	4,800,000.00	5,150,592.00	
UK TREASURY	1,600,000.00	1,662,784.00	
UK TREASURY	7,450,000.00	8,321,128.50	
UK TREASURY	9,950,000.00	12,288,747.50	
UK TREASURY	200,000.00	206,130.00	
UK TREASURY	200,000.00	221,310.00	
UK TREASURY	160,000.00	174,537.60	
UK TREASURY	400,000.00	433,336.00	
UK TREASURY	9,630,000.00	12,612,603.60	
UK TREASURY	200,000.00	225,208.00	
UK TREASURY	7,900,000.00	11,775,108.00	
UK TREASURY	6,000,000.00	8,798,400.00	
UK TREASURY	5,550,000.00	8,080,245.00	
UK TREASURY	15,700,000.00	24,405,650.00	
UK TREASURY	2,600,000.00	4,054,440.00	
UK TREASURY	100,000.00	172,540.00	
UK TREASURY	600,000.00	992,520.00	
UK TREASURY	500,000.00	843,050.00	
UK TREASURY	400,000.00	445,080.00	
UK TREASURY	1,200,000.00	2,152,440.00	
UK TREASURY	18,440,000.00	30,005,568.00	
UK TREASURY	6,300,000.00	11,668,230.00	
UK TREASURY	8,200,000.00	9,800,640.00	
UK TREASURY	16,100,000.00	20,435,730.00	
UK TREASURY	5,350,000.00	10,389,165.00	
UK TREASURY	6,750,000.00	12,744,000.00	
UK TREASURY	1,000,000.00	1,292,600.00	
UK TREASURY	1,100,000.00	1,504,580.00	
UK TREASURY	100,000.00	174,280.00	
UK TREASURY	650,000.00	1,434,745.00	
UK TSY 3 1/4% 2044	28,400,000.00	44,008,640.00	

小計	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	6,800,000.00	14,530,240.00	
	銘柄数：39	198,690,000.00	285,831,711.90	(37,666,902,994)
	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	38,700,396.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,394,824.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	32,250,000.00	36,589,237.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,909,756.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,921,574.72	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,294,708.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	16,255,728.30	
小計	銘柄数：7	129,800,000.00	146,066,224.92	(1,647,627,017)
	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	10,829,935.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	38,900,000.00	42,836,680.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	5,009,560.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,980,825.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,392,000.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,999,200.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	24,223,100.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,888,041.50	
小計	銘柄数：8	100,100,000.00	109,159,342.30	(1,206,210,732)
	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	15,122,246.40	
	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	408,000.00	
	KINGDOM OF DENMARK	22,770,000.00	24,384,393.00	
	KINGDOM OF DENMARK	32,000,000.00	35,868,800.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,745,620.00	
	KINGDOM OF DENMARK	21,400,000.00	22,968,620.00	
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	71,401,236.42	
小計	銘柄数：7	144,770,000.00	186,898,915.82	(2,992,251,642)
	組入時価比率：0.5%			0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	51,600,000.00	53,643,360.00	



小計	POLAND GOVERNMENT BOND	34,800,000.00	37,387,919.40
	POLAND GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	24,427,700.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,868,910.00
	銘柄数：4 組入時価比率：0.6%	123,400,000.00	132,327,889.40 (3,535,801,204) 0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	10,054,291.38
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,040,000.00	3,381,544.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	83,832.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	6,198,785.28
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,868,880.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,200,000.00	17,287,785.36
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,551,474.63
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,482,430.37
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,687,392.96
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,884,380.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,440,952.01
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,218,074.03
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	15,592,920.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,500,000.00	13,287,691.10
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	10,953,812.10
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,183,198.94
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	5,441,958.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	896,770.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,565,354.31
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,717,750.00
小計	銘柄数：20 組入時価比率：2.2%	144,400,000.00	170,779,276.47 (12,442,978,083) 2.2%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	480,000.00	488,790.33
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,429,040.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,359,432.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,547,120.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	310,950.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,600,000.00	3,855,240.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,532,360.00

	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,099,139.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,197,900.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	761,110.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,611,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	569,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	351,603.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,846,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,540,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,421,279.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,050,000.00	2,626,050.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,307,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,133,995.00	
小計	銘柄数：19	31,080,000.00	34,988,608.33	
			(2,672,429,904)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,132,142.11	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	425,423.24	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,946,901.88	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3,800,000.00	4,015,122.56	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	460,878.96	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	408,846.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,353,624.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	510,913.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,712,809.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	516,992.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,926,304.35	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,637,656.05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,293,567.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,171,847.28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	641,169.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,482,002.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,916,261.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,339,466.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,329,679.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,151,033.65	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	302,014.66	

		MALAYSIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	14,178,926.43	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,802,966.52	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	431,312.44	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	839,485.04	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	982,311.93	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,270,553.16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,404,508.25	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,560,709.21	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	343,568.85	
	小計	銘柄数：30	108,580,000.00	117,489,000.32	
				(2,932,525,447)	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,600,000.00	2,828,025.20	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,072,154.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,142,976.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,573,928.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,232,671.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,673,863.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,369,551.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,836,051.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,521,510.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,682,205.50	
		ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,064,552.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	8,843,510.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	7,318,863.00	
	小計	銘柄数：13	59,600,000.00	71,159,861.70	
				(2,199,551,325)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	合計			573,655,875,374	
				(573,655,875,374)	

(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22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22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	340,764,735	-	339,195,000	1,569,735
米ドル	160,368,435	-	160,140,000	228,435
ユーロ	180,396,300	-	179,055,000	1,341,300
売建	194,762,098	-	194,081,000	681,098
米ドル	85,517,656	-	85,408,000	109,656
ユーロ	95,935,952	-	95,496,000	439,952

英ポンド	13,308,490	-	13,177,000	131,490
合計	-	-	-	888,637

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2020年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	70,072,280
コール・ローン	15,982,873
国債証券	6,291,048,627
未収利息	80,487,691
前払費用	9,671,617
流動資産合計	6,467,263,088
資産合計	
6,467,263,088	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,825
未払解約金	4,937,953
未払利息	19
その他未払費用	475,800
流動負債合計	5,421,597
負債合計	
5,421,597	
純資産の部	
元本等	
元本	4,944,159,603
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,517,681,888
元本等合計	6,461,841,491
純資産合計	
6,461,841,491	
負債純資産合計	
6,467,263,088	

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 6月22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	1.3070円
(10,000口当たり純資産額)	(13,070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25日 至 2020年 6月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>

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22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22日現在	
期首	2019年 6月25日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	6,980,222,901円
同期中における追加設定元本額	1,655,956,755円
同期中における一部解約元本額	3,692,020,053円
期末元本額	4,944,159,603円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	10,620,285円
野村資産設計ファンド2020	12,120,051円
野村資産設計ファンド2025	19,320,796円
野村資産設計ファンド2030	18,572,711円
野村資産設計ファンド2035	12,871,252円
野村資産設計ファンド2040	23,621,278円
野村資産設計ファンド2045	2,963,500円
野村インデックスファンド・新興国債券	915,350,594円
ネクストコア	16,786,771円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	272,601,907円
野村資産設計ファンド2050	3,628,625円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	2,387,501円



野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	900,516円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	648,695円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	431,691円
世界6資産分散ファンド		148,309,393円
野村資産設計ファンド2060		1,035,671円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券(適格機関投資家専用)		2,657,359,547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)		90,374円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)		144,599,668円
野村DC新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド		398,116,715円
野村DC運用戦略ファンド		257,774,628円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)		20,352,024円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030		1,786,731円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040		1,061,263円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050		622,840円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060		224,576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22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22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,600,000.00	8,891,899.48	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	11,338,444.70	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	3,400,000.00	3,561,568.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,099,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,500,000.00	8,958,600.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000.00	11,090,096.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,850,000.00	15,302,034.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,200,000.00	9,656,730.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,600,000.00	7,430,412.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	4,748,772.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,627,369.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,600,000.00	6,595,064.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,700,000.00	7,276,602.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	9,477,330.00	
				MEXICAN FIXED RATE BONDS	8,500,000.00
	小計	銘柄数：15	116,250,000.00	128,377,646.18	

			(605,942,489)	
	組入時価比率：9.4%		9.6%	
レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	5,100,000.00	4,869,892.59	
	LETRA TESOURO NACIONAL	4,900,000.00	4,553,968.37	
	LETRA TESOURO NACIONAL	2,800,000.00	2,433,511.64	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000.00	7,200,322.27	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000.00	4,985,439.86	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000.00	3,924,361.92	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	3,102,835.25	
小計	銘柄数：7	14,391,000.00	31,070,331.90	
	組入時価比率：9.7%		(624,513,671)	10.0%
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	111,195,890.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	130,000,000.00	154,679,850.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	195,000,000.00	240,947,265.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	301,597,368.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	215,000,000.00	337,964,950.00	
小計	銘柄数：5	880,000,000.00	1,146,385,323.00	
	組入時価比率：2.3%		(150,061,838)	2.4%
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,160,000,000.00	2,218,665,600.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,810,000,000.00	6,071,518,700.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	919,325,520.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,600,000,000.00	1,663,358,880.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,400,000,000.00	1,467,946,060.00	
小計	銘柄数：5	10,870,000,000.00	12,340,814,760.00	
	組入時価比率：5.4%		(351,713,220)	5.6%
ソル	BONOS DE TESORERIA	300,000.00	347,270.37	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	691,598.16	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	691,155.84	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	748,653.08	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	716,880.36	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	905,993.13	
	PERU BONO SOBERANO	1,100,000.00	1,349,149.01	
	PERU BONO SOBERANO	620,000.00	754,876.59	
	REPUBLIC OF PERU	700,000.00	826,836.22	
小計	銘柄数：9	6,020,000.00	7,032,412.76	
	組入時価比率：3.3%		(214,418,265)	3.4%
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,606,402.40	
	銘柄数：1	4,000,000.00	3,606,402.40	
小計			(9,016,006)	

	組入時価比率：0.1%		0.1%
ドミニカペソ	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	6,810,960.00
小計	銘柄数：1	8,000,000.00	6,810,960.00 (12,464,056)
	組入時価比率：0.2%		0.2%
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	300,000.00	303,750.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	250,000.00	253,250.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,244,400.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	790,000.00	786,840.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	500,000.00	532,250.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,270,000.00	2,137,205.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	523,640.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	210,000.00	202,020.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	920,040.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,266,200.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,163,400.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	661,500.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,863,900.00
小計	銘柄数：13	12,060,000.00	11,858,395.00 (184,872,378)
	組入時価比率：2.9%		2.9%
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	20,400,000.00	20,485,977.84
	CZECH REPUBLIC	23,600,000.00	24,098,547.64
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	13,262,700.00
	CZECH REPUBLIC	6,500,000.00	7,338,352.45
小計	銘柄数：4	63,700,000.00	65,185,577.93 (292,031,389)
	組入時価比率：4.5%		4.6%
フォロント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,237,400.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	19,088,450.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	125,000,000.00	127,522,125.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	89,479,005.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	72,712,400.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	75,418,875.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	91,478,200.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	88,572,283.60
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	77,796,450.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	64,106,148.00
小計	銘柄数：10	645,000,000.00	716,411,336.60 (247,090,269)
	組入時価比率：3.8%		3.9%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,702,960.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,323,658.04

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	3,239,735.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,297,462.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,206,381.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	888,280.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,300,000.00	3,711,160.20	
	銘柄数：7	18,800,000.00	20,369,636.64 (544,276,691)	
	組入時価比率：8.4%		8.7%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	8,000,000.00	8,284,240.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	20,751,100.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	22,500,000.00	24,009,750.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	12,817,020.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	30,609,500.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	14,000,000.00	14,875,210.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,300,000.00	41,067,113.50	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,000,000.00	20,727,180.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000.00	55,345,833.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	20,861,720.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	11,096,950.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	32,838,270.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	32,312,500.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	11,413,900.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,000,000.00	21,744,540.00	
	小計	銘柄数：15	319,200,000.00	358,754,826.50 (548,894,884)
		組入時価比率：8.5%		8.7%
レイ	ROMANIA	300,000.00	308,331.00	
	ROMANIA	500,000.00	504,915.00	
	ROMANIA	900,000.00	900,337.50	
	ROMANIA	1,000,000.00	1,001,970.00	
	ROMANIA	550,000.00	584,619.75	
	ROMANIA	500,000.00	493,610.70	
	ROMANIA	1,000,000.00	1,031,730.00	
	ROMANIA	920,000.00	962,996.20	
	ROMANIA	500,000.00	528,275.00	
	ROMANIA	760,000.00	855,988.60	
	ROMANIA	800,000.00	860,704.00	
小計	銘柄数：11	7,730,000.00	8,033,477.75 (198,105,561)	
	組入時価比率：3.1%		3.1%	
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	319,067.43	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,000,000.00	2,141,742.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	845,288.96	

小計	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,152,197.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	620,000.00	633,712.66	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,328,374.45	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,247,196.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,246,913.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,766,690.16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,068,615.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	641,581.86	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,497,784.54	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,906,101.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	539,311.90	
	銘柄数：14	16,320,000.00	17,334,579.72 (432,671,109)	
	組入時価比率：6.7%		6.9%	
	パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,534,923.12
THAILAND GOVERNMENT BOND		15,000,000.00	15,395,554.50	
THAILAND GOVERNMENT BOND		5,000,000.00	5,174,743.50	
THAILAND GOVERNMENT BOND		16,700,000.00	18,170,017.50	
THAILAND GOVERNMENT BOND		3,000,000.00	3,177,690.90	
THAILAND GOVERNMENT BOND		11,900,000.00	12,227,520.13	
THAILAND GOVERNMENT BOND		4,000,000.00	4,616,732.40	
THAILAND GOVERNMENT BOND		17,700,000.00	18,860,732.37	
THAILAND GOVERNMENT BOND		7,600,000.00	8,593,145.20	
THAILAND GOVERNMENT BOND		10,200,000.00	13,339,528.38	
THAILAND GOVERNMENT BOND		8,800,000.00	9,075,865.04	
THAILAND GOVERNMENT BOND		6,000,000.00	7,313,765.40	
THAILAND GOVERNMENT BOND		8,200,000.00	10,196,422.02	
THAILAND GOVERNMENT BOND		6,000,000.00	6,002,439.00	
THAILAND GOVERNMENT BOND		12,500,000.00	15,539,198.75	
THAILAND GOVERNMENT BOND		1,900,000.00	2,336,159.44	
THAILAND GOVERNMENT BOND		11,000,000.00	12,760,220.00	
小計		銘柄数：17	152,700,000.00	170,314,657.65 (587,585,568)
組入時価比率：9.1%			9.3%	
フィリピンペソ		REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	10,068,300.00
	小計	銘柄数：1	10,000,000.00	
	組入時価比率：0.3%		(21,445,479) 0.3%	
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	5,380,000,000.00	5,490,290,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,700,000,000.00	2,657,340,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,730,000,000.00	7,144,568,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000.00	9,281,360,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,387,520,000.00	

	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,874,038,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,250,000,000.00	6,268,750,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	4,684,500,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,530,000,000.00	6,124,475,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,400,000,000.00	6,823,680,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,353,034,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,476,500,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,740,320,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,672,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,158,080,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,490,360,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,680,000,000.00	5,969,680,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,000,000,000.00	3,106,800,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,400,000,000.00	3,349,680,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,625,250,000.00	
小計	銘柄数：20	81,060,000,000.00	83,678,225,500.00	
			(635,954,513)	
	組入時価比率：9.8%		10.2%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	6,399,966.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,300,000.00	12,951,702.92	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,000,000.00	11,101,180.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,460,000.00	3,674,594.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,000,000.00	6,128,687.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,441,789.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,177,689.76	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000.00	9,023,840.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	5,838,300.18	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	2,806,085.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,300,000.00	5,752,968.67	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,100,000.00	4,000,635.84	
小計	銘柄数：12	84,710,000.00	74,297,439.97	
			(456,186,281)	
	組入時価比率：7.1%		7.3%	
オフショア人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	1,021,990.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,495,900.00	
小計	銘柄数：2	11,000,000.00	11,517,890.00	
			(173,804,960)	
	組入時価比率：2.7%		2.8%	
合計			6,291,048,627	
			(6,291,048,627)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 6月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	5,345,825	-	5,338,000	7,825
米ドル	5,345,825	-	5,338,000	7,825
合計	5,345,825	-	5,338,000	7,825

(注)時価の算定方法

### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(2020年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,000,978,505
株式	431,013,776,070
派生商品評価勘定	3,626,250
未収配当金	2,603,756,925
未収利息	1,274,360
その他未収収益	31,200,818
差入委託証拠金	448,580,000
流動資産合計	457,103,192,928
資産合計	457,103,192,928
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	118,215,035
未払金	1,853,910
未払解約金	431,962,500
未払利息	27,575
有価証券貸借取引受入金	16,984,021,968
流動負債合計	17,536,080,988
負債合計	17,536,080,988
純資産の部	
元本等	

元本	272,092,969,076
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	167,474,142,864
元本等合計	439,567,111,940
純資産合計	439,567,111,940
負債純資産合計	457,103,192,928

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月22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	1.6155円
(10,000口当たり純資産額)	(16,155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	
	16,159,455,270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25日

至 2020年 6月22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22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22日現在

期首	2019年 6月25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	257,882,366,025円
同期中における追加設定元本額	69,717,244,724円
同期中における一部解約元本額	55,506,641,673円
期末元本額	272,092,969,076円
期末元本額の内訳*	

バランスセレクト30	163,686,227円
バランスセレクト50	371,843,754円
バランスセレクト70	476,579,049円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,674,493,977円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,507,591,208円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	7,729,696,619円
野村資産設計ファンド2015	48,024,803円
野村資産設計ファンド2020	54,270,015円
野村資産設計ファンド2025	89,818,337円
野村資産設計ファンド2030	110,623,850円
野村資産設計ファンド2035	86,084,958円
野村資産設計ファンド2040	178,511,700円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	92,723,577,833円
のむらップ・ファンド(保守型)	2,838,828,008円
のむらップ・ファンド(普通型)	8,875,761,120円
のむらップ・ファンド(積極型)	2,433,728,565円
野村資産設計ファンド2045	27,243,837円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,864,551,588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	1,461,314,140円
野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)	3,182,069,315円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	544,295,342円
野村資産設計ファンド2050	44,316,968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	6,886,892円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,451,481円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,456,272円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	309,561,400円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	330,065,214円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,787,866円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,898,912円
インデックス・ブレンド(タイプ)	19,923,159円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,252,335円
インデックス・ブレンド(タイプ)	22,007,857円
野村6資産均等バランス	1,285,111,357円
世界6資産分散ファンド	120,655,583円
野村資産設計ファンド2060	16,382,971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)	422,356,348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)	298,466,733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)	651,571,663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)	746,178,360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)	4,099,181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)	2,898,554,436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)	12,682,696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)	92,178,047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)	32,680,421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)	103,735,887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)	263,093,259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)	4,519,236,490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)	181,657,900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)	3,230,841,423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)	185,719,927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)	522,980,450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)	294,308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)	129,843,521円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,072,395,826円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	25,550,863,226円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	27,436,479,753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)	31,878,793,788円
マイバランスDC30	3,336,331,430円
マイバランスDC50	5,184,874,684円
マイバランスDC70	4,891,927,701円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,998,553,101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)	935,082,958円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	718,725,544円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	574,028,244円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	7,202,846円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,571,319円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	46,488,357円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	10,642,230円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	8,023,755円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	7,605,271円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	278,894,904円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	210,290,002円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	105,949,831円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	122,872,722円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	3,475,290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22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	2,683.00	24,683,600	
		日本水産	264,000	485.00	128,040,000	貸付有価証券 2,600株
		マルハニチロ	38,100	2,216.00	84,429,600	
		カネコ種苗	8,000	1,497.00	11,976,000	
		サカタのタネ	31,500	3,435.00	108,202,500	貸付有価証券 500株（400株）
		ホクト	20,100	2,030.00	40,803,000	貸付有価証券 700株
		ホクリヨウ	4,100	637.00	2,611,700	
		住石ホールディングス	53,300	122.00	6,502,600	
		日鉄鉱業	6,100	4,500.00	27,450,000	
		三井松島ホールディングス	10,300	859.00	8,847,700	
		国際石油開発帝石	1,059,300	705.00	746,806,500	
		石油資源開発	34,500	1,904.00	65,688,000	貸付有価証券 400株
		K&Oエナジーグループ	12,800	1,517.00	19,417,600	貸付有価証券 100株
		ヒノキヤグループ	6,600	1,719.00	11,345,400	
		ショーボンドホールディングス	41,100	4,880.00	200,568,000	貸付有価証券 1,000株
		ミライト・ホールディングス	78,500	1,602.00	125,757,000	
		タマホーム	14,200	1,267.00	17,991,400	貸付有価証券 3,900株
		サンヨーホームズ	2,300	632.00	1,453,600	
		日本アクア	10,500	589.00	6,184,500	貸付有価証券 2,200株
		ファーストコーポレーション	8,100	552.00	4,471,200	
ベステラ	4,500	1,014.00	4,563,000	貸付有価証券 2,100株（1,200株）		
TATERU	54,400	193.00	10,499,200	貸付有価証券 2,000株		

キャンディル	4,400	664.00	2,921,600	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	366.00	11,785,200	
ダイセキ環境ソリューション	5,100	973.00	4,962,300	
第一カッター興業	3,300	2,230.00	7,359,000	
明豊ファシリティワークス	8,500	578.00	4,913,000	
安藤・間	157,200	649.00	102,022,800	貸付有価証券 600株
東急建設	77,300	565.00	43,674,500	貸付有価証券 100株
コムシスホールディングス	93,600	3,065.00	286,884,000	貸付有価証券 2,300株
ピーアールホールディングス	28,800	552.00	15,897,600	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	2,445.00	40,098,000	
東建コーポレーション	8,100	7,420.00	60,102,000	貸付有価証券 200株
ソネック	2,700	836.00	2,257,200	
ヤマウラ	11,500	825.00	9,487,500	
大成建設	203,300	3,925.00	797,952,500	貸付有価証券 800株
大林組	609,700	1,024.00	624,332,800	貸付有価証券 800株
清水建設	618,800	890.00	550,732,000	貸付有価証券 4,800株
飛島建設	17,500	1,089.00	19,057,500	
長谷工コーポレーション	236,000	1,382.00	326,152,000	貸付有価証券 3,100株
松井建設	24,000	665.00	15,960,000	
銭高組	2,700	4,005.00	10,813,500	
鹿島建設	478,700	1,253.00	599,811,100	貸付有価証券 700株
不動テトラ	15,900	1,459.00	23,198,100	
大末建設	7,000	836.00	5,852,000	
鉄建建設	13,200	2,103.00	27,759,600	
西松建設	47,000	2,171.00	102,037,000	貸付有価証券 1,300株

三井住友建設	147,300	483.00	71,145,900	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	152,700	852.00	130,100,400	貸付有価証券 100株
佐田建設	13,100	425.00	5,567,500	
ナカノフード建設	16,700	399.00	6,663,300	
奥村組	33,100	2,479.00	82,054,900	
東鉄工業	26,100	2,705.00	70,600,500	
イチケン	4,400	1,514.00	6,661,600	
富士ピー・エス	9,000	570.00	5,130,000	
浅沼組	6,800	4,225.00	28,730,000	
戸田建設	253,200	690.00	174,708,000	貸付有価証券 9,800株
熊谷組	28,300	2,607.00	73,778,100	
北野建設	3,700	2,662.00	9,849,400	
植木組	2,700	2,432.00	6,566,400	
矢作建設工業	26,900	780.00	20,982,000	
ピーエス三菱	20,100	543.00	10,914,300	貸付有価証券 200株
日本ハウスホールディングス	41,600	284.00	11,814,400	
大東建託	66,600	10,750.00	715,950,000	
新日本建設	25,900	806.00	20,875,400	
N I P P O	50,500	2,620.00	132,310,000	
東亜道路工業	3,800	3,280.00	12,464,000	
前田道路	53,800	2,036.00	109,536,800	
日本道路	5,900	7,240.00	42,716,000	貸付有価証券 900株
東亜建設工業	19,000	1,586.00	30,134,000	貸付有価証券 7,200株(2,700株)
日本国土開発	59,300	561.00	33,267,300	
若築建設	11,000	1,172.00	12,892,000	
東洋建設	68,400	407.00	27,838,800	貸付有価証券 500株
五洋建設	241,700	574.00	138,735,800	貸付有価証券 9,100株
世紀東急工業	29,300	770.00	22,561,000	
福田組	7,100	4,735.00	33,618,500	

住友林業	154,400	1,301.00	200,874,400	貸付有価証券 4,800株
日本基礎技術	20,500	421.00	8,630,500	
巴コーポレーション	27,100	365.00	9,891,500	
大和ハウス工業	603,300	2,654.50	1,601,459,850	
ライト工業	34,900	1,473.00	51,407,700	貸付有価証券 100株
積水ハウス	661,300	2,056.00	1,359,632,800	貸付有価証券 49,000株
日特建設	15,900	776.00	12,338,400	
北陸電気工事	10,600	956.00	10,133,600	
ユアテック	34,900	645.00	22,510,500	貸付有価証券 500株
日本リーテック	12,800	2,394.00	30,643,200	貸付有価証券 3,600株（200株）
四電工	3,300	2,453.00	8,094,900	
中電工	24,600	2,260.00	55,596,000	貸付有価証券 100株
関電工	86,700	942.00	81,671,400	貸付有価証券 200株
きんでん	144,800	1,765.00	255,572,000	貸付有価証券 500株
東京エネシス	20,200	789.00	15,937,800	
トーエネック	6,100	3,670.00	22,387,000	
住友電設	17,200	2,367.00	40,712,400	
日本電設工業	33,400	2,303.00	76,920,200	貸付有価証券 200株
協和エクシオ	92,500	2,574.00	238,095,000	
新日本空調	16,100	2,444.00	39,348,400	貸付有価証券 900株
九電工	42,800	3,010.00	128,828,000	貸付有価証券 1,600株
三機工業	43,900	1,295.00	56,850,500	貸付有価証券 100株
日揮ホールディングス	187,700	1,173.00	220,172,100	貸付有価証券 3,700株
中外炉工業	6,600	1,573.00	10,381,800	
ヤマト	19,500	661.00	12,889,500	
太平電業	14,700	2,254.00	33,133,800	
高砂熱学工業	53,000	1,685.00	89,305,000	

三晃金属工業	2,600	2,101.00	5,462,600	
朝日工業社	4,100	3,230.00	13,243,000	
明星工業	39,400	789.00	31,086,600	
大気社	29,600	3,090.00	91,464,000	
ダイダン	14,600	2,908.00	42,456,800	
日比谷総合設備	19,600	1,894.00	37,122,400	
フィル・カンパニー	3,500	2,630.00	9,205,000	貸付有価証券 800株
OSJBホールディングス	96,100	237.00	22,775,700	貸付有価証券 2,700株
レイズネクスト	32,700	1,223.00	39,992,100	貸付有価証券 400株
日本製粉	57,100	1,603.00	91,531,300	
日清製粉グループ本社	220,500	1,652.00	364,266,000	貸付有価証券 1,000株
日東富士製粉	1,400	6,300.00	8,820,000	
昭和産業	17,900	3,270.00	58,533,000	貸付有価証券 8,500株（5,300株）
鳥越製粉	17,300	896.00	15,500,800	
中部飼料	23,800	1,714.00	40,793,200	
フィード・ワン	131,100	196.00	25,695,600	貸付有価証券 100株
東洋精糖	3,300	1,265.00	4,174,500	
日本甜菜製糖	10,200	1,684.00	17,176,800	
三井製糖	17,100	2,076.00	35,499,600	
塩水港精糖	21,100	208.00	4,388,800	貸付有価証券 9,500株
日新製糖	9,200	1,876.00	17,259,200	
森永製菓	45,800	4,430.00	202,894,000	
中村屋	5,100	4,055.00	20,680,500	
江崎グリコ	57,900	5,160.00	298,764,000	貸付有価証券 27,200株
名糖産業	9,400	1,302.00	12,238,800	
井村屋グループ	11,100	2,118.00	23,509,800	
不二家	10,900	2,149.00	23,424,100	
山崎製パン	146,300	1,863.00	272,556,900	貸付有価証券 18,500株
第一屋製パン	3,300	969.00	3,197,700	
モロゾフ	3,300	5,680.00	18,744,000	貸付有価証券



				1,500株
亀田製菓	11,100	5,160.00	57,276,000	
寿スピリッツ	18,800	4,895.00	92,026,000	貸付有価証券 200株
カルビー	88,900	2,922.00	259,765,800	
森永乳業	36,100	4,895.00	176,709,500	貸付有価証券 1,000株
六甲バター	12,900	1,534.00	19,788,600	
ヤクルト本社	134,200	6,700.00	899,140,000	
明治ホールディングス	129,000	8,540.00	1,101,660,000	
雪印メグミルク	47,000	2,517.00	118,299,000	貸付有価証券 600株
プリマハム	30,500	2,763.00	84,271,500	
日本ハム	74,600	4,315.00	321,899,000	貸付有価証券 6,500株
林兼産業	6,500	590.00	3,835,000	
丸大食品	20,800	1,914.00	39,811,200	
S Foods	15,600	2,666.00	41,589,600	
柿安本店	6,800	2,663.00	18,108,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	125,600	656.00	82,393,600	貸付有価証券 20,400株
サッポロホールディングス	66,600	2,052.00	136,663,200	貸付有価証券 1,200株
アサヒグループホールディングス	408,700	3,999.00	1,634,391,300	貸付有価証券 43,900株(24,500株)
キリンホールディングス	827,600	2,321.50	1,921,273,400	貸付有価証券 34,800株
宝ホールディングス	144,700	1,001.00	144,844,700	貸付有価証券 2,000株
オエノンホールディングス	51,500	403.00	20,754,500	
養命酒製造	6,000	1,849.00	11,094,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	137,000	2,069.00	283,453,000	貸付有価証券 100株
サントリー食品インターナショナル	130,600	4,360.00	569,416,000	
ダイトーグループホールディングス	10,000	4,965.00	49,650,000	貸付有価証券 4,300株(3,800株)
伊藤園	59,200	6,190.00	366,448,000	貸付有価証券 25,600株(14,200株)

キーコーヒー	19,200	2,305.00	44,256,000	
ユニカフェ	5,000	972.00	4,860,000	
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	3,410.00	85,591,000	
不二製油グループ本社	47,600	2,881.00	137,135,600	貸付有価証券 1,200株
かどや製油	2,100	3,650.00	7,665,000	
J - オイルミルズ	10,100	4,090.00	41,309,000	
キッコーマン	140,400	5,190.00	728,676,000	貸付有価証券 15,500株
味の素	430,900	1,840.50	793,071,450	貸付有価証券 200株
キュービー	108,700	2,109.00	229,248,300	貸付有価証券 300株
ハウス食品グループ本社	73,000	3,625.00	264,625,000	
カゴメ	74,100	3,195.00	236,749,500	貸付有価証券 34,100株
焼津水産化学工業	9,500	942.00	8,949,000	
アリアケジャパン	17,800	6,930.00	123,354,000	貸付有価証券 400株
ピエトロ	2,500	1,632.00	4,080,000	
エバラ食品工業	4,700	2,189.00	10,288,300	
やまみ	1,700	2,123.00	3,609,100	
ニチレイ	92,900	3,115.00	289,383,500	貸付有価証券 500株
東洋水産	100,400	5,790.00	581,316,000	貸付有価証券 100株
イートアンド	6,700	1,807.00	12,106,900	
大冷	2,500	1,987.00	4,967,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,800	1,099.00	11,869,200	貸付有価証券 400株
日清食品ホールディングス	82,900	9,210.00	763,509,000	貸付有価証券 300株
永谷園ホールディングス	9,500	2,184.00	20,748,000	
一正蒲鉾	7,600	1,022.00	7,767,200	貸付有価証券 3,600株
フジッコ	21,100	1,958.00	41,313,800	
ロック・フィールド	21,000	1,330.00	27,930,000	貸付有価証券 1,000株
日本たばこ産業	1,126,800	2,174.50	2,450,226,600	貸付有価証券

				311,200株
ケンコーマヨネーズ	10,900	1,992.00	21,712,800	
わらべや日洋ホールディングス	12,800	1,778.00	22,758,400	
なとり	10,900	1,778.00	19,380,200	貸付有価証券 4,200株
イフジ産業	3,400	806.00	2,740,400	
ピクルスコーポレーション	4,200	2,407.00	10,109,400	
北の達人コーポレーション	68,100	588.00	40,042,800	貸付有価証券 32,000株(8,800株)
ユーグレナ	84,100	797.00	67,027,700	貸付有価証券 2,500株(600株)
ミヨシ油脂	7,500	1,138.00	8,535,000	
理研ビタミン	18,400	2,244.00	41,289,600	
片倉工業	27,600	1,194.00	32,954,400	貸付有価証券 100株
グンゼ	14,000	3,880.00	54,320,000	
東洋紡	75,300	1,505.00	113,326,500	
ユニチカ	55,800	357.00	19,920,600	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	2,307.00	43,602,300	貸付有価証券 1,600株
シキボウ	10,000	991.00	9,910,000	貸付有価証券 100株
日本毛織	62,600	1,025.00	64,165,000	
ダイトウボウ	30,800	122.00	3,757,600	貸付有価証券 14,600株
トーア紡コーポレーション	7,600	485.00	3,686,000	
ダイドーリミテッド	25,000	221.00	5,525,000	貸付有価証券 100株
帝国繊維	21,500	2,282.00	49,063,000	
帝人	155,300	1,761.00	273,483,300	貸付有価証券 2,500株
東レ	1,378,800	516.00	711,460,800	貸付有価証券 27,900株
サカイオーベックス	5,100	2,202.00	11,230,200	
住江織物	4,200	2,092.00	8,786,400	

日本フェルト	10,800	472.00	5,097,600	貸付有価証券 4,800株
イチカワ	2,700	1,260.00	3,402,000	
日東製網	2,200	1,382.00	3,040,400	
アツギ	15,700	616.00	9,671,200	
ダイニック	7,200	738.00	5,313,600	
セーレン	46,800	1,392.00	65,145,600	
ソトー	7,600	956.00	7,265,600	
東海染工	2,600	1,126.00	2,927,600	
小松マテーレ	31,300	747.00	23,381,100	
ワコールホールディングス	49,700	2,087.00	103,723,900	
ホギメディカル	21,700	3,380.00	73,346,000	
クラウドシアホールディングス	4,700	445.00	2,091,500	貸付有価証券 2,200株
T S Iホールディングス	63,900	476.00	30,416,400	貸付有価証券 100株
マツオカコーポレーション	5,500	2,107.00	11,588,500	
ワールド	27,000	1,575.00	42,525,000	貸付有価証券 1,000株
三陽商会	9,900	836.00	8,276,400	貸付有価証券 3,900株
ナイガイ	6,900	382.00	2,635,800	
オンワードホールディングス	114,400	349.00	39,925,600	
ルックホールディングス	6,500	780.00	5,070,000	
ゴールドウイン	34,500	7,120.00	245,640,000	貸付有価証券 100株
デザート	37,100	1,521.00	56,429,100	貸付有価証券 900株
キング	9,000	546.00	4,914,000	
ヤマトインターナショナル	16,700	378.00	6,312,600	
特種東海製紙	12,100	4,655.00	56,325,500	
王子ホールディングス	796,000	522.00	415,512,000	貸付有価証券 600株
日本製紙	84,200	1,610.00	135,562,000	貸付有価証券 700株
三菱製紙	21,600	362.00	7,819,200	

北越コーポレーション	113,500	393.00	44,605,500	
中越パルプ工業	8,100	1,545.00	12,514,500	
巴川製紙所	5,600	913.00	5,112,800	
大王製紙	84,000	1,464.00	122,976,000	貸付有価証券 40,100株（27,800株）
阿波製紙	4,900	523.00	2,562,700	
レンゴー	180,000	903.00	162,540,000	貸付有価証券 12,200株
トーモク	11,700	1,716.00	20,077,200	
ザ・パック	14,400	3,170.00	45,648,000	貸付有価証券 6,800株
クラレ	299,900	1,191.00	357,180,900	貸付有価証券 3,500株
旭化成	1,262,200	881.00	1,111,998,200	貸付有価証券 400株
共和レザー	10,400	675.00	7,020,000	
昭和電工	135,600	2,580.00	349,848,000	貸付有価証券 17,200株
住友化学	1,399,000	337.00	471,463,000	貸付有価証券 82,100株
住友精化	8,400	3,530.00	29,652,000	
日産化学	105,800	5,570.00	589,306,000	貸付有価証券 600株
ラサ工業	6,700	1,569.00	10,512,300	
クレハ	16,300	4,800.00	78,240,000	
多木化学	7,400	7,670.00	56,758,000	貸付有価証券 2,700株
テイカ	14,000	1,451.00	20,314,000	
石原産業	34,100	720.00	24,552,000	
片倉コープアグリ	4,900	1,230.00	6,027,000	
日本曹達	28,200	2,866.00	80,821,200	
東ソー	294,300	1,506.00	443,215,800	貸付有価証券 200株
トクヤマ	54,900	2,517.00	138,183,300	貸付有価証券 300株
セントラル硝子	38,900	1,923.00	74,804,700	
東亜合成	119,500	1,060.00	126,670,000	
大阪ソーダ	19,400	2,467.00	47,859,800	
関東電化工業	45,200	873.00	39,459,600	

デンカ	69,500	2,669.00	185,495,500	
信越化学工業	327,000	12,345.00	4,036,815,000	貸付有価証券 800株
日本カーバイド工業	6,500	1,315.00	8,547,500	
堺化学工業	12,300	2,033.00	25,005,900	
第一稀元素化学工業	20,600	782.00	16,109,200	
エア・ウォーター	177,100	1,540.00	272,734,000	貸付有価証券 1,200株
大陽日酸	183,000	1,841.00	336,903,000	貸付有価証券 1,300株
日本化学工業	5,900	2,288.00	13,499,200	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	1,105.00	106,190,500	
高圧ガス工業	30,200	752.00	22,710,400	
チタン工業	2,400	1,839.00	4,413,600	貸付有価証券 700株
四国化成工業	29,400	1,129.00	33,192,600	
戸田工業	4,400	2,074.00	9,125,600	
ステラ ケミファ	10,400	2,469.00	25,677,600	
保土谷化学工業	7,100	4,050.00	28,755,000	
日本触媒	29,600	5,830.00	172,568,000	貸付有価証券 7,600株（1,600株）
大日精化工業	16,900	2,474.00	41,810,600	
カネカ	49,300	2,898.00	142,871,400	
三菱瓦斯化学	177,100	1,657.00	293,454,700	
三井化学	172,900	2,316.00	400,436,400	貸付有価証券 100株
J S R	177,400	2,030.00	360,122,000	貸付有価証券 100株
東京応化工業	32,700	5,100.00	166,770,000	
大阪有機化学工業	17,600	2,204.00	38,790,400	
三菱ケミカルホールディングス	1,273,000	646.70	823,249,100	貸付有価証券 121,000株
K Hネオケム	33,600	2,058.00	69,148,800	貸付有価証券 3,500株
ダイセル	247,900	855.00	211,954,500	貸付有価証券 100株
住友ベークライト	29,900	3,030.00	90,597,000	

積水化学工業	409,500	1,545.00	632,677,500	貸付有価証券 2,600株
日本ゼオン	171,700	1,014.00	174,103,800	貸付有価証券 200株
アイカ工業	57,100	3,435.00	196,138,500	
宇部興産	96,200	1,893.00	182,106,600	
積水樹脂	34,300	2,193.00	75,219,900	
タキロンシーアイ	41,200	695.00	28,634,000	
旭有機材	10,800	1,483.00	16,016,400	
ニチバン	10,000	1,498.00	14,980,000	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	47,900	450.00	21,555,000	
大倉工業	9,000	1,587.00	14,283,000	貸付有価証券 4,300株
積水化成工業	25,500	578.00	14,739,000	
群栄化学工業	4,300	2,629.00	11,304,700	
タイガースポリマー	10,000	487.00	4,870,000	
ミライアル	6,700	1,067.00	7,148,900	
ダイキアクシス	6,700	837.00	5,607,900	
ダイキョーニシカワ	40,100	506.00	20,290,600	
竹本容器	6,800	742.00	5,045,600	貸付有価証券 500株
森六ホールディングス	10,200	1,639.00	16,717,800	
日本化薬	117,900	1,090.00	128,511,000	貸付有価証券 1,900株
カーリットホールディングス	20,300	520.00	10,556,000	貸付有価証券 9,200株
日本精化	15,300	1,475.00	22,567,500	
扶桑化学工業	19,300	3,815.00	73,629,500	貸付有価証券 3,800株
トリケミカル研究所	4,200	11,170.00	46,914,000	貸付有価証券 100株
A D E K A	87,600	1,443.00	126,406,800	貸付有価証券 100株
日油	71,700	3,725.00	267,082,500	
新日本理化	31,500	170.00	5,355,000	
ハリマ化成グループ	15,700	997.00	15,652,900	
花王	465,500	8,650.00	4,026,575,000	貸付有価証券 10,800株

第一工業製薬	7,100	5,160.00	36,636,000	
石原ケミカル	5,200	1,930.00	10,036,000	
日華化学	6,400	955.00	6,112,000	
ニイタカ	3,900	6,160.00	24,024,000	貸付有価証券 900株
三洋化成工業	11,400	4,850.00	55,290,000	
有機合成薬品工業	14,600	373.00	5,445,800	貸付有価証券 6,800株（1,500株）
大日本塗料	21,500	920.00	19,780,000	貸付有価証券 200株
日本ペイントホールディングス	157,100	7,940.00	1,247,374,000	貸付有価証券 500株
関西ペイント	213,900	2,212.00	473,146,800	貸付有価証券 900株
神東塗料	15,000	194.00	2,910,000	
中国塗料	54,200	767.00	41,571,400	貸付有価証券 100株
日本特殊塗料	14,300	981.00	14,028,300	
藤倉化成	25,700	522.00	13,415,400	
太陽ホールディングス	14,000	4,890.00	68,460,000	
D I C	80,400	2,751.00	221,180,400	貸付有価証券 2,700株
サカタインクス	41,600	1,012.00	42,099,200	
東洋インキＳＣホールディングス	40,300	2,065.00	83,219,500	貸付有価証券 18,300株
T & K T O K A	14,700	819.00	12,039,300	
富士フイルムホールディングス	372,800	4,770.00	1,778,256,000	貸付有価証券 500株
資生堂	386,300	6,973.00	2,693,669,900	貸付有価証券 39,100株
ライオン	252,800	2,541.00	642,364,800	貸付有価証券 500株
高砂香料工業	12,200	2,230.00	27,206,000	
マンダム	43,700	2,061.00	90,065,700	
ミルボン	26,000	5,160.00	134,160,000	貸付有価証券 100株
ファンケル	78,700	3,110.00	244,757,000	貸付有価証券 34,200株
コーセー	36,600	14,220.00	520,452,000	貸付有価証券 3,600株



コタ	11,200	1,211.00	13,563,200	
シーボン	2,500	2,071.00	5,177,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	83,000	1,933.00	160,439,000	
ノエビアホールディングス	16,500	4,660.00	76,890,000	
アジュバンコスメジャパン	4,300	944.00	4,059,200	貸付有価証券 100株（100株）
エステー	12,500	1,708.00	21,350,000	
アグロ カネショウ	8,100	1,345.00	10,894,500	貸付有価証券 100株
コニシ	31,900	1,490.00	47,531,000	
長谷川香料	33,500	2,386.00	79,931,000	
星光P M C	11,100	720.00	7,992,000	
小林製薬	54,500	9,970.00	543,365,000	貸付有価証券 2,400株
荒川化学工業	17,500	1,239.00	21,682,500	
メック	13,300	2,000.00	26,600,000	
日本高純度化学	5,300	2,636.00	13,970,800	
タカラバイオ	50,900	3,255.00	165,679,500	貸付有価証券 5,600株（1,000株）
J C U	23,500	3,240.00	76,140,000	
新田ゼラチン	12,200	790.00	9,638,000	
O A T アグリオ	3,300	1,104.00	3,643,200	
デクセリアルズ	50,200	840.00	42,168,000	
アース製薬	14,700	7,520.00	110,544,000	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	2,693.00	17,235,200	
クミアイ化学工業	80,400	1,003.00	80,641,200	貸付有価証券 100株
日本農薬	34,600	465.00	16,089,000	貸付有価証券 300株
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	30,700	813.00	24,959,100	貸付有価証券 800株
日東電工	134,200	5,900.00	791,780,000	
レック	20,700	1,611.00	33,347,700	貸付有価証券

				300株
三光合成	22,200	293.00	6,504,600	
きもと	33,100	154.00	5,097,400	
藤森工業	17,400	3,670.00	63,858,000	
前澤化成工業	12,300	1,000.00	12,300,000	
未来工業	10,400	1,904.00	19,801,600	
ウェーブロックホールディングス	6,700	870.00	5,829,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
J S P	11,400	1,477.00	16,837,800	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	21,400	8,220.00	175,908,000	
天馬	12,900	1,674.00	21,594,600	
信越ポリマー	34,900	896.00	31,270,400	
東リ	48,400	275.00	13,310,000	
ニフコ	71,400	2,300.00	164,220,000	貸付有価証券 1,200株
バルカー	15,800	1,870.00	29,546,000	
ユニ・チャーム	374,800	4,334.00	1,624,383,200	
ショーエイコーポレーション	2,900	936.00	2,714,400	
協和キリン	195,600	2,889.00	565,088,400	貸付有価証券 20,900株
武田薬品工業	1,617,700	4,031.00	6,520,948,700	貸付有価証券 1,500株
アステラス製薬	1,685,800	1,799.00	3,032,754,200	貸付有価証券 4,600株
大日本住友製薬	144,100	1,480.00	213,268,000	貸付有価証券 1,200株
塩野義製薬	244,500	7,087.00	1,732,771,500	貸付有価証券 2,000株
わかもと製薬	23,100	288.00	6,652,800	貸付有価証券 100株
あすか製薬	22,100	1,192.00	26,343,200	
日本新薬	50,900	8,940.00	455,046,000	
バイオフェルミン製薬	3,300	2,347.00	7,745,100	
中外製薬	202,700	17,320.00	3,510,764,000	貸付有価証券 10,300株
科研製薬	33,300	5,670.00	188,811,000	貸付有価証券 100株
エーザイ	232,700	8,519.00	1,982,371,300	貸付有価証券

				1,000株
ロート製薬	99,800	3,430.00	342,314,000	貸付有価証券 1,300株
小野薬品工業	446,500	3,129.00	1,397,098,500	貸付有価証券 600株
久光製薬	51,400	5,710.00	293,494,000	
持田製薬	27,000	4,140.00	111,780,000	
参天製薬	362,200	2,030.00	735,266,000	貸付有価証券 800株
扶桑薬品工業	6,800	2,492.00	16,945,600	
日本ケミファ	2,600	2,636.00	6,853,600	
ツムラ	60,200	2,899.00	174,519,800	
日医工	55,100	1,371.00	75,542,100	貸付有価証券 300株
キッセイ薬品工業	34,400	2,629.00	90,437,600	
生化学工業	37,700	1,182.00	44,561,400	
栄研化学	34,200	1,808.00	61,833,600	貸付有価証券 2,500株
日水製薬	8,200	1,199.00	9,831,800	
鳥居薬品	12,200	3,000.00	36,600,000	貸付有価証券 200株
J C R ファーマ	13,700	12,060.00	165,222,000	
東和薬品	24,900	2,100.00	52,290,000	
富士製薬工業	13,200	1,212.00	15,998,400	
沢井製薬	39,900	5,680.00	226,632,000	
ゼリア新薬工業	35,300	2,027.00	71,553,100	貸付有価証券 100株
第一三共	556,400	8,974.00	4,993,133,600	貸付有価証券 1,500株
キョーリン製薬ホールディングス	42,900	2,228.00	95,581,200	貸付有価証券 600株
大幸薬品	23,700	2,521.00	59,747,700	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
ダイト	11,800	4,120.00	48,616,000	
大塚ホールディングス	370,400	4,887.00	1,810,144,800	貸付有価証券 19,500株
大正製薬ホールディングス	41,100	6,720.00	276,192,000	
ペプチドリーム	98,800	5,160.00	509,808,000	貸付有価証券 26,800株

日本コークス工業	164,300	64.00	10,515,200	貸付有価証券 400株
ニチレキ	23,000	1,562.00	35,926,000	
ユシロ化学工業	10,900	1,327.00	14,464,300	
ビーピー・カストロール	6,900	1,211.00	8,355,900	
富士石油	51,900	177.00	9,186,300	
MORESCO	7,000	1,046.00	7,322,000	
出光興産	215,800	2,339.00	504,756,200	貸付有価証券 8,300株
JXTGホールディングス	2,924,900	392.00	1,146,560,800	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	1,628.00	91,656,400	
横浜ゴム	112,600	1,539.00	173,291,400	貸付有価証券 500株
TOYO TIRE	111,600	1,468.00	163,828,800	貸付有価証券 9,700株
ブリヂストン	560,100	3,516.00	1,969,311,600	貸付有価証券 32,400株
住友ゴム工業	174,700	1,083.00	189,200,100	貸付有価証券 5,400株
藤倉コンポジット	17,000	379.00	6,443,000	
オカモト	11,800	3,890.00	45,902,000	
フコク	8,500	689.00	5,856,500	貸付有価証券 1,300株
ニッタ	21,900	2,239.00	49,034,100	
住友理工	37,700	635.00	23,939,500	
三ツ星ベルト	25,600	1,641.00	42,009,600	
バンドー化学	34,200	638.00	21,819,600	
日東紡績	28,900	5,290.00	152,881,000	貸付有価証券 12,300株
AGC	192,200	3,275.00	629,455,000	貸付有価証券 40,100株
日本板硝子	93,000	412.00	38,316,000	貸付有価証券 25,200株
石塚硝子	3,600	2,072.00	7,459,200	
日本山村硝子	8,100	863.00	6,990,300	
日本電気硝子	78,100	1,805.00	140,970,500	
オハラ	7,700	1,009.00	7,769,300	貸付有価証券 3,600株（2,000株）

住友大阪セメント	36,800	3,740.00	137,632,000	貸付有価証券 900株
太平洋セメント	122,800	2,513.00	308,596,400	
日本ヒューム	19,500	755.00	14,722,500	
日本コンクリート工業	41,900	274.00	11,480,600	
三谷セキサン	9,000	5,550.00	49,950,000	
アジアパイルホールディングス	27,600	471.00	12,999,600	
東海カーボン	203,700	1,059.00	215,718,300	貸付有価証券 85,800株(27,300株)
日本カーボン	10,000	3,560.00	35,600,000	貸付有価証券 700株
東洋炭素	11,400	1,684.00	19,197,600	
ノリタケカンパニーリミテド	10,800	3,560.00	38,448,000	
TOTO	138,900	4,270.00	593,103,000	貸付有価証券 500株
日本碍子	233,400	1,534.00	358,035,600	
日本特殊陶業	147,900	1,595.00	235,900,500	貸付有価証券 100株
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	7,910.00	59,325,000	
品川リフラクトリーズ	5,100	2,312.00	11,791,200	
黒崎播磨	3,900	3,800.00	14,820,000	
ヨータイ	15,400	726.00	11,180,400	
イソライト工業	10,000	489.00	4,890,000	
東京窯業	24,700	309.00	7,632,300	
ニッカトー	8,800	699.00	6,151,200	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレーテッド	17,300	3,090.00	53,457,000	貸付有価証券 2,800株
クニミネ工業	7,900	993.00	7,844,700	
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,087.00	3,587,100	
ニチアス	53,200	2,260.00	120,232,000	
ニチハ	27,000	2,283.00	61,641,000	貸付有価証券 200株
日本製鉄	860,500	1,077.00	926,758,500	貸付有価証券 9,800株

神戸製鋼所	351,900	414.00	145,686,600	貸付有価証券 53,200株
中山製鋼所	26,700	365.00	9,745,500	
合同製鐵	10,300	1,900.00	19,570,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	519,300	827.00	429,461,100	貸付有価証券 1,400株
東京製鐵	93,600	654.00	61,214,400	貸付有価証券 22,400株
共英製鋼	21,700	1,312.00	28,470,400	貸付有価証券 9,800株
大和工業	40,800	2,223.00	90,698,400	貸付有価証券 1,800株
東京鐵鋼	7,900	1,362.00	10,759,800	貸付有価証券 1,400株
大阪製鐵	10,200	1,232.00	12,566,400	
淀川製鋼所	26,000	1,871.00	48,646,000	
丸一鋼管	62,400	2,766.00	172,598,400	貸付有価証券 500株
モリ工業	5,800	2,491.00	14,447,800	
大同特殊鋼	31,500	3,500.00	110,250,000	
日本高周波鋼業	7,100	382.00	2,712,200	貸付有価証券 100株
日本冶金工業	15,900	1,666.00	26,489,400	貸付有価証券 1,100株
山陽特殊製鋼	13,200	985.00	13,002,000	
愛知製鋼	10,800	3,200.00	34,560,000	
日立金属	207,100	1,309.00	271,093,900	貸付有価証券 2,100株
日本金属	4,400	649.00	2,855,600	
大平洋金属	13,000	1,678.00	21,814,000	貸付有価証券 300株
新日本電工	123,900	174.00	21,558,600	貸付有価証券 800株
栗本鐵工所	9,500	1,772.00	16,834,000	貸付有価証券 100株
虹技	2,800	1,264.00	3,539,200	
日本鑄鉄管	2,000	1,368.00	2,736,000	
三菱製鋼	14,200	699.00	9,925,800	
日垂鋼業	28,100	308.00	8,654,800	
日本精線	3,100	3,300.00	10,230,000	

エンビプロ・ホールディングス	8,200	604.00	4,952,800	貸付有価証券 100株(100株)
シンニッタン	29,900	252.00	7,534,800	
新家工業	4,400	1,183.00	5,205,200	
大紀アルミニウム工業所	31,600	578.00	18,264,800	
日本軽金属ホールディングス	486,500	188.00	91,462,000	貸付有価証券 14,600株
三井金属鉱業	51,900	2,268.00	117,709,200	
東邦亜鉛	9,800	1,496.00	14,660,800	
三菱マテリアル	127,000	2,343.00	297,561,000	貸付有価証券 1,900株
住友金属鉱山	245,800	3,009.00	739,612,200	貸付有価証券 2,100株
DOWAホールディングス	48,600	3,300.00	160,380,000	貸付有価証券 100株
古河機械金属	34,200	1,108.00	37,893,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,000	976.00	19,520,000	貸付有価証券 3,900株(300株)
東邦チタニウム	34,400	664.00	22,841,600	貸付有価証券 5,300株(1,500株)
UACJ	29,200	1,999.00	58,370,800	
CKサンエツ	4,000	3,365.00	13,460,000	
古河電気工業	59,700	2,744.00	163,816,800	貸付有価証券 2,300株
住友電気工業	718,900	1,274.00	915,878,600	貸付有価証券 20,300株
フジクラ	232,200	326.00	75,697,200	貸付有価証券 11,500株(3,300株)
昭和電線ホールディングス	22,300	1,182.00	26,358,600	
東京特殊電線	2,900	2,128.00	6,171,200	
タツタ電線	38,100	592.00	22,555,200	貸付有価証券 200株
カナレ電気	3,200	1,873.00	5,993,600	貸付有価証券 1,500株
平河ヒューテック	9,600	1,076.00	10,329,600	貸付有価証券 400株
リョービ	23,600	1,285.00	30,326,000	
アーレスティ	25,200	376.00	9,475,200	
アサヒホールディングス	33,700	2,766.00	93,214,200	

稲葉製作所	10,800	1,403.00	15,152,400	貸付有価証券 5,100株
宮地エンジニアリンググループ	5,800	1,674.00	9,709,200	貸付有価証券 400株
トーカロ	53,400	1,145.00	61,143,000	
アルファCo	6,800	938.00	6,378,400	
SUMCO	228,500	1,620.00	370,170,000	貸付有価証券 91,000株(91,000株)
川田テクノロジーズ	3,900	5,070.00	19,773,000	
RS Technologies	5,400	3,410.00	18,414,000	
信和	11,100	751.00	8,336,100	
東洋製罐グループホールディングス	122,500	1,264.00	154,840,000	貸付有価証券 2,300株
ホッカンホールディングス	10,600	1,706.00	18,083,600	
コロナ	10,600	1,002.00	10,621,200	
横河ブリッジホールディングス	35,800	2,208.00	79,046,400	貸付有価証券 100株
駒井ハルテック	3,600	1,476.00	5,313,600	
高田機工	1,800	2,360.00	4,248,000	
三和ホールディングス	181,300	975.00	176,767,500	貸付有価証券 300株
文化シャッター	56,700	750.00	42,525,000	
三協立山	24,800	1,020.00	25,296,000	
アルインコ	14,000	967.00	13,538,000	
東洋シャッター	4,600	717.00	3,298,200	
LIXILグループ	283,700	1,630.00	462,431,000	貸付有価証券 27,800株(1,400株)
日本フィルコン	14,700	537.00	7,893,900	
ノーリツ	39,900	1,302.00	51,949,800	
長府製作所	19,500	2,248.00	43,836,000	
リンナイ	37,400	9,020.00	337,348,000	
ダイニチ工業	10,400	651.00	6,770,400	
日東精工	26,600	471.00	12,528,600	貸付有価証券 200株
三洋工業	2,500	1,926.00	4,815,000	
岡部	39,000	837.00	32,643,000	貸付有価証券 18,500株



ジーテクト	23,900	1,049.00	25,071,100	
東プレ	35,900	1,347.00	48,357,300	
高周波熱錬	37,000	551.00	20,387,000	貸付有価証券 16,700株
東京製鋼	13,700	589.00	8,069,300	
サンコール	14,400	437.00	6,292,800	
モリテック スチール	15,000	330.00	4,950,000	
パイオラックス	28,400	1,616.00	45,894,400	
エイチワン	18,900	573.00	10,829,700	
日本発條	206,300	717.00	147,917,100	貸付有価証券 200株
中央発條	2,300	2,779.00	6,391,700	
アドバネクス	2,800	1,307.00	3,659,600	
立川ブラインド工業	8,500	1,248.00	10,608,000	貸付有価証券 3,900株
三益半導体工業	15,000	2,222.00	33,330,000	
日本ドライケミカル	4,800	1,725.00	8,280,000	貸付有価証券 100株
日本製鋼所	58,300	1,601.00	93,338,300	貸付有価証券 300株
三浦工業	83,200	4,465.00	371,488,000	貸付有価証券 1,600株
タクマ	65,100	1,496.00	97,389,600	貸付有価証券 600株
ツガミ	39,800	920.00	36,616,000	貸付有価証券 100株
オークマ	22,400	4,775.00	106,960,000	貸付有価証券 100株（100株）
芝浦機械	21,700	2,362.00	51,255,400	
アマダ	238,500	916.00	218,466,000	
アイダエンジニアリング	50,300	749.00	37,674,700	
滝澤鉄工所	6,000	1,005.00	6,030,000	
F U J I	82,700	1,873.00	154,897,100	貸付有価証券 14,700株（14,600株）
牧野フライス製作所	22,500	3,430.00	77,175,000	
オーエスジー	88,900	1,640.00	145,796,000	貸付有価証券 200株
ダイジェット工業	2,200	1,254.00	2,758,800	
旭ダイヤモンド工業	50,400	504.00	25,401,600	

DMG森精機	121,600	1,335.00	162,336,000	貸付有価証券 1,100株
ソディック	45,200	819.00	37,018,800	貸付有価証券 1,400株
ディスコ	26,000	25,300.00	657,800,000	貸付有価証券 100株
日東工器	10,500	1,854.00	19,467,000	
日進工具	7,500	2,687.00	20,152,500	
パンチ工業	17,400	423.00	7,360,200	
富士ダイス	8,500	647.00	5,499,500	
豊和工業	10,600	851.00	9,020,600	貸付有価証券 4,100株(700株)
OKK	7,900	440.00	3,476,000	
東洋機械金属	13,700	420.00	5,754,000	
津田駒工業	3,700	904.00	3,344,800	貸付有価証券 200株
エンシュウ	4,600	947.00	4,356,200	
島精機製作所	30,300	1,565.00	47,419,500	貸付有価証券 200株
オプトラン	21,400	2,615.00	55,961,000	
NCホールディングス	5,800	540.00	3,132,000	
イワキポンプ	12,200	987.00	12,041,400	
フリーー	18,800	1,040.00	19,552,000	
ヤマシンフィルタ	41,800	1,059.00	44,266,200	
日阪製作所	23,700	739.00	17,514,300	
やまびこ	37,300	914.00	34,092,200	
平田機工	9,100	5,670.00	51,597,000	貸付有価証券 300株
ペガサスミシン製造	19,500	337.00	6,571,500	貸付有価証券 200株
マルマエ	7,100	1,011.00	7,178,100	
タツモ	9,000	1,697.00	15,273,000	
ナプテスコ	113,300	3,345.00	378,988,500	
三井海洋開発	20,400	1,553.00	31,681,200	貸付有価証券 100株
レオン自動機	18,900	1,291.00	24,399,900	
S M C	61,000	55,630.00	3,393,430,000	貸付有価証券 100株
ホソカワミクロン	6,800	5,750.00	39,100,000	

ユニオンツール	7,200	2,683.00	19,317,600	貸付有価証券 900株
オイレス工業	24,800	1,420.00	35,216,000	
日精エー・エス・ビー機 械	5,600	3,315.00	18,564,000	
サトーホールディングス	27,400	2,400.00	65,760,000	
技研製作所	16,900	4,900.00	82,810,000	
日本エアテック	6,900	1,087.00	7,500,300	貸付有価証券 3,200株（2,100株）
カワタ	5,700	726.00	4,138,200	
日精樹脂工業	16,100	813.00	13,089,300	
オカダアイヨン	6,100	953.00	5,813,300	貸付有価証券 200株
ワイエイシイホールディ ングス	8,200	562.00	4,608,400	貸付有価証券 300株（300株）
小松製作所	880,600	2,202.00	1,939,081,200	貸付有価証券 33,200株
住友重機械工業	111,300	2,442.00	271,794,600	
日立建機	77,900	2,908.00	226,533,200	貸付有価証券 700株
日工	26,600	632.00	16,811,200	
巴工業	8,300	1,935.00	16,060,500	
井関農機	19,400	1,167.00	22,639,800	
TOWA	19,600	1,180.00	23,128,000	
丸山製作所	3,900	1,200.00	4,680,000	
北川鉄工所	8,700	1,632.00	14,198,400	
ローツェ	8,500	5,460.00	46,410,000	
タカキタ	6,800	584.00	3,971,200	
クボタ	1,031,500	1,598.50	1,648,852,750	貸付有価証券 401,100株
荏原実業	4,900	2,868.00	14,053,200	
三菱化工機	6,700	1,737.00	11,637,900	貸付有価証券 100株
月島機械	35,800	1,204.00	43,103,200	
帝国電機製作所	16,000	1,251.00	20,016,000	
東京機械製作所	7,900	282.00	2,227,800	
新東工業	46,100	798.00	36,787,800	
澁谷工業	17,000	2,917.00	49,589,000	
アイチ コーポレーショ	33,600	756.00	25,401,600	

ン				
小森コーポレーション	49,300	750.00	36,975,000	貸付有価証券 100株
鶴見製作所	14,900	1,847.00	27,520,300	
住友精密工業	2,900	2,274.00	6,594,600	
日本ギア工業	7,800	287.00	2,238,600	
酒井重工業	3,600	2,222.00	7,999,200	
荏原製作所	80,500	2,535.00	204,067,500	貸付有価証券 900株
石井鐵工所	2,500	2,419.00	6,047,500	
西島製作所	19,600	807.00	15,817,200	
北越工業	20,000	1,102.00	22,040,000	
ダイキン工業	247,700	16,625.00	4,118,012,500	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	8,400	2,105.00	17,682,000	
栗田工業	105,200	2,989.00	314,442,800	貸付有価証券 500株
椿本チエイン	27,700	2,710.00	75,067,000	貸付有価証券 500株
大同工業	9,200	691.00	6,357,200	
木村化工機	16,200	448.00	7,257,600	
アネスト岩田	30,200	853.00	25,760,600	
ダイフク	99,400	9,060.00	900,564,000	貸付有価証券 5,700株
サムコ	4,900	2,053.00	10,059,700	貸付有価証券 800株（800株）
加藤製作所	10,600	1,190.00	12,614,000	
油研工業	3,300	1,488.00	4,910,400	
タダノ	93,800	904.00	84,795,200	貸付有価証券 2,900株
フジテック	70,700	1,840.00	130,088,000	貸付有価証券 11,500株（11,500株）
C K D	53,300	1,887.00	100,577,100	貸付有価証券 300株
キトー	14,700	1,303.00	19,154,100	
平和	54,200	1,825.00	98,915,000	貸付有価証券 100株
理想科学工業	17,200	1,399.00	24,062,800	
SANKYO	43,300	2,718.00	117,689,400	

				貸付有価証券 1,400株
日本金銭機械	21,500	616.00	13,244,000	
マースグループホールディングス	12,300	1,606.00	19,753,800	
フクシマガリレイ	12,000	3,585.00	43,020,000	
オーイズミ	8,100	404.00	3,272,400	
ダイコク電機	8,900	1,290.00	11,481,000	
竹内製作所	32,500	1,784.00	57,980,000	
アマノ	50,900	2,336.00	118,902,400	貸付有価証券 400株
J U K I	27,000	608.00	16,416,000	
サンデンホールディングス	25,400	374.00	9,499,600	貸付有価証券 10,100株
蛇の目ミシン工業	17,700	467.00	8,265,900	
マックス	29,700	1,583.00	47,015,100	
グローリー	49,900	2,506.00	125,049,400	
新晃工業	18,100	1,434.00	25,955,400	
大和冷機工業	28,100	975.00	27,397,500	
セガサミーホールディングス	192,800	1,294.00	249,483,200	貸付有価証券 1,900株
日本ピストンリング	7,100	1,229.00	8,725,900	
リケン	9,000	2,818.00	25,362,000	
T P R	26,100	1,350.00	35,235,000	
ツバキ・ナカシマ	39,700	910.00	36,127,000	
ホシザキ	56,800	9,280.00	527,104,000	貸付有価証券 10,900株
大豊工業	15,800	567.00	8,958,600	
日本精工	366,000	814.00	297,924,000	貸付有価証券 2,300株
N T N	450,000	227.00	102,150,000	貸付有価証券 31,200株
ジェイテクト	186,500	846.00	157,779,000	貸付有価証券 2,900株
不二越	18,100	3,370.00	60,997,000	
日本トムソン	57,700	356.00	20,541,200	
T H K	113,100	2,749.00	310,911,900	貸付有価証券 100株
ユーシン精機	15,100	719.00	10,856,900	

前澤給装工業	7,100	1,995.00	14,164,500	
イーグル工業	24,000	736.00	17,664,000	
前澤工業	12,900	357.00	4,605,300	
日本ピラー工業	19,700	1,391.00	27,402,700	
キッツ	78,800	713.00	56,184,400	貸付有価証券 100株
マキタ	253,500	3,900.00	988,650,000	貸付有価証券 2,200株
日立造船	154,100	396.00	61,023,600	貸付有価証券 100株
三菱重工業	325,800	2,660.50	866,790,900	貸付有価証券 26,500株
I H I	140,100	1,602.00	224,440,200	
スター精密	29,900	1,248.00	37,315,200	
日清紡ホールディングス	129,600	813.00	105,364,800	貸付有価証券 100株
イビデン	119,000	2,993.00	356,167,000	貸付有価証券 3,100株
コニカミノルタ	424,800	397.00	168,645,600	貸付有価証券 3,800株
ブラザー工業	237,400	1,994.00	473,375,600	貸付有価証券 1,400株
ミネベアミツミ	360,900	1,990.00	718,191,000	貸付有価証券 2,400株
日立製作所	934,200	3,460.00	3,232,332,000	貸付有価証券 3,600株
三菱電機	1,944,200	1,394.50	2,711,186,900	貸付有価証券 21,500株
富士電機	117,200	2,812.00	329,566,400	貸付有価証券 300株
東洋電機製造	7,100	1,215.00	8,626,500	
安川電機	209,300	3,710.00	776,503,000	貸付有価証券 8,900株
シンフォニアテクノロジー	25,200	1,061.00	26,737,200	
明電舎	35,700	1,751.00	62,510,700	
オリジン	5,300	1,508.00	7,992,400	
山洋電気	9,400	4,805.00	45,167,000	
デンヨー	16,600	1,895.00	31,457,000	
東芝テック	24,400	4,260.00	103,944,000	貸付有価証券

				2,100株
芝浦メカトロニクス	3,400	2,820.00	9,588,000	
マブチモーター	53,800	3,485.00	187,493,000	
日本電産	467,900	6,797.00	3,180,316,300	貸付有価証券 8,700株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	11,600	379.00	4,396,400	貸付有価証券 800株
トレックス・セミコンダ クター	11,200	1,338.00	14,985,600	
東光高岳	10,800	1,021.00	11,026,800	
ダブル・スコープ	30,700	770.00	23,639,000	貸付有価証券 14,500株(8,800株)
ダイヘン	21,300	3,735.00	79,555,500	
ヤーマン	31,700	1,009.00	31,985,300	貸付有価証券 11,000株(400株)
JVCケンウッド	158,400	173.00	27,403,200	貸付有価証券 800株
ミマキエンジニアリング	17,400	385.00	6,699,000	
第一精工	7,900	2,195.00	17,340,500	貸付有価証券 3,200株
日新電機	45,600	1,049.00	47,834,400	
大崎電気工業	38,700	502.00	19,427,400	
オムロン	174,300	7,090.00	1,235,787,000	貸付有価証券 1,300株
日東工業	28,600	1,871.00	53,510,600	
I D E C	28,100	1,710.00	48,051,000	
正興電機製作所	4,600	1,068.00	4,912,800	
不二電機工業	3,200	1,329.00	4,252,800	貸付有価証券 1,500株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	64,900	1,843.00	119,610,700	貸付有価証券 1,500株
サクサホールディングス	4,500	1,813.00	8,158,500	
メルコホールディングス	6,700	2,845.00	19,061,500	
テクノメディカ	4,400	1,821.00	8,012,400	
ダイヤモンドエレクト リックホールディング	4,200	582.00	2,444,400	
日本電気	235,800	5,050.00	1,190,790,000	貸付有価証券 100株
富士通	187,400	12,110.00	2,269,414,000	貸付有価証券 1,900株

沖電気工業	79,000	1,058.00	83,582,000	貸付有価証券 14,100株
岩崎通信機	8,500	851.00	7,233,500	
電気興業	9,400	2,651.00	24,919,400	
サンケン電気	21,200	2,197.00	46,576,400	貸付有価証券 100株
ナカヨ	3,800	1,506.00	5,722,800	
アイホン	11,000	1,562.00	17,182,000	
ルネサスエレクトロニクス	930,100	624.00	580,382,400	貸付有価証券 2,300株
セイコーエプソン	241,200	1,299.00	313,318,800	貸付有価証券 6,300株
ワコム	130,700	558.00	72,930,600	貸付有価証券 100株
アルバック	35,800	3,305.00	118,319,000	貸付有価証券 200株
アクセル	8,100	726.00	5,880,600	
E I Z O	15,100	4,105.00	61,985,500	
日本信号	49,500	1,154.00	57,123,000	
京三製作所	45,500	531.00	24,160,500	貸付有価証券 20,700株
能美防災	25,700	2,054.00	52,787,800	
ホーチキ	14,100	1,291.00	18,203,100	
星和電機	9,600	620.00	5,952,000	
エレコム	21,500	5,240.00	112,660,000	貸付有価証券 300株
パナソニック	2,221,400	958.00	2,128,101,200	
シャープ	225,000	1,178.00	265,050,000	貸付有価証券 84,700株
アンリツ	125,200	2,506.00	313,751,200	貸付有価証券 57,800株
富士通ゼネラル	52,800	2,154.00	113,731,200	貸付有価証券 1,300株
ソニー	1,218,000	7,607.00	9,265,326,000	貸付有価証券 3,700株
T D K	93,900	10,700.00	1,004,730,000	貸付有価証券 100株
帝国通信工業	8,600	1,220.00	10,492,000	
タムラ製作所	65,000	447.00	29,055,000	
アルプスアルパイン	172,100	1,417.00	243,865,700	貸付有価証券



				1,600株
池上通信機	6,200	881.00	5,462,200	
日本電波工業	17,500	380.00	6,650,000	貸付有価証券 3,300株(100株)
鈴木	9,600	767.00	7,363,200	
日本トリム	2,600	3,070.00	7,982,000	
ローランド ディー・ ジー	10,700	1,257.00	13,449,900	
フォスター電機	20,400	1,126.00	22,970,400	貸付有価証券 100株
S M K	5,000	2,552.00	12,760,000	
ヨコオ	12,600	2,585.00	32,571,000	
ティアック	14,000	142.00	1,988,000	貸付有価証券 6,600株
ホシデン	53,100	978.00	51,931,800	貸付有価証券 400株
ヒロセ電機	30,100	11,890.00	357,889,000	
日本航空電子工業	44,600	1,480.00	66,008,000	
T O A	20,800	741.00	15,412,800	
マクセルホールディング ス	41,900	1,032.00	43,240,800	貸付有価証券 700株
古野電気	25,000	987.00	24,675,000	
ユニデンホールディング ス	5,300	1,848.00	9,794,400	貸付有価証券 400株
スミダコーポレーション	14,900	767.00	11,428,300	
アイコム	10,800	3,080.00	33,264,000	
リオン	8,200	2,298.00	18,843,600	
本多通信工業	16,600	467.00	7,752,200	
船井電機	19,600	512.00	10,035,200	貸付有価証券 5,100株
横河電機	178,400	1,670.00	297,928,000	貸付有価証券 1,300株
新電元工業	6,900	2,232.00	15,400,800	
アズビル	122,700	3,230.00	396,321,000	
東亜ディーケーケー	9,600	868.00	8,332,800	
日本光電工業	80,300	3,555.00	285,466,500	貸付有価証券 100株
チノー	6,700	1,313.00	8,797,100	貸付有価証券 2,100株
共和電業	20,300	438.00	8,891,400	

日本電子材料	7,700	969.00	7,461,300	
堀場製作所	38,500	5,530.00	212,905,000	
アドバンテスト	144,600	5,990.00	866,154,000	貸付有価証券 2,200株
小野測器	8,100	536.00	4,341,600	
エスベック	17,200	1,751.00	30,117,200	貸付有価証券 100株
キーエンス	176,200	44,570.00	7,853,234,000	貸付有価証券 1,900株
日置電機	10,200	2,991.00	30,508,200	
シスメックス	139,000	7,975.00	1,108,525,000	貸付有価証券 100株
日本マイクロニクス	33,800	1,080.00	36,504,000	
メガチップス	18,100	2,311.00	41,829,100	貸付有価証券 1,000株
O B A R A G R O U P	11,300	3,250.00	36,725,000	貸付有価証券 5,400株(3,800株)
澤藤電機	2,300	1,766.00	4,061,800	
原田工業	9,200	836.00	7,691,200	
コーセル	25,900	924.00	23,931,600	
イリソ電子工業	16,300	3,480.00	56,724,000	
オブテックスグループ	31,900	1,258.00	40,130,200	
千代田インテグレ	9,000	1,748.00	15,732,000	
アイ・オー・データ機器	6,300	988.00	6,224,400	
レーザーテック	85,400	10,450.00	892,430,000	
スタンレー電気	136,700	2,590.00	354,053,000	貸付有価証券 600株
岩崎電気	7,600	1,988.00	15,108,800	貸付有価証券 100株
ウシオ電機	107,300	1,348.00	144,640,400	貸付有価証券 4,700株
岡谷電機産業	15,200	338.00	5,137,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	17,900	344.00	6,157,600	貸付有価証券 200株
エノモト	5,800	1,059.00	6,142,200	
日本セラミック	19,700	2,313.00	45,566,100	
遠藤照明	9,800	619.00	6,066,200	
古河電池	13,900	1,537.00	21,364,300	貸付有価証券 5,600株(1,400株)

双信電機	9,400	411.00	3,863,400	
山一電機	14,100	1,482.00	20,896,200	
図研	12,600	2,750.00	34,650,000	
日本電子	38,300	3,030.00	116,049,000	貸付有価証券 2,900株
カシオ計算機	172,000	1,903.00	327,316,000	貸付有価証券 1,700株
ファナック	184,700	19,380.00	3,579,486,000	貸付有価証券 200株
日本シイエムケイ	45,700	420.00	19,194,000	貸付有価証券 100株
エンプラス	9,900	2,465.00	24,403,500	
大真空	7,100	1,998.00	14,185,800	貸付有価証券 900株
ローム	86,300	7,340.00	633,442,000	
浜松ホトニクス	139,500	4,795.00	668,902,500	貸付有価証券 1,800株
三井ハイテック	21,400	1,569.00	33,576,600	貸付有価証券 3,300株
新光電気工業	65,300	1,500.00	97,950,000	貸付有価証券 2,100株
京セラ	273,500	6,073.00	1,660,965,500	貸付有価証券 1,900株
太陽誘電	86,500	3,275.00	283,287,500	貸付有価証券 12,000株
村田製作所	571,100	6,396.00	3,652,755,600	貸付有価証券 4,000株
双葉電子工業	30,700	994.00	30,515,800	
北陸電気工業	7,800	954.00	7,441,200	
ニチコン	65,900	758.00	49,952,200	貸付有価証券 2,400株
日本ケミコン	14,800	1,731.00	25,618,800	
K O A	29,300	1,023.00	29,973,900	
市光工業	29,100	501.00	14,579,100	
小糸製作所	116,500	4,325.00	503,862,500	貸付有価証券 1,500株
ミツバ	35,800	475.00	17,005,000	
S C R E E Nホールディ ングス	33,700	5,200.00	175,240,000	貸付有価証券 2,800株
キャノン電子	20,400	1,652.00	33,700,800	

キヤノン	1,046,600	2,242.50	2,347,000,500	貸付有価証券 165,500株
リコー	494,600	839.00	414,969,400	貸付有価証券 2,700株
象印マホービン	57,000	1,576.00	89,832,000	貸付有価証券 8,600株
MUTOHホールディングス	2,400	1,534.00	3,681,600	
東京エレクトロン	123,400	25,085.00	3,095,489,000	貸付有価証券 400株
トヨタ紡織	56,600	1,389.00	78,617,400	
芦森工業	4,000	1,037.00	4,148,000	
ユニプレス	37,700	975.00	36,757,500	貸付有価証券 100株
豊田自動織機	157,400	5,740.00	903,476,000	貸付有価証券 500株
モリタホールディングス	34,000	1,868.00	63,512,000	
三櫻工業	24,600	733.00	18,031,800	貸付有価証券 400株
デンソー	428,100	4,010.00	1,716,681,000	貸付有価証券 2,300株
東海理化電機製作所	51,200	1,581.00	80,947,200	貸付有価証券 2,000株
三井E&Sホールディングス	70,200	471.00	33,064,200	貸付有価証券 1,200株
川崎重工業	151,300	1,700.00	257,210,000	貸付有価証券 13,000株
名村造船所	62,600	166.00	10,391,600	貸付有価証券 5,900株
サノヤスホールディングス	23,600	163.00	3,846,800	貸付有価証券 1,000株
日本車輛製造	7,100	2,685.00	19,063,500	貸付有価証券 400株
三菱ロジスネクスト	25,700	974.00	25,031,800	
近畿車輛	2,900	1,229.00	3,564,100	
日産自動車	2,293,000	415.90	953,658,700	貸付有価証券 379,600株
いすゞ自動車	563,400	974.40	548,976,960	貸付有価証券 12,300株
トヨタ自動車	2,169,400	6,818.00	14,790,969,200	貸付有価証券 29,100株

日野自動車	242,800	717.00	174,087,600	貸付有価証券 200株
三菱自動車工業	719,700	300.00	215,910,000	貸付有価証券 140,400株
エフテック	13,600	517.00	7,031,200	貸付有価証券 2,600株
レシップホールディングス	7,600	579.00	4,400,400	
GMB	3,500	701.00	2,453,500	
ファルテック	3,400	671.00	2,281,400	
武蔵精密工業	43,300	959.00	41,524,700	貸付有価証券 700株
日産車体	38,000	914.00	34,732,000	
新明和工業	52,400	1,015.00	53,186,000	貸付有価証券 1,400株
極東開発工業	36,100	1,320.00	47,652,000	
日信工業	39,500	2,186.00	86,347,000	
トピー工業	16,000	1,294.00	20,704,000	
ティラド	7,100	1,410.00	10,011,000	
タチエス	31,900	888.00	28,327,200	貸付有価証券 14,300株
NOK	104,500	1,356.00	141,702,000	貸付有価証券 100株
フタバ産業	54,100	446.00	24,128,600	
KYB	21,800	2,111.00	46,019,800	
大同メタル工業	37,300	550.00	20,515,000	
プレス工業	96,300	273.00	26,289,900	貸付有価証券 100株
ミクニ	24,700	288.00	7,113,600	
太平洋工業	40,700	928.00	37,769,600	
ケーヒン	44,700	2,522.00	112,733,400	
河西工業	26,200	458.00	11,999,600	
アイシン精機	160,100	3,225.00	516,322,500	貸付有価証券 100株
マツダ	572,100	700.00	400,470,000	貸付有価証券 6,800株
今仙電機製作所	18,000	756.00	13,608,000	
本田技研工業	1,530,800	2,850.50	4,363,545,400	
スズキ	385,400	3,617.00	1,393,991,800	貸付有価証券

				33,200株
S U B A R U	603,600	2,347.50	1,416,951,000	
安永	9,400	1,008.00	9,475,200	貸付有価証券 600株(500株)
ヤマハ発動機	253,500	1,653.00	419,035,500	
ショーワ	45,900	2,223.00	102,035,700	
T B K	23,100	453.00	10,464,300	
エクセディ	26,400	1,629.00	43,005,600	貸付有価証券 400株
豊田合成	62,800	2,245.00	140,986,000	
愛三工業	30,400	544.00	16,537,600	貸付有価証券 800株
盟和産業	3,000	969.00	2,907,000	
日本プラスト	15,200	458.00	6,961,600	
ヨロズ	18,100	1,082.00	19,584,200	
エフ・シー・シー	31,800	1,835.00	58,353,000	
シマノ	72,800	20,690.00	1,506,232,000	貸付有価証券 100株
テイ・エス テック	45,200	2,992.00	135,238,400	貸付有価証券 300株
ジャムコ	9,700	802.00	7,779,400	貸付有価証券 600株
テルモ	550,200	4,094.00	2,252,518,800	貸付有価証券 4,300株
クリエートメディック	6,400	963.00	6,163,200	
日機装	58,300	1,053.00	61,389,900	貸付有価証券 200株
日本エム・ディ・エム	11,200	1,668.00	18,681,600	
島津製作所	232,300	2,847.00	661,358,100	貸付有価証券 7,600株
J M S	16,400	847.00	13,890,800	
クボテック	5,000	348.00	1,740,000	貸付有価証券 2,300株
長野計器	14,100	1,023.00	14,424,300	
ブイ・テクノロジー	9,100	3,815.00	34,716,500	貸付有価証券 4,100株
東京計器	12,400	997.00	12,362,800	
愛知時計電機	2,600	4,340.00	11,284,000	
インターアクション	10,400	2,138.00	22,235,200	
オーバル	17,400	234.00	4,071,600	

東京精密	35,200	3,425.00	120,560,000	
マニー	77,400	2,859.00	221,286,600	貸付有価証券 6,300株
ニコン	296,900	952.00	282,648,800	貸付有価証券 2,600株
トプコン	97,900	871.00	85,270,900	貸付有価証券 1,800株
オリンパス	1,075,800	1,895.50	2,039,178,900	貸付有価証券 29,800株
理研計器	17,100	2,462.00	42,100,200	
タムロン	15,700	1,854.00	29,107,800	
H O Y A	388,300	10,375.00	4,028,612,500	
シード	8,300	736.00	6,108,800	
ノーリツ鋼機	13,100	1,569.00	20,553,900	
エー・アンド・デイ	17,700	731.00	12,938,700	
朝日インテック	220,200	3,100.00	682,620,000	貸付有価証券 100株
シチズン時計	227,700	369.00	84,021,300	貸付有価証券 400株
リズム時計工業	6,100	618.00	3,769,800	
大研医器	13,500	596.00	8,046,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
メニコン	27,500	5,390.00	148,225,000	貸付有価証券 400株
シンシア	2,100	439.00	921,900	貸付有価証券 900株
松風	8,800	1,537.00	13,525,600	
セイコーホールディングス	27,500	1,788.00	49,170,000	
ニプロ	134,600	1,204.00	162,058,400	貸付有価証券 800株
中本パックス	4,900	1,521.00	7,452,900	
スノーピーク	10,400	1,058.00	11,003,200	貸付有価証券 700株
パラマウントベッドホールディングス	20,500	4,355.00	89,277,500	
トランザクション	10,600	1,057.00	11,204,200	
粧美堂	5,700	347.00	1,977,900	
ニホンフラッシュ	18,200	1,389.00	25,279,800	貸付有価証券 1,300株

前田工織	21,400	2,461.00	52,665,400	貸付有価証券 700株
永大産業	25,400	314.00	7,975,600	
アートネイチャー	20,800	609.00	12,667,200	
バンダイナムコホールディングス	201,000	5,778.00	1,161,378,000	貸付有価証券 1,400株
アイフィスジャパン	4,900	714.00	3,498,600	
共立印刷	32,400	142.00	4,600,800	
SHOEI	17,000	2,485.00	42,245,000	
フランスベッドホールディングス	27,500	866.00	23,815,000	
パイロットコーポレーション	31,700	3,260.00	103,342,000	
萩原工業	10,800	1,467.00	15,843,600	
トッパン・フォームズ	41,700	1,072.00	44,702,400	
フジシールインターナショナル	43,600	2,060.00	89,816,000	貸付有価証券 100株
タカラトミー	87,200	869.00	75,776,800	貸付有価証券 8,600株
廣済堂	13,500	805.00	10,867,500	貸付有価証券 1,500株
エステールホールディングス	5,200	600.00	3,120,000	
アーク	74,200	118.00	8,755,600	
タカノ	7,600	691.00	5,251,600	
プロネクサス	16,700	1,147.00	19,154,900	
ホクシン	12,000	123.00	1,476,000	
ウッドワン	6,500	1,165.00	7,572,500	
大建工業	13,100	1,819.00	23,828,900	
凸版印刷	274,400	1,856.00	509,286,400	
大日本印刷	254,400	2,475.00	629,640,000	貸付有価証券 100株
共同印刷	6,000	2,791.00	16,746,000	
N I S S H A	39,900	1,007.00	40,179,300	貸付有価証券 2,800株（2,400株）
光村印刷	1,700	1,506.00	2,560,200	
TAKARA & COMPANY	9,400	1,846.00	17,352,400	
アシックス	160,500	1,212.00	194,526,000	貸付有価証券 76,600株



ツツミ	6,100	1,942.00	11,846,200	
小松ウオール工業	5,900	1,811.00	10,684,900	貸付有価証券 100株
ヤマハ	115,600	5,160.00	596,496,000	貸付有価証券 3,600株
河合楽器製作所	6,000	2,700.00	16,200,000	
クリナップ	18,100	533.00	9,647,300	
ビジョン	117,500	4,190.00	492,325,000	貸付有価証券 6,700株
オリバー	4,100	2,530.00	10,373,000	貸付有価証券 400株
兼松サステック	1,300	1,450.00	1,885,000	
キングジム	16,200	910.00	14,742,000	貸付有価証券 7,700株
リンテック	46,200	2,523.00	116,562,600	
イトーキ	41,300	368.00	15,198,400	
任天堂	119,200	50,150.00	5,977,880,000	貸付有価証券 400株
三菱鉛筆	32,000	1,331.00	42,592,000	
タカラスタンダード	40,200	1,513.00	60,822,600	
コクヨ	93,300	1,268.00	118,304,400	
ナカバヤシ	19,100	579.00	11,058,900	
グローブライド	8,700	2,185.00	19,009,500	
オカムラ	67,800	786.00	53,290,800	貸付有価証券 100株
美津濃	17,600	2,246.00	39,529,600	貸付有価証券 100株
東京電力ホールディングス	1,552,100	344.00	533,922,400	貸付有価証券 689,000株
中部電力	594,800	1,394.00	829,151,200	貸付有価証券 36,700株
関西電力	736,700	1,041.50	767,273,050	貸付有価証券 27,300株
中国電力	280,400	1,440.00	403,776,000	貸付有価証券 1,400株
北陸電力	177,800	676.00	120,192,800	貸付有価証券 300株
東北電力	485,700	1,020.00	495,414,000	貸付有価証券 1,200株
四国電力	175,100	791.00	138,504,100	貸付有価証券

				200株
九州電力	400,700	883.00	353,818,100	貸付有価証券 19,200株
北海道電力	181,900	417.00	75,852,300	
沖縄電力	37,830	1,791.00	67,753,530	
電源開発	154,700	2,061.00	318,836,700	貸付有価証券 4,100株
エフオン	10,400	601.00	6,250,400	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
イーレックス	27,700	1,406.00	38,946,200	貸付有価証券 100株
レノバ	32,500	1,003.00	32,597,500	貸付有価証券 800株
東京瓦斯	373,900	2,500.50	934,936,950	貸付有価証券 2,800株
大阪瓦斯	377,300	2,126.00	802,139,800	貸付有価証券 900株
東邦瓦斯	95,600	5,350.00	511,460,000	貸付有価証券 11,900株
北海道瓦斯	10,400	1,601.00	16,650,400	貸付有価証券 100株
広島ガス	40,000	357.00	14,280,000	
西部瓦斯	21,900	2,580.00	56,502,000	
静岡ガス	55,200	982.00	54,206,400	
メタウォーター	9,400	4,735.00	44,509,000	貸付有価証券 200株
SBSホールディングス	16,800	2,299.00	38,623,200	
東武鉄道	202,600	3,650.00	739,490,000	貸付有価証券 900株
相鉄ホールディングス	62,200	2,868.00	178,389,600	貸付有価証券 200株
東急	490,400	1,565.00	767,476,000	貸付有価証券 2,200株
京浜急行電鉄	249,700	1,682.00	419,995,400	貸付有価証券 10,600株
小田急電鉄	289,200	2,611.00	755,101,200	貸付有価証券 10,200株
京王電鉄	100,900	6,120.00	617,508,000	貸付有価証券 8,500株
京成電鉄	135,300	3,330.00	450,549,000	貸付有価証券 100株

富士急行	26,500	3,180.00	84,270,000	貸付有価証券 800株
新京成電鉄	5,000	2,292.00	11,460,000	
東日本旅客鉄道	342,200	7,899.00	2,703,037,800	貸付有価証券 2,000株
西日本旅客鉄道	173,200	6,200.00	1,073,840,000	貸付有価証券 14,000株
東海旅客鉄道	161,700	17,080.00	2,761,836,000	貸付有価証券 15,800株
西武ホールディングス	260,900	1,225.00	319,602,500	
鴻池運輸	30,900	1,180.00	36,462,000	
西日本鉄道	53,900	2,875.00	154,962,500	貸付有価証券 100株
ハマキョウレックス	14,900	3,160.00	47,084,000	
サカイ引越センター	10,200	5,780.00	58,956,000	
近鉄グループホールディングス	184,100	4,840.00	891,044,000	貸付有価証券 4,300株
阪急阪神ホールディングス	245,600	3,660.00	898,896,000	貸付有価証券 600株
南海電気鉄道	87,300	2,447.00	213,623,100	
京阪ホールディングス	82,000	4,830.00	396,060,000	貸付有価証券 900株
神戸電鉄	4,400	3,700.00	16,280,000	貸付有価証券 2,100株
名古屋鉄道	151,400	3,050.00	461,770,000	貸付有価証券 20,200株
山陽電気鉄道	13,100	2,217.00	29,042,700	
日本通運	63,700	5,580.00	355,446,000	貸付有価証券 600株
ヤマトホールディングス	322,800	2,386.00	770,200,800	貸付有価証券 8,200株
山九	51,200	4,090.00	209,408,000	
丸運	10,500	232.00	2,436,000	
丸全昭和運輸	14,900	3,220.00	47,978,000	
センコーグループホールディングス	101,500	803.00	81,504,500	貸付有価証券 1,500株
トナミホールディングス	4,400	5,950.00	26,180,000	
ニッコンホールディングス	65,900	2,156.00	142,080,400	
日本石油輸送	2,000	3,080.00	6,160,000	

福山通運	23,600	3,645.00	86,022,000	貸付有価証券 700株(200株)
セイノーホールディングス	137,900	1,445.00	199,265,500	貸付有価証券 600株
エスライン	5,500	1,005.00	5,527,500	
神奈川中央交通	4,600	4,200.00	19,320,000	
日立物流	33,700	2,881.00	97,089,700	
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	1,545.00	28,737,000	
九州旅客鉄道	161,400	2,895.00	467,253,000	
S Gホールディングス	193,300	3,500.00	676,550,000	貸付有価証券 2,800株
日本郵船	154,000	1,559.00	240,086,000	
商船三井	116,500	2,000.00	233,000,000	貸付有価証券 800株
川崎汽船	56,700	1,140.00	64,638,000	貸付有価証券 19,000株(5,100株)
N S ユナイテッド海運	10,100	1,537.00	15,523,700	貸付有価証券 100株
明治海運	19,600	337.00	6,605,200	
飯野海運	87,200	347.00	30,258,400	
共栄タンカー	3,200	841.00	2,691,200	
乾汽船	10,600	894.00	9,476,400	貸付有価証券 1,400株
日本航空	325,600	2,085.00	678,876,000	貸付有価証券 500株
A N Aホールディングス	336,600	2,620.00	881,892,000	貸付有価証券 161,100株(60,000株)
パスコ	3,600	1,573.00	5,662,800	
トランコム	5,100	7,000.00	35,700,000	
日新	15,900	1,684.00	26,775,600	貸付有価証券 100株
三菱倉庫	58,400	2,737.00	159,840,800	貸付有価証券 6,900株(5,400株)
三井倉庫ホールディングス	21,000	1,528.00	32,088,000	貸付有価証券 300株
住友倉庫	66,200	1,294.00	85,662,800	貸付有価証券 400株

澁澤倉庫	10,100	2,086.00	21,068,600	
東陽倉庫	33,200	330.00	10,956,000	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	40,500	515.00	20,857,500	貸付有価証券 100株
ケイヒン	3,600	1,297.00	4,669,200	
中央倉庫	11,200	962.00	10,774,400	
川西倉庫	3,400	1,023.00	3,478,200	
安田倉庫	15,100	885.00	13,363,500	
ファイズホールディングス	3,900	1,163.00	4,535,700	貸付有価証券 100株
東洋埠頭	5,600	1,374.00	7,694,400	
宇徳	15,700	524.00	8,226,800	
上組	102,800	2,074.00	213,207,200	貸付有価証券 900株
サンリツ	4,400	596.00	2,622,400	
キムラユニティー	4,900	1,026.00	5,027,400	
キューソー流通システム	4,600	1,630.00	7,498,000	
近鉄エクスプレス	39,100	1,823.00	71,279,300	貸付有価証券 1,500株
東海運	10,500	275.00	2,887,500	
エーアイティー	13,000	791.00	10,283,000	
内外トランスライン	6,500	987.00	6,415,500	
日本コンセプト	5,900	1,275.00	7,522,500	
NEC ネットエスアイ	54,100	2,057.00	111,283,700	貸付有価証券 3,300株
クロスキャット	5,000	1,139.00	5,695,000	
システナ	68,000	1,515.00	103,020,000	貸付有価証券 2,300株
デジタルアーツ	9,400	8,720.00	81,968,000	貸付有価証券 3,800株
日鉄ソリューションズ	28,600	2,945.00	84,227,000	
キューブシステム	10,100	876.00	8,847,600	
エイジア	3,500	1,348.00	4,718,000	
コア	8,100	1,204.00	9,752,400	
ラクーンホールディングス	8,500	948.00	8,058,000	
ソリトンシステムズ	8,300	1,564.00	12,981,200	貸付有価証券 3,900株（700株）

ソフトクリエイティブホールディングス	8,300	2,242.00	18,608,600	
T I S	190,800	2,217.00	423,003,600	貸付有価証券 1,400株
ネオス	7,600	739.00	5,616,400	貸付有価証券 1,400株
電算システム	7,300	3,830.00	27,959,000	
グリー	117,000	455.00	53,235,000	貸付有価証券 15,100株
コーエーテクモホールディングス	39,000	3,430.00	133,770,000	貸付有価証券 100株
三菱総合研究所	8,200	4,265.00	34,973,000	
ボルテージ	4,400	483.00	2,125,200	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
電算	2,100	2,181.00	4,580,100	
A G S	10,800	825.00	8,910,000	
ファインデックス	16,100	1,086.00	17,484,600	貸付有価証券 2,100株(1,300株)
ブレインパッド	4,900	4,810.00	23,569,000	貸付有価証券 1,200株
K L a b	37,000	760.00	28,120,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	23,000	946.00	21,758,000	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	3,415.00	9,562,000	
ネクソン	532,200	2,433.00	1,294,842,600	貸付有価証券 5,300株
アイスタイル	53,400	299.00	15,966,600	貸付有価証券 16,800株(11,400株)
エムアップホールディングス	5,500	2,443.00	13,436,500	貸付有価証券 2,300株(1,600株)
エイチーム	13,100	860.00	11,266,000	
エニグモ	18,000	1,166.00	20,988,000	貸付有価証券 6,200株(5,800株)
テクノスジャパン	14,800	731.00	10,818,800	
e n i s h	9,100	607.00	5,523,700	貸付有価証券 4,000株(2,200株)
コロプラ	62,600	1,016.00	63,601,600	貸付有価証券 22,400株
オルトプラス	11,600	469.00	5,440,400	貸付有価証券

				5,400株(1,500株)
ブロードリーフ	94,600	534.00	50,516,400	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	387.00	3,250,800	
デジタルハーツホール ディングス	10,100	876.00	8,847,600	貸付有価証券 100株
システム情報	14,300	1,434.00	20,506,200	貸付有価証券 100株
メディアドゥ	6,000	4,735.00	28,410,000	貸付有価証券 1,700株
じげん	47,200	373.00	17,605,600	貸付有価証券 2,300株
ブイキューブ	11,800	1,315.00	15,517,000	貸付有価証券 5,600株(1,700株)
エンカレッジ・テクノロ ジ	4,200	846.00	3,553,200	
サイバーリンクス	2,900	2,007.00	5,820,300	
ディー・エル・イー	15,300	840.00	12,852,000	貸付有価証券 7,200株(4,900株)
フィックスターズ	20,300	1,368.00	27,770,400	
CARTAHOLDI NGS	9,200	1,322.00	12,162,400	貸付有価証券 4,300株(3,700株)
オプティム	10,000	3,425.00	34,250,000	貸付有価証券 3,300株(3,300株)
セレス	6,200	1,185.00	7,347,000	貸付有価証券 500株
SHIFT	7,700	11,340.00	87,318,000	
ティーガイア	16,900	2,106.00	35,591,400	
セック	2,800	3,235.00	9,058,000	
日本アジアグループ	20,100	303.00	6,090,300	
テクマトリックス	13,400	3,890.00	52,126,000	貸付有価証券 500株(500株)
プロシップ	5,500	1,338.00	7,359,000	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	46,000	1,935.00	89,010,000	貸付有価証券 8,300株
GMOペイメントゲート ウェイ	40,400	11,390.00	460,156,000	
ザッパラス	8,200	399.00	3,271,800	
システムリサーチ	5,000	2,169.00	10,845,000	
インターネットイニシア	28,200	3,780.00	106,596,000	

タイプ				
さくらインターネット	20,400	644.00	13,137,600	貸付有価証券 300株
ヴィンクス	5,300	1,344.00	7,123,200	
GMOクラウド	3,500	9,320.00	32,620,000	貸付有価証券 1,600株(1,100株)
SRAホールディングス	10,100	2,406.00	24,300,600	
システムインテグレータ	6,000	953.00	5,718,000	
朝日ネット	13,500	1,367.00	18,454,500	貸付有価証券 300株
eBASE	22,800	1,250.00	28,500,000	
アバント	18,200	1,079.00	19,637,800	
アドソル日進	6,700	2,531.00	16,957,700	
フリービット	9,900	777.00	7,692,300	貸付有価証券 400株(400株)
コムチュア	21,400	2,798.00	59,877,200	
サイバーコム	3,400	1,907.00	6,483,800	
アステリア	11,600	542.00	6,287,200	貸付有価証券 3,900株(3,300株)
アイル	10,600	1,706.00	18,083,600	貸付有価証券 4,700株(2,200株)
マークライنز	9,600	2,280.00	21,888,000	
メディカル・データ・ピ ジョン	14,500	1,225.00	17,762,500	貸付有価証券 600株
gumi	24,500	984.00	24,108,000	貸付有価証券 200株
ショーケース	4,500	780.00	3,510,000	
モバイルファクトリー	4,300	1,160.00	4,988,000	貸付有価証券 1,100株
テラスカイ	6,900	3,025.00	20,872,500	貸付有価証券 400株
デジタル・インフォメー ション・テクノロジー	7,500	1,504.00	11,280,000	
PCIホールディングス	7,200	1,209.00	8,704,800	
パイプドHD	2,500	1,769.00	4,422,500	貸付有価証券 1,100株(700株)
アイビーシー	3,100	1,052.00	3,261,200	
ネオジャパン	3,600	2,280.00	8,208,000	貸付有価証券 1,600株
PR TIMES	1,600	2,901.00	4,641,600	



ランドコンピュータ	2,900	1,115.00	3,233,500	
ダブルスタンダード	2,500	4,985.00	12,462,500	貸付有価証券 100株
オープンドア	9,400	1,459.00	13,714,600	貸付有価証券 3,800株(500株)
マイネット	6,100	1,147.00	6,996,700	貸付有価証券 400株(400株)
アカツキ	6,700	3,985.00	26,699,500	貸付有価証券 1,300株
ベネフィットジャパン	1,400	1,574.00	2,203,600	
Ubicomホールディングス	4,200	2,234.00	9,382,800	
LINE	43,700	5,370.00	234,669,000	貸付有価証券 200株
カナミックネットワーク	17,400	918.00	15,973,200	貸付有価証券 100株
ノムラシステムコーポレーション	4,200	756.00	3,175,200	貸付有価証券 1,100株(900株)
チェンジ	6,700	7,190.00	48,173,000	
シンクロ・フード	8,100	355.00	2,875,500	貸付有価証券 1,000株
オークネット	11,700	1,088.00	12,729,600	貸付有価証券 100株
セグエグループ	4,200	900.00	3,780,000	貸付有価証券 900株(700株)
エイトレッド	3,200	2,278.00	7,289,600	
AOI TYO Holdings	19,300	479.00	9,244,700	貸付有価証券 9,000株(6,700株)
マクロミル	38,900	768.00	29,875,200	
ビーグリー	3,700	1,965.00	7,270,500	
オロ	5,000	2,827.00	14,135,000	貸付有価証券 400株
ユーザーローカル	1,900	3,500.00	6,650,000	
テモナ	4,100	1,012.00	4,149,200	
ニーズウェル	3,600	777.00	2,797,200	
サインポスト	4,000	1,890.00	7,560,000	貸付有価証券 800株(400株)
ソルクシーズ	8,100	731.00	5,921,100	
フェイス	6,700	700.00	4,690,000	
プロトコーポレーション	17,100	1,085.00	18,553,500	

ハイマックス	2,200	1,960.00	4,312,000	貸付有価証券 1,000株
野村総合研究所	270,400	2,916.00	788,486,400	貸付有価証券 1,700株
サイバネットシステム	13,600	699.00	9,506,400	貸付有価証券 500株
C Eホールディングス	10,100	621.00	6,272,100	貸付有価証券 4,700株
日本システム技術	3,000	1,780.00	5,340,000	
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	953.00	4,765,000	
ソースネクスト	90,500	299.00	27,059,500	貸付有価証券 42,900株(17,000株)
インフォコム	20,900	3,030.00	63,327,000	貸付有価証券 200株
HEROZ	2,700	3,955.00	10,678,500	貸付有価証券 1,200株(1,100株)
ラクスル	15,300	3,165.00	48,424,500	貸付有価証券 7,200株(2,800株)
F I G	20,600	305.00	6,283,000	
システムサポート	4,300	2,388.00	10,268,400	
イーソル	9,100	1,345.00	12,239,500	貸付有価証券 700株
アルテリア・ネットワークス	21,100	2,029.00	42,811,900	貸付有価証券 800株
東海ソフト	1,300	1,311.00	1,704,300	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,200	1,051.00	3,363,200	
トビラシステムズ	2,200	1,989.00	4,375,800	貸付有価証券 1,000株
フォーカスシステムズ	11,800	911.00	10,749,800	
クレスコ	11,600	1,513.00	17,550,800	
フジ・メディア・ホールディングス	183,800	1,050.00	192,990,000	貸付有価証券 200株
オービック	66,100	18,980.00	1,254,578,000	
ジャストシステム	31,000	7,510.00	232,810,000	
T D Cソフト	16,700	922.00	15,397,400	
Zホールディングス	2,620,000	539.00	1,412,180,000	貸付有価証券 26,700株
トレンドマイクロ	84,800	5,960.00	505,408,000	貸付有価証券

				5,500株
I Dホールディングス	7,300	1,485.00	10,840,500	
日本オラクル	38,700	12,160.00	470,592,000	
アルファシステムズ	5,900	3,695.00	21,800,500	
フューチャー	23,000	1,759.00	40,457,000	貸付有価証券 200株
C A C H o l d i n g s	12,400	1,292.00	16,020,800	貸付有価証券 200株
S Bテクノロジー	6,800	3,175.00	21,590,000	貸付有価証券 200株
トーセ	5,200	859.00	4,466,800	
オービックビジネスコン サルタント	19,500	5,860.00	114,270,000	貸付有価証券 8,500株
伊藤忠テクノソリュー ションズ	86,900	3,895.00	338,475,500	
アイティフォー	23,100	765.00	17,671,500	貸付有価証券 100株
東計電算	2,800	4,420.00	12,376,000	
エクスネット	3,000	979.00	2,937,000	
大塚商会	103,200	5,700.00	588,240,000	貸付有価証券 300株
サイボウズ	22,300	3,340.00	74,482,000	
ソフトブレーン	11,200	474.00	5,308,800	貸付有価証券 1,100株
電通国際情報サービス	11,800	4,995.00	58,941,000	
A C C E S S	17,800	985.00	17,533,000	貸付有価証券 100株
デジタルガレージ	34,300	3,560.00	122,108,000	貸付有価証券 3,400株
E Mシステムズ	26,800	945.00	25,326,000	貸付有価証券 200株
ウェザーニューズ	6,400	3,870.00	24,768,000	
C I J	13,000	928.00	12,064,000	
ビジネスエンジニアリン グ	2,200	2,793.00	6,144,600	
日本エンタープライズ	19,400	272.00	5,276,800	
WOWOW	9,100	2,478.00	22,549,800	
スカラ	12,700	745.00	9,461,500	
インテリジェント ウェ イブ	11,100	814.00	9,035,400	貸付有価証券 800株

I M A G I C A G R O U P	16,200	405.00	6,561,000	
ネットワンシステムズ	72,700	3,495.00	254,086,500	貸付有価証券 4,900株
システムソフト	41,100	102.00	4,192,200	貸付有価証券 200株
アルゴグラフィックス	16,200	3,565.00	57,753,000	
マーベラス	29,100	733.00	21,330,300	貸付有価証券 1,100株
エイベックス	32,800	872.00	28,601,600	
日本ユニシス	59,600	3,390.00	202,044,000	貸付有価証券 4,900株
兼松エレクトロニクス	10,400	3,630.00	37,752,000	
東京放送ホールディングス	116,000	1,765.00	204,740,000	貸付有価証券 900株
日本テレビホールディングス	159,300	1,221.00	194,505,300	貸付有価証券 500株
朝日放送グループホールディングス	18,900	821.00	15,516,900	
テレビ朝日ホールディングス	52,400	1,619.00	84,835,600	貸付有価証券 21,500株
スカパーJ S A Tホールディングス	125,500	446.00	55,973,000	貸付有価証券 200株
テレビ東京ホールディングス	15,600	2,436.00	38,001,600	貸付有価証券 100株
日本BS放送	6,400	1,098.00	7,027,200	
ビジョン	17,800	772.00	13,741,600	貸付有価証券 3,200株
スマートバリュー	5,000	1,255.00	6,275,000	貸付有価証券 100株（100株）
USEN-NEXT HOLDINGS	7,300	1,333.00	9,730,900	貸付有価証券 2,100株（400株）
ワイヤレスゲート	9,000	661.00	5,949,000	貸付有価証券 4,200株
コネクシオ	10,800	1,435.00	15,498,000	
日本通信	148,700	166.00	24,684,200	貸付有価証券 68,600株（62,100株）
クロップス	3,500	750.00	2,625,000	
日本電信電話	2,550,300	2,496.00	6,365,548,800	貸付有価証券 82,800株
K D D I	1,421,800	3,167.00	4,502,840,600	貸付有価証券

				73,800株
ソフトバンク	1,733,800	1,381.00	2,394,377,800	貸付有価証券 41,000株
光通信	19,700	24,090.00	474,573,000	
NTTドコモ	1,364,300	2,901.50	3,958,516,450	
エムティーアイ	18,500	710.00	13,135,000	
GMOインターネット	75,200	2,915.00	219,208,000	貸付有価証券 36,000株
ファイバーゲート	6,100	1,600.00	9,760,000	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	494.00	2,815,800	
KADOKAWA	51,400	1,892.00	97,248,800	貸付有価証券 1,500株
学研ホールディングス	25,600	1,520.00	38,912,000	
ゼンリン	38,000	1,255.00	47,690,000	貸付有価証券 2,500株
昭文社ホールディングス	8,800	418.00	3,678,400	貸付有価証券 200株
インプレスホールディング ス	15,800	156.00	2,464,800	
アイネット	9,800	1,476.00	14,464,800	
松竹	12,600	14,520.00	182,952,000	貸付有価証券 5,400株(400株)
東宝	112,600	3,920.00	441,392,000	貸付有価証券 33,400株
東映	7,100	14,550.00	103,305,000	貸付有価証券 2,300株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	508,000	1,237.00	628,396,000	貸付有価証券 8,400株
ピー・シー・エー	3,300	4,550.00	15,015,000	貸付有価証券 400株
ビジネスブレイン太田昭 和	3,300	2,569.00	8,477,700	
D T S	42,600	2,308.00	98,320,800	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	81,400	5,610.00	456,654,000	貸付有価証券 7,900株
シーイーシー	20,400	1,708.00	34,843,200	
カブコン	89,900	3,930.00	353,307,000	貸付有価証券 600株
アイ・エス・ピー	3,700	2,273.00	8,410,100	

ジャステック	12,100	1,200.00	14,520,000	
S C S K	44,000	5,220.00	229,680,000	貸付有価証券 300株
日本システムウエア	6,300	2,305.00	14,521,500	
アイネス	18,800	1,343.00	25,248,400	
T K C	16,100	5,660.00	91,126,000	
富士ソフト	24,400	4,335.00	105,774,000	貸付有価証券 100株
N S D	61,300	1,835.00	112,485,500	貸付有価証券 16,000株
コナミホールディングス	69,300	3,605.00	249,826,500	貸付有価証券 1,000株
福井コンピュータホールディングス	7,500	2,830.00	21,225,000	
J B C C ホールディングス	12,900	1,545.00	19,930,500	
ミロク情報サービス	16,800	2,354.00	39,547,200	貸付有価証券 400株
ソフトバンクグループ	1,513,800	5,512.00	8,344,065,600	貸付有価証券 6,200株
ハウスイ	1,500	886.00	1,329,000	
高千穂交易	7,400	970.00	7,178,000	
カワニシホールディングス	2,300	1,449.00	3,332,700	貸付有価証券 1,000株
伊藤忠食品	4,700	4,870.00	22,889,000	
エレマテック	17,900	870.00	15,573,000	
J A L U X	5,400	1,780.00	9,612,000	貸付有価証券 2,400株
あらた	15,200	4,775.00	72,580,000	貸付有価証券 100株
トーメンデバイス	2,900	3,725.00	10,802,500	
東京エレクトロン デバイス	6,900	2,889.00	19,934,100	
フィールズ	14,700	340.00	4,998,000	貸付有価証券 700株
双日	1,057,600	239.00	252,766,400	貸付有価証券 35,600株
アルフレッサ ホールディングス	212,800	2,273.00	483,694,400	貸付有価証券 200株
横浜冷凍	50,100	915.00	45,841,500	
神栄	2,600	494.00	1,284,400	

ラサ商事	10,100	902.00	9,110,200	
アルコニックス	20,300	1,173.00	23,811,900	
神戸物産	66,100	6,050.00	399,905,000	貸付有価証券 28,400株
ハイパー	2,900	597.00	1,731,300	
あい ホールディングス	27,300	1,596.00	43,570,800	貸付有価証券 1,700株
ディーブイエックス	6,800	829.00	5,637,200	貸付有価証券 2,100株
ダイワボウホールディングス	16,300	7,820.00	127,466,000	貸付有価証券 100株
マクニカ・富士エレホールディングス	45,700	1,536.00	70,195,200	貸付有価証券 20,600株
ラクト・ジャパン	7,100	3,755.00	26,660,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	36,000	1,032.00	37,152,000	
八洲電機	14,800	920.00	13,616,000	
メディアスホールディングス	10,900	925.00	10,082,500	貸付有価証券 5,100株
レスターホールディングス	20,000	2,044.00	40,880,000	
ジュテックホールディングス	4,400	1,055.00	4,642,000	
大光	8,100	681.00	5,516,100	
OCHIホールディングス	5,500	1,470.00	8,085,000	
TOKAIホールディングス	101,200	1,017.00	102,920,400	貸付有価証券 300株
黒谷	5,200	514.00	2,672,800	
Cominix	3,300	721.00	2,379,300	
三洋貿易	19,300	1,029.00	19,859,700	
ビューティガレージ	3,100	1,706.00	5,288,600	
ウイン・パートナーズ	13,800	951.00	13,123,800	貸付有価証券 6,200株
ミタチ産業	5,700	627.00	3,573,900	
シップヘルスケアホールディングス	30,700	4,460.00	136,922,000	
明治電機工業	6,000	1,449.00	8,694,000	
デリカフーズホールディングス	6,700	627.00	4,200,900	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	649.00	2,790,700	貸付有価証券 1,500株
コメダホールディングス	41,700	1,856.00	77,395,200	
ピーバンドットコム	1,900	1,028.00	1,953,200	
アセンテック	2,000	3,455.00	6,910,000	貸付有価証券 900株
富士興産	5,800	455.00	2,639,000	
協栄産業	2,100	1,205.00	2,530,500	
小野建	17,200	1,240.00	21,328,000	貸付有価証券 1,700株(1,200株)
南陽	4,200	1,475.00	6,195,000	
佐鳥電機	13,000	860.00	11,180,000	
エコートレーディング	4,400	527.00	2,318,800	
伯東	11,700	1,016.00	11,887,200	
コンドーテック	14,800	1,163.00	17,212,400	
中山福	11,000	522.00	5,742,000	
ナガイレーベン	25,400	2,711.00	68,859,400	
三菱食品	21,100	2,786.00	58,784,600	
松田産業	14,000	1,365.00	19,110,000	
第一興商	28,500	3,405.00	97,042,500	
メディバルホールディングス	206,600	2,129.00	439,851,400	貸付有価証券 1,100株
S P K	8,200	1,404.00	11,512,800	
萩原電気ホールディングス	7,100	2,085.00	14,803,500	
アズワン	12,500	11,820.00	147,750,000	
スズデン	6,600	1,207.00	7,966,200	
尾家産業	5,600	1,518.00	8,500,800	
シモジマ	11,700	1,175.00	13,747,500	
ドウシシャ	18,000	1,555.00	27,990,000	
小津産業	4,200	1,692.00	7,106,400	
高速	11,400	1,461.00	16,655,400	
たけびし	6,700	1,494.00	10,009,800	
リックス	4,300	1,549.00	6,660,700	
丸文	16,900	494.00	8,348,600	
ハピネット	16,000	1,183.00	18,928,000	
橋本総業ホールディングス	3,900	2,083.00	8,123,700	



日本ライフライン	56,700	1,412.00	80,060,400	
タカショー	12,400	474.00	5,877,600	貸付有価証券 1,200株
マルカ	6,800	2,002.00	13,613,600	
I D O M	51,600	513.00	26,470,800	貸付有価証券 3,500株（3,500株）
進和	11,300	1,984.00	22,419,200	
エスケイジャパン	4,100	316.00	1,295,600	
ダイترون	8,100	1,701.00	13,778,100	
シークス	24,300	1,026.00	24,931,800	貸付有価証券 200株
田中商事	5,900	700.00	4,130,000	
オーハシテクニカ	10,800	1,593.00	17,204,400	
白銅	6,800	1,373.00	9,336,400	
ダイコー通産	1,200	1,409.00	1,690,800	
伊藤忠商事	1,339,400	2,331.00	3,122,141,400	貸付有価証券 400株
丸紅	1,993,300	506.10	1,008,809,130	貸付有価証券 36,200株
高島	3,000	1,747.00	5,241,000	
長瀬産業	107,700	1,327.00	142,917,900	貸付有価証券 100株
蝶理	12,200	1,910.00	23,302,000	
豊田通商	213,700	2,807.00	599,855,900	貸付有価証券 1,500株
三共生興	29,000	438.00	12,702,000	
兼松	71,400	1,253.00	89,464,200	
ツカモトコーポレーション	3,400	1,127.00	3,831,800	
三井物産	1,658,100	1,654.50	2,743,326,450	貸付有価証券 2,100株
日本紙パルプ商事	10,900	3,995.00	43,545,500	
カメイ	25,000	1,027.00	25,675,000	
東都水産	2,400	3,370.00	8,088,000	貸付有価証券 1,100株
O U Gホールディングス	3,000	2,619.00	7,857,000	
スターゼン	7,100	4,420.00	31,382,000	
山善	74,800	890.00	66,572,000	
椿本興業	3,500	3,750.00	13,125,000	

住友商事	1,208,200	1,265.00	1,528,373,000	貸付有価証券 3,800株
内田洋行	7,500	6,250.00	46,875,000	
三菱商事	1,343,800	2,317.50	3,114,256,500	貸付有価証券 21,300株
第一実業	9,400	3,650.00	34,310,000	
キャノンマーケティング ジャパン	47,500	2,236.00	106,210,000	貸付有価証券 1,100株
西華産業	10,800	1,233.00	13,316,400	
佐藤商事	15,800	856.00	13,524,800	
菱洋エレクトロ	19,400	2,740.00	53,156,000	貸付有価証券 700株
東京産業	17,300	530.00	9,169,000	
ユアサ商事	18,200	2,900.00	52,780,000	貸付有価証券 100株
神鋼商事	4,800	2,002.00	9,609,600	
トルク	11,400	334.00	3,807,600	
阪和興業	35,800	1,962.00	70,239,600	貸付有価証券 700株
正栄食品工業	12,400	4,245.00	52,638,000	
カナデン	15,500	1,315.00	20,382,500	
菱電商事	13,800	1,532.00	21,141,600	
フルサト工業	10,600	1,385.00	14,681,000	
岩谷産業	42,500	3,770.00	160,225,000	貸付有価証券 17,400株（5,700株）
ナイス	8,200	825.00	6,765,000	
昭光通商	6,100	611.00	3,727,100	
ニチモウ	3,000	1,852.00	5,556,000	
極東貿易	5,500	1,505.00	8,277,500	
イワキ	25,100	512.00	12,851,200	
三愛石油	47,100	1,016.00	47,853,600	貸付有価証券 300株
稲畑産業	42,200	1,250.00	52,750,000	貸付有価証券 100株
G S Iクレオス	4,700	1,236.00	5,809,200	
明和産業	17,700	473.00	8,372,100	貸付有価証券 8,300株（5,400株）
クワザワ	6,800	529.00	3,597,200	
ヤマエ久野	13,900	1,183.00	16,443,700	

ワキタ	40,800	947.00	38,637,600	
東邦ホールディングス	61,400	2,045.00	125,563,000	
サンゲツ	52,200	1,493.00	77,934,600	
ミツウロコグループホールディングス	28,200	1,165.00	32,853,000	
シナネンホールディングス	7,900	2,752.00	21,740,800	
伊藤忠エネクス	42,300	877.00	37,097,100	
サンリオ	53,800	1,682.00	90,491,600	貸付有価証券 6,600株(3,600株)
サンワテクノス	13,600	966.00	13,137,600	
リョーサン	21,100	2,280.00	48,108,000	
新光商事	30,000	850.00	25,500,000	
トーヨー	8,600	1,894.00	16,288,400	
三信電気	10,300	1,446.00	14,893,800	
東陽テクニカ	20,500	1,049.00	21,504,500	
モスフードサービス	25,100	2,954.00	74,145,400	貸付有価証券 1,100株
加賀電子	19,100	2,002.00	38,238,200	
ソーダニッカ	19,800	527.00	10,434,600	
立花エレテック	14,100	1,735.00	24,463,500	
フォーバル	8,400	1,011.00	8,492,400	
PALTAC	30,700	4,940.00	151,658,000	
三谷産業	25,200	346.00	8,719,200	
太平洋興発	7,500	619.00	4,642,500	
西本Wismettac ホールディングス	3,500	2,050.00	7,175,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,870.00	3,179,000	
国際紙パルプ商事	45,300	279.00	12,638,700	
ヤマタネ	9,600	1,196.00	11,481,600	
丸紅建材リース	1,900	1,625.00	3,087,500	
日鉄物産	13,700	3,525.00	48,292,500	
泉州電業	5,900	2,968.00	17,511,200	
トラスコ中山	39,800	2,721.00	108,295,800	
オートバックスセブン	71,000	1,395.00	99,045,000	貸付有価証券 8,000株
モリト	13,900	678.00	9,424,200	

加藤産業	27,600	3,610.00	99,636,000	
北恵	4,800	938.00	4,502,400	
イノテック	9,900	975.00	9,652,500	
イエローハット	36,200	1,505.00	54,481,000	
J Kホールディングス	17,300	784.00	13,563,200	貸付有価証券 7,900株
日伝	17,300	2,375.00	41,087,500	
北沢産業	14,400	288.00	4,147,200	
杉本商事	10,300	1,884.00	19,405,200	
因幡電機産業	54,500	2,416.00	131,672,000	
東テク	6,300	2,183.00	13,752,900	
ミスミグループ本社	240,000	2,784.00	668,160,000	貸付有価証券 6,700株
アルテック	15,200	233.00	3,541,600	
タキヒヨー	5,800	1,840.00	10,672,000	
蔵王産業	3,700	1,435.00	5,309,500	
スズケン	81,100	4,010.00	325,211,000	貸付有価証券 1,700株
ジェコス	13,200	935.00	12,342,000	
グローセル	19,100	460.00	8,786,000	
ローソン	48,400	5,850.00	283,140,000	貸付有価証券 300株
サンエー	15,900	4,020.00	63,918,000	
カワチ薬品	14,800	2,681.00	39,678,800	貸付有価証券 2,000株
エービーシー・マート	29,900	6,440.00	192,556,000	
ハードオフコーポレーション	7,600	713.00	5,418,800	
アスクル	20,000	3,705.00	74,100,000	
ゲオホールディングス	34,500	1,330.00	45,885,000	
アダストリア	26,500	1,655.00	43,857,500	貸付有価証券 8,500株
ジーフット	11,600	484.00	5,614,400	貸付有価証券 5,500株
シー・ヴィ・エス・バイ エリア	2,800	502.00	1,405,600	
くら寿司	10,000	5,210.00	52,100,000	
キャンドウ	9,100	2,198.00	20,001,800	貸付有価証券 200株

パルグループホールディングス	19,600	1,308.00	25,636,800	
エディオン	87,900	1,064.00	93,525,600	貸付有価証券 39,800株
サーラコーポレーション	38,900	571.00	22,211,900	
ワッツ	8,400	980.00	8,232,000	
ハローズ	7,200	3,525.00	25,380,000	
フジオフードシステム	16,100	1,600.00	25,760,000	貸付有価証券 1,900株
あみやき亭	4,100	3,205.00	13,140,500	貸付有価証券 400株
ひらまつ	35,200	191.00	6,723,200	
大黒天物産	4,600	4,500.00	20,700,000	
ハニーズホールディングス	16,800	1,048.00	17,606,400	
ファーマライズホールディングス	4,600	671.00	3,086,600	貸付有価証券 200株
アルペン	14,700	1,802.00	26,489,400	貸付有価証券 7,000株
ハブ	5,400	766.00	4,136,400	
クオールホールディングス	28,200	1,182.00	33,332,400	
ジンスホールディングス	10,100	6,680.00	67,468,000	貸付有価証券 4,600株
ビックカメラ	113,600	1,175.00	133,480,000	
DCMホールディングス	106,100	1,170.00	124,137,000	貸付有価証券 50,000株(1,200株)
MonotaRO	136,200	4,275.00	582,255,000	貸付有価証券 21,400株(11,300株)
東京一番フーズ	4,800	515.00	2,472,000	貸付有価証券 1,400株
DDホールディングス	7,600	1,013.00	7,698,800	
きちりホールディングス	5,100	633.00	3,228,300	
アークランドサービスホールディングス	14,000	2,008.00	28,112,000	貸付有価証券 6,600株
J・フロントリテイリング	228,700	859.00	196,453,300	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	27,500	1,718.00	47,245,000	
マツモトキヨシホールディングス	79,200	4,035.00	319,572,000	貸付有価証券 100株

ブロンコピリー	10,000	2,594.00	25,940,000	貸付有価証券 4,700株
Z O Z O	131,700	2,328.00	306,597,600	貸付有価証券 19,200株
トレジャー・ファクトリー	5,600	827.00	4,631,200	
物語コーポレーション	5,100	8,420.00	42,942,000	貸付有価証券 2,400株
ココカラファイン	20,000	5,680.00	113,600,000	
三越伊勢丹ホールディングス	334,800	683.00	228,668,400	貸付有価証券 16,900株
H a m e e	6,800	1,785.00	12,138,000	貸付有価証券 100株
ウエルシアホールディングス	56,900	8,880.00	505,272,000	貸付有価証券 500株
クリエイティブSDホールディングス	32,300	3,350.00	108,205,000	
丸善CHIホールディングス	22,300	386.00	8,607,800	貸付有価証券 10,700株
ミサワ	3,900	525.00	2,047,500	
ティーライフ	2,800	1,020.00	2,856,000	貸付有価証券 1,300株
エー・ピーカンパニー	3,600	493.00	1,774,800	
チムニー	5,800	1,599.00	9,274,200	
シュッピン	13,000	744.00	9,672,000	
オイシックス・ラ・大地	18,900	2,134.00	40,332,600	
ネクステージ	27,400	863.00	23,646,200	貸付有価証券 8,400株(3,100株)
ジョイフル本田	56,100	1,351.00	75,791,100	貸付有価証券 26,800株
鳥貴族	5,600	1,631.00	9,133,600	貸付有価証券 2,500株(400株)
麒麟堂ホールディングス	7,500	2,438.00	18,285,000	貸付有価証券 100株
ホットランド	12,800	1,254.00	16,051,200	貸付有価証券 6,000株
すかいらーくホールディングス	214,600	1,809.00	388,211,400	貸付有価証券 103,200株
S F Pホールディングス	10,900	1,619.00	17,647,100	貸付有価証券 100株
綿半ホールディングス	7,200	1,872.00	13,478,400	

ヨシックス	3,100	2,039.00	6,320,900	
ユニテッド・スーパー マーケット・ホール	55,600	1,121.00	62,327,600	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	558.00	4,910,400	貸付有価証券 4,200株(1,000株)
B E E N O S	8,900	1,052.00	9,362,800	貸付有価証券 1,800株
あさひ	14,300	1,450.00	20,735,000	貸付有価証券 500株(500株)
日本調剤	11,600	1,638.00	19,000,800	
コスモス薬品	16,900	16,620.00	280,878,000	貸付有価証券 200株
トーエル	9,200	709.00	6,522,800	
オンリー	3,200	605.00	1,936,000	貸付有価証券 100株(100株)
セブン & アイ・ホール ディングス	749,100	3,708.00	2,777,662,800	貸付有価証券 145,300株
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	102,900	756.00	77,792,400	貸付有価証券 47,300株(5,600株)
ツルハホールディングス	41,600	15,950.00	663,520,000	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	1,732.00	26,153,200	
フェリシモ	4,200	1,169.00	4,909,800	
トリドールホールディ ングス	47,300	1,302.00	61,584,600	貸付有価証券 18,000株
T O K Y O B A S E	17,200	360.00	6,192,000	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	734.00	1,761,600	貸付有価証券 1,100株
J Mホールディングス	14,500	2,860.00	41,470,000	貸付有価証券 6,800株
サツドラホールディ ングス	2,900	1,957.00	5,675,300	
アレンザホールディ ングス	9,600	943.00	9,052,800	
串カツ田中ホールディ ングス	3,900	1,706.00	6,653,400	貸付有価証券 1,800株
パロックジャパンリミ テッド	13,300	642.00	8,538,600	貸付有価証券 400株
クスリのアオキホール ディングス	17,100	9,180.00	156,978,000	貸付有価証券 1,200株

力の源ホールディングス	8,700	722.00	6,281,400	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	105,100	2,478.00	260,437,800	貸付有価証券 300株
LIXILピバ	18,900	2,593.00	49,007,700	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	513.00	9,490,500	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	9,000	754.00	6,786,000	貸付有価証券 4,100株
ノジマ	34,100	2,595.00	88,489,500	
カップ・クリエイト	26,800	1,496.00	40,092,800	貸付有価証券 1,600株(100株)
ライトオン	14,300	581.00	8,308,300	貸付有価証券 6,300株
ジーンズメイト	5,800	233.00	1,351,400	貸付有価証券 2,700株(2,300株)
良品計画	254,200	1,563.00	397,314,600	貸付有価証券 11,300株
三城ホールディングス	20,300	305.00	6,191,500	
アドヴァン	29,200	1,359.00	39,682,800	
アルビス	7,300	2,258.00	16,483,400	
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	2,465.00	27,854,500	
イオン北海道	25,200	805.00	20,286,000	
コジマ	32,900	549.00	18,062,100	貸付有価証券 15,700株
ヒマラヤ	6,700	820.00	5,494,000	
コーナン商事	27,200	3,135.00	85,272,000	貸付有価証券 300株
エコス	7,000	1,942.00	13,594,000	
ワタミ	22,600	1,004.00	22,690,400	貸付有価証券 8,000株(2,400株)
マルシェ	5,000	608.00	3,040,000	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ールディングス	420,900	2,345.00	987,010,500	貸付有価証券 800株
西松屋チェーン	42,000	1,120.00	47,040,000	貸付有価証券 18,800株



ゼンショーホールディングス	91,700	2,241.00	205,499,700	貸付有価証券 5,100株
幸楽苑ホールディングス	12,200	1,632.00	19,910,400	貸付有価証券 2,700株(700株)
ハークスレイ	4,000	1,012.00	4,048,000	貸付有価証券 300株(300株)
サイゼリヤ	28,400	2,107.00	59,838,800	貸付有価証券 8,300株
V Tホールディングス	79,300	349.00	27,675,700	
魚力	5,300	1,598.00	8,469,400	貸付有価証券 2,400株
ポブラ	5,000	430.00	2,150,000	貸付有価証券 700株
フジ・コーポレーション	5,100	1,998.00	10,189,800	
ユナイテッドアローズ	20,100	1,778.00	35,737,800	
ハイデイ日高	27,600	1,821.00	50,259,600	貸付有価証券 13,100株
京都きもの友禅	12,200	250.00	3,050,000	
コロワイド	63,600	1,595.00	101,442,000	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	726.00	18,440,400	貸付有価証券 4,500株
壱番屋	13,500	5,080.00	68,580,000	貸付有価証券 100株
トップカルチャー	6,900	345.00	2,380,500	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
P L A N T	4,900	570.00	2,793,000	
スギホールディングス	38,200	7,170.00	273,894,000	
薬王堂ホールディングス	8,300	2,536.00	21,048,800	
ヴィア・ホールディングス	23,400	475.00	11,115,000	貸付有価証券 1,100株(700株)
スクロール	29,400	464.00	13,641,600	
ヨンドシーホールディングス	19,500	1,881.00	36,679,500	貸付有価証券 100株
ファミリーマート	153,000	1,912.00	292,536,000	貸付有価証券 24,300株
木曽路	25,000	2,530.00	63,250,000	貸付有価証券 600株(600株)
S R Sホールディングス	22,600	919.00	20,769,400	貸付有価証券 10,800株
千趣会	34,600	392.00	13,563,200	貸付有価証券

				16,400株
タカキュー	14,800	148.00	2,190,400	貸付有価証券 300株（300株）
リテールパートナーズ	25,300	1,643.00	41,567,900	貸付有価証券 4,800株
ケーヨー	39,300	685.00	26,920,500	
上新電機	22,500	2,095.00	47,137,500	
日本瓦斯	30,300	4,570.00	138,471,000	
ロイヤルホールディングス	33,400	1,968.00	65,731,200	貸付有価証券 16,000株（300株）
東天紅	1,400	982.00	1,374,800	
いなげや	23,700	1,716.00	40,669,200	
島忠	36,000	2,856.00	102,816,000	貸付有価証券 6,900株
チヨダ	20,100	1,124.00	22,592,400	
ライフコーポレーション	14,500	3,390.00	49,155,000	貸付有価証券 200株（200株）
リンガーハット	23,600	2,404.00	56,734,400	貸付有価証券 10,300株
MrMaxHD	26,300	529.00	13,912,700	
テナアライド	17,600	386.00	6,793,600	貸付有価証券 8,400株
AOKIホールディングス	38,300	637.00	24,397,100	貸付有価証券 7,400株
オークワ	30,000	1,659.00	49,770,000	貸付有価証券 100株
コメリ	29,600	2,743.00	81,192,800	
青山商事	39,500	783.00	30,928,500	貸付有価証券 500株
しまむら	22,300	7,450.00	166,135,000	貸付有価証券 300株
はせがわ	10,100	337.00	3,403,700	
高島屋	139,500	952.00	132,804,000	貸付有価証券 33,600株（23,700株）
松屋	38,600	699.00	26,981,400	貸付有価証券 18,400株
エイチ・ツー・オー テイリング	90,700	789.00	71,562,300	貸付有価証券 300株
近鉄百貨店	7,300	3,130.00	22,849,000	貸付有価証券 3,400株
丸井グループ	175,500	2,058.00	361,179,000	貸付有価証券

				6,900株
アクシアル リテイリング	15,900	4,125.00	65,587,500	
井筒屋	10,400	191.00	1,986,400	貸付有価証券 200株
イオン	736,900	2,485.50	1,831,564,950	貸付有価証券 1,000株
イズミ	38,900	3,470.00	134,983,000	
平和堂	38,900	1,875.00	72,937,500	貸付有価証券 17,800株
フジ	23,100	1,899.00	43,866,900	貸付有価証券 200株
ヤオコー	21,700	7,700.00	167,090,000	貸付有価証券 6,800株
ゼビオホールディングス	23,100	874.00	20,189,400	
ケースホールディングス	184,800	1,464.00	270,547,200	貸付有価証券 1,000株
Olympicグループ	9,900	864.00	8,553,600	
日産東京販売ホールディングス	28,200	258.00	7,275,600	貸付有価証券 100株
シルバーライフ	2,600	2,216.00	5,761,600	貸付有価証券 800株
一家ダイニングプロジェクト	2,000	620.00	1,240,000	
Genky Drug Stores	8,400	3,420.00	28,728,000	貸付有価証券 3,900株
ナルミヤ・インターナショナル	4,300	660.00	2,838,000	
ブックオフグループホールディングス	11,200	847.00	9,486,400	貸付有価証券 5,300株（400株）
アインホールディングス	23,500	7,140.00	167,790,000	貸付有価証券 1,100株
元気寿司	4,800	2,418.00	11,606,400	貸付有価証券 2,500株
ヤマダ電機	583,400	529.00	308,618,600	貸付有価証券 74,600株
アークランドサカモト	30,000	1,803.00	54,090,000	貸付有価証券 14,100株（7,200株）
ニトリホールディングス	82,900	19,835.00	1,644,321,500	貸付有価証券 600株
グルメ杵屋	13,600	1,030.00	14,008,000	貸付有価証券 6,300株

愛眼	15,300	219.00	3,350,700	貸付有価証券 800株
ケーユーホールディングス	10,000	829.00	8,290,000	
吉野家ホールディングス	62,900	2,362.00	148,569,800	貸付有価証券 17,900株（10,700株）
松屋フーズホールディングス	9,200	3,735.00	34,362,000	
サガミホールディングス	25,600	1,284.00	32,870,400	貸付有価証券 12,300株
関西スーパーマーケット	15,900	1,095.00	17,410,500	
王将フードサービス	14,100	6,130.00	86,433,000	
プレナス	21,400	1,803.00	38,584,200	貸付有価証券 8,300株
ミニストップ	14,200	1,499.00	21,285,800	
アークス	39,100	2,145.00	83,869,500	貸付有価証券 700株
バローホールディングス	42,400	2,170.00	92,008,000	貸付有価証券 100株
藤久	2,000	1,103.00	2,206,000	貸付有価証券 900株
ベルク	9,400	6,920.00	65,048,000	
大庄	10,200	1,350.00	13,770,000	貸付有価証券 4,800株
ファーストリテイリング	25,600	62,710.00	1,605,376,000	貸付有価証券 2,200株
サンドラッグ	72,000	3,620.00	260,640,000	
サックスパーホールディングス	16,200	601.00	9,736,200	
ヤマザワ	4,500	1,729.00	7,780,500	
やまや	3,900	2,381.00	9,285,900	貸付有価証券 1,800株
ベルーナ	41,100	631.00	25,934,100	貸付有価証券 400株
島根銀行	5,000	524.00	2,620,000	
じもとホールディングス	129,600	97.00	12,571,200	
めぶきフィナンシャルグループ	996,400	252.00	251,092,800	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	1,165.00	30,173,500	
九州フィナンシャルグループ	419,600	454.00	190,498,400	貸付有価証券

グループ				44,700株
ゆうちょ銀行	543,300	867.00	471,041,100	貸付有価証券 259,800株
富山第一銀行	45,700	273.00	12,476,100	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,095,300	357.00	391,022,100	貸付有価証券 6,600株
西日本フィナンシャルホールディングス	127,600	728.00	92,892,800	貸付有価証券 1,900株
関西みらいフィナンシャルグループ	112,500	424.00	47,700,000	貸付有価証券 1,900株
三十三フィナンシャルグループ	17,800	1,381.00	24,581,800	
第四北越フィナンシャルグループ	33,300	2,262.00	75,324,600	貸付有価証券 1,100株
新生銀行	140,700	1,385.00	194,869,500	貸付有価証券 100株
あおぞら銀行	114,200	1,977.00	225,773,400	貸付有価証券 27,500株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,117,800	437.50	5,739,037,500	貸付有価証券 1,426,700株
りそなホールディングス	2,104,400	377.50	794,411,000	貸付有価証券 200株
三井住友トラスト・ホールディングス	362,500	3,067.00	1,111,787,500	貸付有価証券 300株
三井住友フィナンシャルグループ	1,326,200	3,115.00	4,131,113,000	貸付有価証券 10,900株
千葉銀行	640,000	522.00	334,080,000	貸付有価証券 27,200株
群馬銀行	368,400	350.00	128,940,000	貸付有価証券 6,200株
武蔵野銀行	28,600	1,569.00	44,873,400	
千葉興業銀行	52,600	243.00	12,781,800	
筑波銀行	79,700	178.00	14,186,600	貸付有価証券 100株
七十七銀行	64,800	1,668.00	108,086,400	貸付有価証券 400株
青森銀行	14,900	2,309.00	34,404,100	
秋田銀行	12,300	1,519.00	18,683,700	
山形銀行	21,600	1,332.00	28,771,200	
岩手銀行	12,600	2,627.00	33,100,200	
東邦銀行	171,500	228.00	39,102,000	貸付有価証券

				300株
東北銀行	9,200	940.00	8,648,000	
みちのく銀行	12,300	1,116.00	13,726,800	
ふくおかフィナンシャル グループ	161,500	1,756.00	283,594,000	貸付有価証券 100株
静岡銀行	474,900	705.00	334,804,500	
十六銀行	24,000	2,065.00	49,560,000	
スルガ銀行	196,200	404.00	79,264,800	貸付有価証券 24,200株
八十二銀行	462,800	422.00	195,301,600	貸付有価証券 1,000株
山梨中央銀行	22,300	859.00	19,155,700	
大垣共立銀行	37,900	2,329.00	88,269,100	
福井銀行	16,400	1,668.00	27,355,200	
北國銀行	19,100	2,909.00	55,561,900	貸付有価証券 400株
清水銀行	7,900	1,802.00	14,235,800	
富山銀行	3,700	2,302.00	8,517,400	
滋賀銀行	38,500	2,499.00	96,211,500	貸付有価証券 800株(700株)
南都銀行	31,900	2,191.00	69,892,900	
百五銀行	172,600	330.00	56,958,000	貸付有価証券 200株
京都銀行	68,700	3,940.00	270,678,000	貸付有価証券 1,900株
紀陽銀行	67,900	1,697.00	115,226,300	
ほくほくフィナンシャル グループ	127,600	924.00	117,902,400	
広島銀行	283,100	511.00	144,664,100	貸付有価証券 400株
山陰合同銀行	113,700	551.00	62,648,700	貸付有価証券 100株
中国銀行	165,000	1,009.00	166,485,000	
鳥取銀行	6,500	1,224.00	7,956,000	
伊予銀行	273,600	655.00	179,208,000	貸付有価証券 2,200株
百十四銀行	20,400	1,953.00	39,841,200	
四国銀行	29,100	816.00	23,745,600	貸付有価証券 2,200株
阿波銀行	31,300	2,514.00	78,688,200	貸付有価証券

				1,600株
大分銀行	11,000	2,399.00	26,389,000	
宮崎銀行	12,800	2,385.00	30,528,000	
佐賀銀行	11,600	1,207.00	14,001,200	
沖縄銀行	17,600	3,175.00	55,880,000	
琉球銀行	44,200	975.00	43,095,000	
セブン銀行	640,600	296.00	189,617,600	貸付有価証券 22,000株
みずほフィナンシャルグループ	26,057,500	135.50	3,530,791,250	貸付有価証券 108,300株
高知銀行	7,000	689.00	4,823,000	
山口フィナンシャルグループ	239,400	669.00	160,158,600	
長野銀行	6,300	1,169.00	7,364,700	
名古屋銀行	14,300	2,423.00	34,648,900	
北洋銀行	289,100	214.00	61,867,400	
愛知銀行	6,900	2,890.00	19,941,000	
中京銀行	7,900	2,111.00	16,676,900	
大光銀行	6,600	1,530.00	10,098,000	
愛媛銀行	26,800	1,178.00	31,570,400	
トマト銀行	7,400	1,036.00	7,666,400	
京葉銀行	81,800	524.00	42,863,200	貸付有価証券 100株
栃木銀行	92,600	169.00	15,649,400	
北日本銀行	6,000	1,846.00	11,076,000	
東和銀行	33,700	707.00	23,825,900	
福島銀行	18,000	178.00	3,204,000	貸付有価証券 3,500株
大東銀行	10,000	614.00	6,140,000	
トモニホールディングス	148,300	354.00	52,498,200	貸付有価証券 2,400株
フィデアホールディングス	186,200	108.00	20,109,600	
池田泉州ホールディングス	220,500	169.00	37,264,500	貸付有価証券 800株
F P G	59,100	628.00	37,114,800	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	597.00	5,074,500	

S B Iホールディングス	214,200	2,298.00	492,231,600	
日本アジア投資	16,200	246.00	3,985,200	貸付有価証券 1,000株
ジャフコ	29,500	3,510.00	103,545,000	
大和証券グループ本社	1,538,700	459.70	707,340,390	
野村ホールディングス	3,374,200	485.20	1,637,161,840	貸付有価証券 9,600株
岡三証券グループ	163,400	333.00	54,412,200	貸付有価証券 1,400株
丸三証券	57,000	427.00	24,339,000	貸付有価証券 13,700株
東洋証券	68,600	127.00	8,712,200	貸付有価証券 400株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	220,200	251.00	55,270,200	貸付有価証券 7,000株
光世証券	4,600	521.00	2,396,600	
水戸証券	55,500	200.00	11,100,000	
いちよし証券	35,900	442.00	15,867,800	
松井証券	109,600	832.00	91,187,200	貸付有価証券 2,500株
だいこう証券ビジネス	9,300	917.00	8,528,100	貸付有価証券 200株
マネックスグループ	140,700	226.00	31,798,200	貸付有価証券 45,500株(37,400株)
極東証券	25,700	527.00	13,543,900	貸付有価証券 200株
岩井コスモホールディングス	18,100	1,051.00	19,023,100	
藍澤証券	34,400	704.00	24,217,600	
マネーパートナーズグループ	20,400	202.00	4,120,800	貸付有価証券 4,200株
スパークス・グループ	88,600	220.00	19,492,000	貸付有価証券 600株
小林洋行	5,500	253.00	1,391,500	
かんぼ生命保険	67,900	1,417.00	96,214,300	貸付有価証券 12,800株
S O M P Oホールディングス	360,600	3,691.00	1,330,974,600	貸付有価証券 900株
アニコムホールディングス	15,900	4,675.00	74,332,500	貸付有価証券 2,100株
M S & A Dインシュアラ	501,400	3,077.00	1,542,807,800	貸付有価証券



ンスグループホール				700株
ソニーフィナンシャル ホールディングス	157,600	2,592.00	408,499,200	貸付有価証券 8,000株
第一生命ホールディング ス	1,085,100	1,367.50	1,483,874,250	貸付有価証券 2,400株
東京海上ホールディング ス	678,000	4,714.00	3,196,092,000	貸付有価証券 600株
T & Dホールディングス	573,200	981.00	562,309,200	貸付有価証券 12,100株
アドバンスクリエイト	4,000	2,127.00	8,508,000	貸付有価証券 600株
全国保証	54,000	4,175.00	225,450,000	貸付有価証券 17,800株
ジェイリース	5,300	385.00	2,040,500	貸付有価証券 2,200株
イントラスト	6,700	764.00	5,118,800	貸付有価証券 600株
日本モーゲージサービス	3,900	2,049.00	7,991,100	
C a s a	6,700	1,106.00	7,410,200	貸付有価証券 3,100株
アルヒ	30,500	1,599.00	48,769,500	貸付有価証券 14,300株（6,700株）
プレミアグループ	10,400	2,004.00	20,841,600	
クレディセゾン	134,300	1,355.00	181,976,500	貸付有価証券 3,400株
芙蓉総合リース	20,100	6,010.00	120,801,000	
みずほリース	29,600	2,358.00	69,796,800	貸付有価証券 700株
東京センチュリー	38,600	5,540.00	213,844,000	貸付有価証券 9,500株
日本証券金融	84,500	510.00	43,095,000	貸付有価証券 100株
アイフル	292,500	242.00	70,785,000	貸付有価証券 61,000株
リコーリース	15,100	3,065.00	46,281,500	
イオンフィナンシャル サービス	117,400	1,234.00	144,871,600	貸付有価証券 200株
アコム	385,400	427.00	164,565,800	貸付有価証券 19,300株
ジャックス	21,200	1,788.00	37,905,600	貸付有価証券 400株
オリエントコーポレー	518,700	126.00	65,356,200	貸付有価証券

ション				1,000株
日立キャピタル	45,200	2,404.00	108,660,800	貸付有価証券 100株
アプラスフィナンシャル	92,000	69.00	6,348,000	貸付有価証券 1,500株
オリックス	1,199,400	1,391.00	1,668,365,400	貸付有価証券 6,300株
三菱UFJリース	486,700	520.00	253,084,000	
九州リースサービス	9,400	505.00	4,747,000	
日本取引所グループ	550,400	2,392.00	1,316,556,800	貸付有価証券 8,000株
イー・ギャランティ	20,500	2,158.00	44,239,000	貸付有価証券 100株
アサックス	10,000	699.00	6,990,000	貸付有価証券 4,300株
NECキャピタルソ リューション	7,800	2,016.00	15,724,800	
いちご	244,100	280.00	68,348,000	
日本駐車場開発	189,300	138.00	26,123,400	貸付有価証券 100株
スター・マイカ・ホール ディングス	9,900	1,344.00	13,305,600	
ADワークスグループ	35,600	187.00	6,657,200	
ヒューリック	409,500	1,047.00	428,746,500	
三栄建築設計	7,700	1,275.00	9,817,500	
野村不動産ホールディン グス	116,400	2,065.00	240,366,000	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	470.00	18,283,000	貸付有価証券 18,200株
サムティ	27,200	1,360.00	36,992,000	貸付有価証券 900株
ディア・ライフ	27,100	495.00	13,414,500	
コーセーアールイー	5,600	529.00	2,962,400	
日本商業開発	12,100	1,564.00	18,924,400	
プレサンスコーポレー ション	31,500	1,191.00	37,516,500	貸付有価証券 900株(400株)
ハウスコム	3,300	1,296.00	4,276,800	
日本管理センター	12,600	1,229.00	15,485,400	
サンセイランディック	5,600	885.00	4,956,000	貸付有価証券 2,600株

エストラスト	2,600	625.00	1,625,000	
フージャースホールディングス	38,200	545.00	20,819,000	
オープンハウス	55,700	3,555.00	198,013,500	貸付有価証券 2,600株
東急不動産ホールディングス	521,400	528.00	275,299,200	貸付有価証券 2,100株
飯田グループホールディングス	160,000	1,691.00	270,560,000	貸付有価証券 3,700株
イーグランド	3,100	716.00	2,219,600	
ムゲンエステート	13,200	555.00	7,326,000	貸付有価証券 6,300株
ビーロット	9,000	723.00	6,507,000	
ファーストブラザーズ	4,400	743.00	3,269,200	
ハウスドゥ	9,400	1,032.00	9,700,800	貸付有価証券 4,500株
シーアールイー	4,800	1,342.00	6,441,600	
プロパティエージェント	3,000	1,055.00	3,165,000	
ケイアイスター不動産	6,000	1,756.00	10,536,000	
アグレ都市デザイン	3,100	489.00	1,515,900	
グッドコムアセット	4,600	1,766.00	8,123,600	貸付有価証券 1,100株
ジェイ・エス・ビー	4,100	2,570.00	10,537,000	
テンポイノベーション	4,300	704.00	3,027,200	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	675.00	2,160,000	
パーク24	102,900	1,850.00	190,365,000	貸付有価証券 31,000株
パラカ	4,900	1,668.00	8,173,200	
三井不動産	945,800	2,060.50	1,948,820,900	
三菱地所	1,343,600	1,652.00	2,219,627,200	貸付有価証券 53,700株
平和不動産	35,200	3,110.00	109,472,000	貸付有価証券 900株
東京建物	202,000	1,306.00	263,812,000	貸付有価証券 1,600株
ダイビル	49,400	994.00	49,103,600	貸付有価証券 3,400株
京阪神ビルディング	30,700	1,391.00	42,703,700	

住友不動産	431,100	3,006.00	1,295,886,600	貸付有価証券 4,400株
テーオーシー	37,600	687.00	25,831,200	
東京楽天地	3,100	4,605.00	14,275,500	貸付有価証券 1,500株
レオパレス21	251,300	258.00	64,835,400	貸付有価証券 97,700株(78,600株)
スターツコーポレーション	26,100	2,225.00	58,072,500	
フジ住宅	22,200	524.00	11,632,800	
空港施設	19,200	433.00	8,313,600	
明和地所	10,500	423.00	4,441,500	
ゴールドクレスト	15,100	1,511.00	22,816,100	貸付有価証券 3,000株
エスリード	7,500	1,371.00	10,282,500	
日神グループホールディングス	28,300	379.00	10,725,700	
日本エスコン	34,700	814.00	28,245,800	貸付有価証券 8,100株(7,800株)
タカラレーベン	87,600	358.00	31,360,800	
AVANTIA	10,800	788.00	8,510,400	
イオンモール	96,100	1,456.00	139,921,600	貸付有価証券 33,700株
毎日コムネット	4,900	800.00	3,920,000	
ファースト住建	8,200	955.00	7,831,000	
カチタス	47,500	2,653.00	126,017,500	貸付有価証券 8,800株
トーセイ	26,400	1,128.00	29,779,200	貸付有価証券 1,100株
穴吹興産	4,200	1,783.00	7,488,600	貸付有価証券 2,000株
サンフロンティア不動産	26,500	868.00	23,002,000	
エフ・ジェー・ネクスト	16,700	870.00	14,529,000	貸付有価証券 1,000株
インテリックス	5,400	502.00	2,710,800	
ランドビジネス	6,500	392.00	2,548,000	
日本社宅サービス	5,900	1,083.00	6,389,700	
グランディハウス	14,900	371.00	5,527,900	
日本空港ビルデング	61,200	4,730.00	289,476,000	貸付有価証券 25,000株(1,700株)

日本工営	12,500	3,045.00	38,062,500	貸付有価証券 100株
L I F U L L	64,800	458.00	29,678,400	貸付有価証券 500株
ジェイエシーリクルー トメント	12,500	1,189.00	14,862,500	貸付有価証券 3,000株(2,100株)
日本M&Aセンター	140,300	4,985.00	699,395,500	貸付有価証券 5,900株
メンバーズ	5,500	1,610.00	8,855,000	
中広	2,600	545.00	1,417,000	
UTグループ	29,200	2,288.00	66,809,600	貸付有価証券 13,800株(4,900株)
アイティメディア	7,400	1,706.00	12,624,400	貸付有価証券 1,100株
タケエイ	17,800	989.00	17,604,200	
E・Jホールディングス	3,300	1,588.00	5,240,400	
ビーネックスグループ	23,300	954.00	22,228,200	貸付有価証券 300株
コシダカホールディング ス	44,700	454.00	20,293,800	貸付有価証券 16,200株
アルトナー	4,500	951.00	4,279,500	
パソナグループ	20,100	1,173.00	23,577,300	
C D S	4,600	1,255.00	5,773,000	
リンクアンドモチベー ション	41,000	422.00	17,302,000	貸付有価証券 17,400株(5,400株)
G C A	22,500	650.00	14,625,000	
エス・エム・エス	57,800	2,486.00	143,690,800	貸付有価証券 5,400株
サニーサイドアップグ ループ	6,400	836.00	5,350,400	貸付有価証券 3,000株(300株)
パーソルホールディング ス	185,800	1,489.00	276,656,200	貸付有価証券 14,200株
リニカル	9,000	906.00	8,154,000	貸付有価証券 1,800株
クックパッド	64,800	350.00	22,680,000	
エスクリ	5,800	408.00	2,366,400	貸付有価証券 2,700株
アイ・ケイ・ケイ	9,000	581.00	5,229,000	貸付有価証券 300株
学情	6,600	1,282.00	8,461,200	貸付有価証券 800株

スタジオアリス	9,300	1,588.00	14,768,400	
シミックホールディングス	9,100	1,523.00	13,859,300	
エプロ	3,900	1,136.00	4,430,400	
N J S	4,100	1,811.00	7,425,100	
総合警備保障	73,900	5,100.00	376,890,000	貸付有価証券 600株
カカクコム	137,300	2,704.00	371,259,200	貸付有価証券 1,000株
セントケア・ホールディング	12,000	415.00	4,980,000	貸付有価証券 6,600株
サイネックス	3,100	727.00	2,253,700	
ルネサンス	10,300	1,043.00	10,742,900	貸付有価証券 3,500株
ディップ	26,200	2,332.00	61,098,400	貸付有価証券 12,300株
オプトホールディング	10,100	1,451.00	14,655,100	
新日本科学	20,100	707.00	14,210,700	貸付有価証券 4,300株(2,500株)
ツクイ	43,700	511.00	22,330,700	
キャリアデザインセンター	4,300	986.00	4,239,800	貸付有価証券 100株
ベネフィット・ワン	67,600	2,220.00	150,072,000	貸付有価証券 6,700株(1,900株)
エムスリー	409,700	4,500.00	1,843,650,000	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	327.00	3,858,600	貸付有価証券 800株
プラス	2,400	521.00	1,250,400	
アウトソーシング	106,300	684.00	72,709,200	貸付有価証券 100株
ウェルネット	18,700	731.00	13,669,700	
ワールドホールディングス	6,400	1,731.00	11,078,400	貸付有価証券 500株(100株)
ディー・エヌ・エー	91,000	1,365.00	124,215,000	貸付有価証券 6,900株
博報堂D Yホールディングス	258,400	1,279.00	330,493,600	貸付有価証券 1,400株
ぐるなび	32,300	744.00	24,031,200	貸付有価証券 100株
タカミヤ	19,700	515.00	10,145,500	

ジャパンベストレス キューシステム	14,700	869.00	12,774,300	貸付有価証券 2,700株
ファンコミュニケーションズ	51,100	450.00	22,995,000	貸付有価証券 200株
ライク	6,100	1,530.00	9,333,000	貸付有価証券 2,900株（200株）
ビジネス・ブレイクス ルー	7,700	387.00	2,979,900	
エスプール	47,700	758.00	36,156,600	
WDBホールディングス	8,500	2,681.00	22,788,500	貸付有価証券 800株
手間いらず	1,200	5,040.00	6,048,000	貸付有価証券 300株
ティア	10,800	528.00	5,702,400	
CDG	2,000	1,562.00	3,124,000	
バリューコマース	10,400	3,030.00	31,512,000	
インフォマート	203,600	804.00	163,694,400	貸付有価証券 13,500株
JPホールディングス	58,300	280.00	16,324,000	
EPSホールディングス	25,200	1,065.00	26,838,000	
レッグス	4,600	975.00	4,485,000	
プレステージ・インター ナショナル	69,600	788.00	54,844,800	
アミューズ	10,100	2,281.00	23,038,100	
ドリームインキュベータ	5,600	1,443.00	8,080,800	
クイック	11,500	1,189.00	13,673,500	
TAC	11,200	198.00	2,217,600	
ケネディクス	173,100	539.00	93,300,900	
電通グループ	191,500	2,754.00	527,391,000	貸付有価証券 18,000株
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	7,100	700.00	4,970,000	貸付有価証券 500株
ぴあ	5,300	3,540.00	18,762,000	貸付有価証券 2,500株（1,400株）
イオンファンタジー	7,200	1,683.00	12,117,600	貸付有価証券 3,300株（3,000株）
シーティーエス	21,000	872.00	18,312,000	貸付有価証券 200株
ネクシィーズグループ	5,700	1,014.00	5,779,800	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	2,714.00	141,128,000	貸付有価証券 6,200株
アルプス技研	16,400	1,867.00	30,618,800	
ダイオーズ	3,700	1,014.00	3,751,800	貸付有価証券 2,100株
日本空調サービス	19,400	747.00	14,491,800	
オリエンタルランド	197,600	14,975.00	2,959,060,000	貸付有価証券 500株
ダスキン	46,200	2,722.00	125,756,400	
明光ネットワークジャ パン	23,500	856.00	20,116,000	
ファルコホールディング ス	10,200	1,571.00	16,024,200	
秀英予備校	4,100	419.00	1,717,900	貸付有価証券 100株
ラウンドワン	51,900	839.00	43,544,100	貸付有価証券 24,300株(1,200株)
リゾートトラスト	85,200	1,453.00	123,795,600	貸付有価証券 3,200株
ビー・エム・エル	23,900	2,967.00	70,911,300	
ワタベウェディング	3,000	359.00	1,077,000	
りらいあコミュニケー ションズ	33,600	1,039.00	34,910,400	
リソー教育	84,900	328.00	27,847,200	貸付有価証券 3,000株
早稲田アカデミー	8,100	911.00	7,379,100	
ユー・エス・エス	208,000	1,779.00	370,032,000	
東京個別指導学院	6,600	558.00	3,682,800	貸付有価証券 100株
サイバーエージェント	114,500	5,330.00	610,285,000	貸付有価証券 19,700株(1,800株)
楽天	866,000	937.00	811,442,000	貸付有価証券 12,700株
クリーク・アンド・リ バー社	9,700	1,109.00	10,757,300	貸付有価証券 300株
テー・オー・ダブリュー	29,600	404.00	11,958,400	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	1,391.00	16,692,000	
セントラルスポーツ	6,900	2,443.00	16,856,700	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	1,538.00	28,606,800	
エン・ジャパン	33,000	2,906.00	95,898,000	貸付有価証券 2,300株
リソルホールディングス	2,000	3,495.00	6,990,000	
テクノプロ・ホールディングス	37,100	6,070.00	225,197,000	
アトラ	4,200	249.00	1,045,800	
インターワークス	3,500	381.00	1,333,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,500	10,610.00	79,575,000	貸付有価証券 3,500株
Keepers 技研	6,800	1,558.00	10,594,400	
ファーストロジック	3,600	632.00	2,275,200	貸付有価証券 500株（300株）
三機サービス	3,600	1,013.00	3,646,800	
Gunosy	11,500	1,017.00	11,695,500	
デザインワン・ジャパン	5,500	274.00	1,507,000	
イー・ガーディアン	8,200	2,652.00	21,746,400	
リブセンス	11,900	305.00	3,629,500	貸付有価証券 100株
ジャパンマテリアル	57,100	1,687.00	96,327,700	
ベクトル	23,100	891.00	20,582,100	貸付有価証券 10,200株
ウチヤマホールディングス	9,100	346.00	3,148,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,800	886.00	13,998,800	
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	595.00	3,629,500	
I B J	12,700	800.00	10,160,000	貸付有価証券 6,000株（2,000株）
アサンテ	7,500	1,478.00	11,085,000	
N・フィールド	12,800	589.00	7,539,200	
バリューHR	7,300	1,460.00	10,658,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	15,100	4,105.00	61,985,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,100	2,230.00	15,833,000	
ERIホールディングス	5,200	650.00	3,380,000	

アビスト	2,900	2,680.00	7,772,000	
シグマクシス	12,700	1,859.00	23,609,300	
ウィルグループ	12,100	692.00	8,373,200	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	208.00	5,345,600	貸付有価証券 3,400株
リクルートホールディン グス	1,331,000	3,836.00	5,105,716,000	貸付有価証券 1,500株
エラン	11,000	1,858.00	20,438,000	貸付有価証券 100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	7,100	664.00	4,714,400	貸付有価証券 1,900株
日本郵政	1,522,800	787.40	1,199,052,720	貸付有価証券 300株
ベルシステム24ホール ディングス	31,100	1,389.00	43,197,900	
鎌倉新書	14,000	1,253.00	17,542,000	貸付有価証券 6,600株（100株）
S M N	3,900	1,118.00	4,360,200	
一蔵	2,000	389.00	778,000	
L I T A L I C O	6,400	2,560.00	16,384,000	貸付有価証券 600株（600株）
グローバルキッズCOM P A N Y	3,300	565.00	1,864,500	
エアトリ	9,700	1,338.00	12,978,600	貸付有価証券 4,600株
アトラエ	5,600	3,395.00	19,012,000	貸付有価証券 2,300株
ストライク	7,000	5,040.00	35,280,000	貸付有価証券 200株
ソラスト	51,200	1,131.00	57,907,200	貸付有価証券 600株
セラク	5,800	1,070.00	6,206,000	
インソース	7,700	2,722.00	20,959,400	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	9,510.00	107,463,000	貸付有価証券 400株（300株）
O r c h e s t r a H o l d i n g s	3,900	1,792.00	6,988,800	貸付有価証券 100株
アイモバイル	6,600	824.00	5,438,400	貸付有価証券

				1,400株
キャリアインデックス	7,600	338.00	2,568,800	貸付有価証券 3,300株(100株)
MS - Japan	6,000	854.00	5,124,000	貸付有価証券 300株(300株)
船場	3,000	945.00	2,835,000	
グレイステクノロジー	8,500	5,780.00	49,130,000	貸付有価証券 3,400株
ジャパンエレベーター サービスホールディング	19,600	3,405.00	66,738,000	貸付有価証券 6,800株
フルテック	2,600	1,281.00	3,330,600	
グリーンズ	4,700	522.00	2,453,400	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	468.00	1,450,800	貸付有価証券 1,100株
GameWith	5,500	628.00	3,454,000	貸付有価証券 2,600株
ソウルドアウト	3,800	2,496.00	9,484,800	貸付有価証券 1,700株
MS & Consulting	3,500	544.00	1,904,000	
ミダック	2,400	1,676.00	4,022,400	
日総工産	12,400	679.00	8,419,600	貸付有価証券 200株
キュービーネットホール ディングス	7,600	2,132.00	16,203,200	
RPAホールディングス	14,100	837.00	11,801,700	貸付有価証券 5,000株(3,500株)
スプリックス	5,200	834.00	4,336,800	貸付有価証券 100株
マネジメントソリュー ションズ	8,000	1,495.00	11,960,000	貸付有価証券 800株(300株)
プロレド・パートナーズ	2,500	5,260.00	13,150,000	貸付有価証券 1,100株
and factory	1,800	1,084.00	1,951,200	貸付有価証券 800株
ギークス	1,900	1,269.00	2,411,100	貸付有価証券 800株(800株)
カーブスホールディング ス	51,000	599.00	30,549,000	貸付有価証券 20,700株
フォーラムエンジニアリ ング	9,700	880.00	8,536,000	

アドバンテッジリスクマ ネジメント	9,400	805.00	7,567,000	貸付有価証券 2,700株
リログループ	101,600	2,178.00	221,284,800	貸付有価証券 700株
東祥	11,600	1,343.00	15,578,800	貸付有価証券 200株
エイチ・アイ・エス	29,000	1,890.00	54,810,000	貸付有価証券 8,500株（3,900株）
ラックランド	4,300	2,283.00	9,816,900	貸付有価証券 100株
共立メンテナンス	30,800	3,735.00	115,038,000	貸付有価証券 10,600株
イチネンホールディング ス	20,800	1,224.00	25,459,200	
建設技術研究所	12,800	1,813.00	23,206,400	
スペース	12,000	963.00	11,556,000	貸付有価証券 1,300株
長大	7,400	1,111.00	8,221,400	貸付有価証券 100株
燦ホールディングス	8,100	1,201.00	9,728,100	
スバル興業	1,100	8,100.00	8,910,000	
東京テアトル	7,300	1,249.00	9,117,700	
タナベ経営	3,600	1,285.00	4,626,000	
ナガワ	5,900	7,890.00	46,551,000	貸付有価証券 100株
よみうりランド	4,000	3,670.00	14,680,000	貸付有価証券 100株
東京都競馬	12,200	3,635.00	44,347,000	
常磐興産	7,400	1,440.00	10,656,000	
カナモト	30,400	2,324.00	70,649,600	貸付有価証券 2,700株
東京ドーム	75,200	803.00	60,385,600	貸付有価証券 32,100株
西尾レントオール	17,100	2,239.00	38,286,900	
トランス・コスモス	17,700	2,422.00	42,869,400	貸付有価証券 600株
乃村工藝社	79,600	918.00	73,072,800	貸付有価証券 100株
藤田観光	8,100	1,902.00	15,406,200	貸付有価証券 2,800株
KNT - CTホールディ	11,500	1,118.00	12,857,000	貸付有価証券

ングス				5,400株
日本管財	19,900	1,906.00	37,929,400	
トーカイ	17,900	2,473.00	44,266,700	
白洋舎	2,100	2,893.00	6,075,300	貸付有価証券 900株
セコム	197,200	9,477.00	1,868,864,400	貸付有価証券 1,100株
セントラル警備保障	8,900	4,355.00	38,759,500	
丹青社	35,100	783.00	27,483,300	
メイテック	22,800	5,200.00	118,560,000	貸付有価証券 100株
応用地質	20,000	1,368.00	27,360,000	貸付有価証券 400株
船井総研ホールディングス	38,400	2,481.00	95,270,400	
進学会ホールディングス	7,300	506.00	3,693,800	
オオバ	13,200	650.00	8,580,000	貸付有価証券 100株(100株)
いであ	4,500	1,857.00	8,356,500	
学究社	5,400	1,111.00	5,999,400	
ベネッセホールディングス	61,900	2,843.00	175,981,700	
イオンディライト	22,900	3,030.00	69,387,000	貸付有価証券 300株
ナック	10,300	881.00	9,074,300	貸付有価証券 2,600株
ニチイ学館	26,400	1,646.00	43,454,400	貸付有価証券 700株
ダイセキ	31,100	2,751.00	85,556,100	貸付有価証券 400株
ステップ	6,800	1,505.00	10,234,000	
小計	銘柄数：2,150		431,013,776,070	
	組入時価比率：98.1%		100.0%	
合計			431,013,776,070	

(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22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22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	8,652,995,000	-	8,538,675,000	114,588,785
合計	8,652,995,000	-	8,538,675,000	114,588,785

（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22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	3,762,534,813
コール・ローン	710,502,913
株式	632,295,343,071
投資証券	16,427,151,175
派生商品評価勘定	33,421,103
未収入金	10,767,803
未収配当金	707,171,855
差入委託証拠金	3,455,510,458
流動資産合計	657,402,403,191
資産合計	657,402,403,191
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,501,544
未払解約金	527,635,327
未払利息	851
その他未払費用	3,510,800
流動負債合計	541,648,522
負債合計	541,648,522
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	232,675,647,335
剰余金	

(2020年 6月22日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	424,185,107,334
元本等合計	656,860,754,669
純資産合計	656,860,754,669
負債純資産合計	657,402,403,191

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 6月22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	2,8231円
(10,000口当たり純資産額)	(28,231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25日

至 2020年 6月22日

## 1.金融商品に対する取組方針

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

## 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

## 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 6月22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22日現在		
期首		2019年 6月25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		208,101,589,988円
同期中における追加設定元本額		61,011,172,505円
同期中における一部解約元本額		36,437,115,158円
期末元本額		232,675,647,335円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		47,295,983円
バランスセレクト50		142,198,935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		519,908,143円
野村世界6資産分散投信(安定コース)		4,651,480,600円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		6,100,403,002円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		4,481,594,131円
野村資産設計ファンド2015		16,148,393円
野村資産設計ファンド2020		18,305,482円
野村資産設計ファンド2025		30,266,081円
野村資産設計ファンド2030		37,228,050円
野村資産設計ファンド2035		29,081,057円
野村資産設計ファンド2040		60,104,098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)		36,068,290,377円
のむらップ・ファンド(保守型)		1,037,611,878円
のむらップ・ファンド(普通型)		8,157,050,880円
のむらップ・ファンド(積極型)		5,881,612,482円
野村資産設計ファンド2045		9,165,817円
野村インデックスファンド・外国株式		5,397,848,903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		128,568,615円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)		1,320,069,500円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)		244,312,661円
野村資産設計ファンド2050		14,950,759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		2,323,081円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		1,837,518円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		1,168,476円
のむらップ・ファンド(やや保守型)		198,270,024円
のむらップ・ファンド(やや積極型)		473,323,410円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,772,530円
インデックス・ブレンド(タイプ)		3,464,662円
インデックス・ブレンド(タイプ)		22,445,430円
インデックス・ブレンド(タイプ)		8,508,218円
インデックス・ブレンド(タイプ)		30,616,391円
野村6資産均等バランス		745,022,042円
野村つみたて外国株投信		5,025,052,876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)		3,692,247,303円

世界6資産分散ファンド	69,947,998円
野村資産設計ファンド2060	5,508,714円
野村スリーゼロ先進国株式投信	14,657,706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	507,337,198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)	244,853,843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)	173,062,365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)	1,129,518,116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)	2,155,870,022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)	2,941,025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)	13,771,135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)	14,210,206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)	40,099,928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)	152,519,086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)	2,994,230,507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)	117,506,529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)	682,029,484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)	16,028,912,985円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	170,649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)	11,820,390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)	70,200,448,267円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,889,880,029円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	9,857,360,240円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,766,157,937円
マイバランスDC30	954,054,559円
マイバランスDC50	1,994,681,658円
マイバランスDC70	1,563,932,491円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	23,413,647,828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)	310,136,883円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	257,126,599円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	207,522,221円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	12,529,434円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	6,211,802円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	26,951,834円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,581,411円

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,701,737円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,565,274円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	106,469,830円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	72,708,168円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	34,123,854円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	39,574,318円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,170,273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22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	15.49	1,564,490.00	
		HALLIBURTON CO	135,000	13.04	1,760,400.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	58,000	11.74	680,920.00	
		SCHLUMBERGER LTD	216,000	19.71	4,257,360.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	64,000	18.69	1,196,160.00	
		CHENIERE ENERGY INC	36,400	48.90	1,779,960.00	
		CHEVRON CORP	295,800	90.63	26,808,354.00	
		CONCHO RESOURCES INC	31,000	55.50	1,720,500.00	
		CONOCOPHILLIPS	171,600	43.70	7,498,920.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	23,100	46.73	1,079,463.00	
		EOG RESOURCES INC	90,700	52.30	4,743,610.00	
		EXXON MOBIL CORP	669,000	45.98	30,760,620.00	
		HESS CORP	43,200	51.24	2,213,568.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	23,600	32.24	760,864.00	
		KINDER MORGAN INC	326,000	15.52	5,059,520.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	100,800	38.19	3,849,552.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	142,000	19.71	2,798,820.00	
		ONEOK INC	67,000	35.17	2,356,390.00	
		PHILLIPS 66	70,300	74.70	5,251,410.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,100	93.58	2,442,438.00	
VALERO ENERGY CORP	65,900	63.16	4,162,244.00			

WILLIAMS COS	191,000	19.22	3,671,020.00	
AIR PRODUCTS	34,600	235.51	8,148,646.00	
ALBEMARLE CORP	16,700	78.35	1,308,445.00	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	36,000	22.09	795,240.00	
CELANESE CORP-SERIES A	19,600	86.72	1,699,712.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	29.89	1,055,117.00	
CORTEVA INC	120,000	27.13	3,255,600.00	
DOW INC	115,600	41.65	4,814,740.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	115,500	52.60	6,075,300.00	
EASTMAN CHEMICAL CO.	20,800	69.49	1,445,392.00	
ECOLAB INC	40,500	199.75	8,089,875.00	
FMC CORP	21,100	100.46	2,119,706.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	13,600	126.09	1,714,824.00	
LINDE PLC	83,900	208.05	17,455,395.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	42,100	66.54	2,801,334.00	
MOSAIC CO/THE	56,000	12.90	722,400.00	
PPG INDUSTRIES	36,800	103.72	3,816,896.00	
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	75.42	1,591,362.00	
SHERWIN-WILLIAMS	13,220	584.67	7,729,337.40	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9,700	211.02	2,046,894.00	
VULCAN MATERIALS CO	20,800	120.05	2,497,040.00	
AMCOR PLC	250,000	10.31	2,577,500.00	
AVERY DENNISON CORP	13,400	114.52	1,534,568.00	
BALL CORP	49,800	70.68	3,519,864.00	
CROWN HOLDINGS INC	21,200	65.67	1,392,204.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	59,800	34.86	2,084,628.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	14,500	99.75	1,446,375.00	
SEALED AIR CORP	26,500	31.66	838,990.00	
WESTROCK CO	38,700	28.32	1,095,984.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	225,000	10.50	2,362,500.00	
NEWMONT CORP	128,100	56.92	7,291,452.00	
NUCOR CORP	46,700	42.70	1,994,090.00	
STEEL DYNAMICS	33,400	27.17	907,478.00	
BOEING CO	84,700	187.02	15,840,594.00	
GENERAL DYNAMICS	39,200	157.62	6,178,704.00	

HEICO CORP	6,300	111.25	700,875.00	
HEICO CORP-CLASS A	12,400	89.46	1,109,304.00	
HOWMET AEROSPACE INC	57,000	13.94	794,580.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	178.66	1,161,290.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	35,200	182.24	6,414,848.00	
LOCKHEED MARTIN	40,230	372.20	14,973,606.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	25,210	312.66	7,882,158.60	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	238,900	64.89	15,502,221.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,770	320.97	1,851,996.90	
TEXTRON INC	37,900	34.51	1,307,929.00	
TRANSDIGM GROUP INC	8,090	463.00	3,745,670.00	
ALLEGION PLC	14,800	102.74	1,520,552.00	
CARRIER GLOBAL CORP	130,000	21.45	2,788,500.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	21,600	61.33	1,324,728.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	118,700	34.32	4,073,784.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	221.78	1,264,146.00	
MASCO CORP	42,500	48.49	2,060,825.00	
OWENS CORNING INC	16,800	55.04	924,672.00	
SMITH (A.O.) CORP	21,800	47.29	1,030,922.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	37,600	89.29	3,357,304.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	21,600	85.58	1,848,528.00	
AMETEK INC	35,500	88.53	3,142,815.00	
EATON CORP PLC	64,600	89.34	5,771,364.00	
EMERSON ELEC	97,300	61.98	6,030,654.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,700	209.13	3,910,731.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	37.06	907,970.00	
3M CORP	91,200	158.15	14,423,280.00	
GENERAL ELEC CO	1,385,000	7.15	9,902,750.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	112,000	145.37	16,281,440.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	35,400	43.49	1,539,546.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	33,300	21.60	719,280.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,840	390.56	6,577,030.40	
CATERPILLAR INC DEL	87,100	127.46	11,101,766.00	
CUMMINS INC	23,500	174.29	4,095,815.00	

DEERE & COMPANY	47,100	154.87	7,294,377.00
DOVER CORP	22,900	94.90	2,173,210.00
FORTIVE CORP	47,600	67.85	3,229,660.00
IDEX CORP	12,300	153.24	1,884,852.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	49,900	170.88	8,526,912.00
INGERSOLL-RAND INC	58,000	28.81	1,670,980.00
NORDSON CORP	8,700	193.76	1,685,712.00
OTIS WORLDWIDE CORP	65,000	57.00	3,705,000.00
PACCAR	53,800	74.96	4,032,848.00
PARKER HANNIFIN CORP	20,100	182.94	3,677,094.00
PENTAIR PLC	23,200	38.00	881,600.00
SNAP-ON INC	8,400	135.89	1,141,476.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	23,900	133.92	3,200,688.00
WABTEC CORP	28,800	60.16	1,732,608.00
XYLEM INC	27,800	65.29	1,815,062.00
AERCAP HOLDINGS NV	21,000	32.11	674,310.00
FASTENAL CO	92,100	41.58	3,829,978.50
GRAINGER(W.W.) INC	7,480	303.01	2,266,514.80
HD SUPPLY HOLDINGS INC	26,800	34.82	933,176.00
UNITED RENTALS INC	11,300	155.51	1,757,263.00
CINTAS CORP	14,200	270.16	3,836,272.00
COPART INC	33,700	84.41	2,844,617.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	35,900	79.94	2,869,846.00
ROLLINS INC	23,900	41.85	1,000,215.00
WASTE CONNECTIONS INC	42,300	90.22	3,816,306.00
WASTE MANAGEMENT INC	66,800	101.77	6,798,236.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	22,100	77.75	1,718,275.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	27,300	73.55	2,007,915.00
FEDEX CORPORATION	39,100	137.63	5,381,333.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	111,200	107.77	11,984,024.00
XPO LOGISTICS INC	14,300	79.18	1,132,274.00
DELTA AIR LINES INC	25,200	29.51	743,652.00
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	34.55	684,090.00
AMERCO	1,170	309.98	362,676.60
CSX CORP	122,800	67.99	8,349,172.00

HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	117.60	1,552,320.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	14,800	144.27	2,135,196.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,800	42.16	876,928.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	40,300	170.26	6,861,478.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,300	168.21	2,573,613.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	150,800	32.30	4,870,840.00	
UNION PAC CORP	108,500	167.85	18,211,725.00	
APTIV PLC	41,500	77.73	3,225,795.00	
AUTOLIV INC	11,900	63.10	750,890.00	
BORGWARNER INC	35,000	34.24	1,198,400.00	
LEAR CORP	8,400	111.12	933,408.00	
FORD MOTOR COMPANY	607,000	6.23	3,781,610.00	
GENERAL MOTORS CO	205,000	26.59	5,450,950.00	
TESLA INC	23,200	1,000.90	23,220,880.00	
DR HORTON INC	53,800	56.06	3,016,028.00	
GARMIN LTD	22,700	98.34	2,232,318.00	
LENNAR CORP-A	43,000	60.18	2,587,740.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	93.07	949,314.00	
NEWELL BRANDS INC	66,000	15.87	1,047,420.00	
NVR INC	559	3,298.28	1,843,738.52	
PULTEGROUP INC	43,000	34.67	1,490,810.00	
WHIRLPOOL CORP	9,400	127.09	1,194,646.00	
HASBRO INC	21,400	71.34	1,526,676.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	19,600	297.38	5,828,648.00	
NIKE INC-B	196,800	95.78	18,849,504.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	71.39	556,842.00	
V F CORP	52,000	63.29	3,291,080.00	
ARAMARK	34,000	23.67	804,780.00	
CARNIVAL CORP	72,000	17.83	1,283,760.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,120	1,010.83	4,164,619.60	
DARDEN RESTAURANTS INC	19,800	70.27	1,391,346.00	
DOMINOS PIZZA INC	6,280	378.41	2,376,414.80	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	43,400	76.17	3,305,778.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	53,800	47.19	2,538,822.00	
	42,900	89.68	3,847,272.00	

MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA				
MCDONALD'S CORP	117,300	186.56	21,883,488.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	16.44	558,960.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	18.21	1,292,910.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,600	55.27	1,470,182.00	
STARBUCKS CORP	184,400	75.40	13,903,760.00	
VAIL RESORTS INC	6,000	182.34	1,094,040.00	
WYNN RESORTS LTD	15,500	86.79	1,345,245.00	
YUM BRANDS INC	46,800	88.26	4,130,568.00	
GENUINE PARTS CO	23,200	87.58	2,031,856.00	
LKQ CORP	44,000	25.93	1,140,920.00	
AMAZON.COM INC	66,720	2,675.01	178,476,667.20	
BOOKING HOLDINGS INC	6,520	1,626.91	10,607,453.20	
EBAY INC	124,500	48.29	6,012,105.00	
EXPEDIA GROUP INC	20,500	82.06	1,682,230.00	
MERCADOLIBRE INC	6,980	952.96	6,651,660.80	
WAYFAIR INC - CLASS A	10,600	209.99	2,225,894.00	
DOLLAR GENERAL CORP	39,800	188.78	7,513,444.00	
DOLLAR TREE INC	37,600	88.80	3,338,880.00	
TARGET CORP	80,500	120.56	9,705,080.00	
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	144.90	1,579,410.00	
AUTOZONE	3,670	1,130.60	4,149,302.00	
BEST BUY COMPANY INC	36,000	81.20	2,923,200.00	
BURLINGTON STORES INC	10,500	206.67	2,170,035.00	
CARMAX INC	26,100	91.87	2,397,807.00	
HOME DEPOT	171,800	246.65	42,374,470.00	
LOWES COS INC	121,100	133.83	16,206,813.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,970	422.18	5,053,494.60	
ROSS STORES INC	56,000	93.31	5,225,360.00	
TIFFANY & CO	16,900	120.88	2,042,872.00	
TJX COS INC	190,300	52.64	10,017,392.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	18,000	127.67	2,298,060.00	
ULTA BEAUTY INC	8,600	212.19	1,824,834.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	69,810	299.90	20,936,019.00	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	4.61	207,450.00	
	126,900	32.24	4,091,256.00	



KROGER CO			
SYSCO CORP	75,800	54.26	4,112,908.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	120,900	44.13	5,335,317.00
WALMART INC	223,200	119.85	26,750,520.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	50,000	65.32	3,266,000.00
COCA COLA CO	641,600	46.02	29,526,432.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	32,600	38.47	1,254,122.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	26,800	181.41	4,861,788.00
KEURIG DR PEPPER INC	56,000	28.71	1,607,760.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	31,400	38.03	1,194,142.00
MONSTER BEVERAGE CORP	63,800	70.08	4,471,104.00
PEPSICO INC	218,700	131.28	28,710,936.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	88,400	40.24	3,557,216.00
BUNGE LIMITED	22,000	40.63	893,860.00
CAMPBELL SOUP CO	27,400	49.14	1,346,436.00
CONAGRA BRANDS INC	76,900	33.55	2,579,995.00
GENERAL MILLS	94,400	61.58	5,813,152.00
HERSHEY CO/THE	23,500	129.45	3,042,075.00
HORMEL FOODS CORP	45,600	48.55	2,213,880.00
INGREDION INC	11,200	85.80	960,960.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,600	108.94	2,026,284.00
KELLOGG CO	40,000	67.78	2,711,200.00
KRAFT HEINZ CO/THE	108,800	33.48	3,642,624.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,900	66.20	1,582,180.00
MCCORMICK & CO INC.	19,900	172.20	3,426,780.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	224,800	52.56	11,815,488.00
TYSON FOODS INC-CL A	46,900	63.22	2,965,018.00
ALTRIA GROUP INC	294,500	40.69	11,983,205.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	245,700	72.20	17,739,540.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	39,500	77.52	3,062,040.00
CLOROX CO	20,100	217.64	4,374,564.00
COLGATE PALMOLIVE CO.	129,300	73.36	9,485,448.00
KIMBERLY-CLARK CORP	54,500	143.96	7,845,820.00
PROCTER & GAMBLE CO	389,000	118.92	46,259,880.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	35,400	190.30	6,736,620.00

ABBOTT LABORATORIES	277,500	90.68	25,163,700.00
ABIOMED INC	7,200	257.09	1,851,048.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,800	260.91	3,078,738.00
BAXTER INTERNATIONAL INC.	81,000	84.49	6,843,690.00
BECTON,DICKINSON	42,900	237.59	10,192,611.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	218,600	36.59	7,998,574.00
DANAHER CORP	99,200	172.95	17,156,640.00
DENTSPLY SIRONA INC	35,200	43.62	1,535,424.00
DEXCOM INC	14,480	409.36	5,927,532.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	99,600	70.24	6,995,904.00
HOLOGIC INC	43,300	55.16	2,388,428.00
IDEXX LABORATORIES INC	13,600	314.67	4,279,512.00
INSULET CORP	9,800	199.52	1,955,296.00
INTUITIVE SURGICAL INC	18,200	587.53	10,693,046.00
MASIMO CORP	8,200	226.03	1,853,446.00
MEDTRONIC PLC	211,800	93.91	19,890,138.00
RESMED INC	22,500	172.72	3,886,200.00
STERIS PLC	13,800	152.24	2,100,912.00
STRYKER CORP	53,100	187.11	9,935,541.00
TELEFLEX INC	7,530	368.39	2,773,976.70
THE COOPER COMPANIES, INC.	8,070	299.12	2,413,898.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,200	119.47	1,696,474.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,800	216.59	2,555,762.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	33,200	126.22	4,190,504.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	23,900	102.15	2,441,385.00
ANTHEM INC	39,600	266.43	10,550,628.00
CARDINAL HEALTH INC	47,200	53.81	2,539,832.00
CENTENE CORP	92,100	64.22	5,914,662.00
CIGNA CORP	59,200	191.40	11,330,880.00
CVS HEALTH CORP	206,200	64.49	13,297,838.00
DAVITA INC	14,800	79.55	1,177,340.00
HCA HEALTHCARE INC	42,200	97.53	4,115,766.00
HENRY SCHEIN INC	23,100	60.42	1,395,702.00
HUMANA INC	21,070	380.76	8,022,613.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,800	162.35	2,565,130.00
	25,600	156.70	4,011,520.00

MCKESSON CORP			
MOLINA HEALTHCARE INC	9,700	179.75	1,743,575.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	20,500	108.27	2,219,535.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	149,400	291.24	43,511,256.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	13,200	96.70	1,276,440.00
ABBVIE INC	278,718	96.71	26,954,817.78
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	34,400	119.35	4,105,640.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,500	150.71	2,637,425.00
AMGEN INC	92,800	238.70	22,151,360.00
BEIGENE, LTD ADR	6,300	182.67	1,150,821.00
BIOGEN INC	27,620	271.00	7,485,020.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28,000	124.12	3,475,360.00
EXACT SCIENCES CORP	22,600	89.93	2,032,418.00
GILEAD SCIENCES INC	200,400	77.47	15,524,988.00
INCYTE CORP	28,500	105.40	3,003,900.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	21,400	58.95	1,261,530.00
MODERNA INC	43,200	66.35	2,866,320.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,200	128.83	1,829,386.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	16,010	643.92	10,309,159.20
SAREPTA THERAPEUTICS INC	11,300	168.82	1,907,666.00
SEATTLE GENETICS INC	18,700	169.91	3,177,317.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	41,100	293.27	12,053,397.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	355,100	56.41	20,031,191.00
CATALENT INC	24,800	71.22	1,766,256.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	60,000	22.26	1,335,600.00
ELI LILLY & CO.	135,300	159.94	21,639,882.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,000	113.97	1,025,730.00
JOHNSON & JOHNSON	415,200	143.83	59,718,216.00
MERCK & CO INC	399,300	77.90	31,105,470.00
MYLAN NV	86,000	16.16	1,389,760.00
PERRIGO CO PLC	19,600	54.87	1,075,452.00
PFIZER INC	875,200	33.42	29,249,184.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	179,000	12.67	2,267,930.00
ZOETIS INC	75,600	137.40	10,387,440.00
BANK OF AMERICA CORP	1,237,000	25.25	31,234,250.00

CITIGROUP	331,200	52.92	17,527,104.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	70,000	25.35	1,774,500.00
COMERICA INC	23,000	39.44	907,120.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	38.22	791,154.00
FIFTH THIRD BANCORP	112,000	20.79	2,328,480.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	27,100	110.86	3,004,306.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	169,000	10.29	1,739,010.00
JPMORGAN CHASE & CO	484,300	97.81	47,369,383.00
KEYCORP	158,000	13.35	2,109,300.00
M & T BANK CORP	20,000	111.05	2,221,000.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	71,000	11.97	849,870.00
PNC FINANCIAL	68,700	108.23	7,435,401.00
REGIONS FINANCIAL CORP	150,000	12.00	1,800,000.00
SIGNATURE BANK	8,900	106.40	946,960.00
SVB FINANCIAL GROUP	8,100	221.84	1,796,904.00
TRUIST FINANCIAL CORP	213,300	39.34	8,391,222.00
US BANCORP	217,400	38.87	8,450,338.00
WELLS FARGO CO	612,400	27.60	16,902,240.00
ZIONS BANCORP NA	27,500	36.08	992,200.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	218,300	179.72	39,232,876.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	62,000	19.68	1,220,160.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	46.52	1,009,484.00
AFLAC INC	108,900	36.60	3,985,740.00
ALLEGHANY CORP	2,300	483.52	1,112,096.00
ALLSTATE CORP	50,300	98.73	4,966,119.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	63.33	791,625.00
AMERICAN INTL GROUP	137,800	31.81	4,383,418.00
AON PLC	36,900	186.79	6,892,551.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	63,900	29.33	1,874,187.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,700	94.74	2,813,778.00
ASSURANT INC	9,000	106.28	956,520.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	33.32	706,384.00
BROWN & BROWN INC	38,800	41.13	1,595,844.00
CHUBB LTD	70,800	127.95	9,058,860.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24,600	63.17	1,553,982.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	186.53	690,161.00

EVEREST RE GROUP LTD	6,200	215.73	1,337,526.00	
FNF GROUP	45,400	31.55	1,432,370.00	
GLOBE LIFE INC	15,700	76.20	1,196,340.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	58,300	39.98	2,330,834.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	39.60	1,184,040.00	
LOEWS CORP	43,300	34.73	1,503,809.00	
MARKEL CORP	2,130	930.76	1,982,518.80	
MARSH & MCLENNAN COS	78,900	103.58	8,172,462.00	
METLIFE INC	125,000	37.32	4,665,000.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,400	42.17	1,872,348.00	
PROGRESSIVE CO	91,500	80.99	7,410,585.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,000	63.09	3,974,670.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10,500	83.93	881,265.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,700	178.45	1,195,615.00	
TRAVELERS COS INC/THE	40,800	116.56	4,755,648.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	20,200	188.85	3,814,770.00	
WR BERKLEY CORP	24,100	58.66	1,413,706.00	
ACCENTURE PLC-CL A	100,300	201.55	20,215,465.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	25,800	100.47	2,592,126.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	67,700	149.00	10,087,300.00	
BLACK KNIGHT INC	24,200	71.73	1,735,866.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	79.79	1,803,254.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	17,900	123.33	2,207,607.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	86,600	54.16	4,690,256.00	
EPAM SYSTEMS INC	8,400	252.32	2,119,488.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	97,400	135.00	13,149,000.00	
FISERV INC	90,600	100.05	9,064,530.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13,800	264.32	3,647,616.00	
GARTNER INC	14,100	120.03	1,692,423.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	47,300	176.08	8,328,584.00	
GODADDY INC - CLASS A	26,900	81.20	2,184,280.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	140,300	122.47	17,182,541.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12,500	181.29	2,266,125.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	21,500	96.70	2,079,050.00	
	140,900	296.50	41,776,850.00	

MASTERCARD INC				
MONGODB INC	7,400	205.94	1,523,956.00	
OKTA INC	18,000	198.19	3,567,420.00	
PAYCHEX INC	50,500	73.97	3,735,485.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	176,200	164.36	28,960,232.00	
SQUARE INC - A	55,700	97.98	5,457,486.00	
TWILIO INC - A	18,600	210.29	3,911,394.00	
VERISIGN INC	16,200	205.26	3,325,212.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	268,800	192.20	51,663,360.00	
WESTERN UNION CO	66,000	21.61	1,426,260.00	
WIX.COM LTD	7,700	236.85	1,823,745.00	
ADOBE INC	75,890	428.01	32,481,678.90	
ANSYS INC	13,400	281.59	3,773,306.00	
AUTODESK INC.	35,000	237.82	8,323,700.00	
AVALARA INC	11,800	124.45	1,468,510.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	44,600	91.90	4,098,740.00	
CDK GLOBAL INC	20,000	41.27	825,400.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	18,900	107.62	2,034,018.00	
CITRIX SYSTEMS INC	18,400	144.60	2,660,640.00	
COUPA SOFTWARE INC	10,600	258.86	2,743,916.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,400	101.08	1,657,712.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	101.30	557,150.00	
DATADOG INC - CLASS A	16,700	86.79	1,449,393.00	
DOCUSIGN INC	27,100	161.42	4,374,482.00	
DROPBOX INC-CLASS A	39,000	23.30	908,700.00	
DYNATRACE INC	20,100	41.80	840,180.00	
FAIR ISAAC CORP	4,630	421.90	1,953,397.00	
FORTINET INC	22,800	136.71	3,116,988.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	106.82	1,452,752.00	
INTUIT INC	41,300	286.32	11,825,016.00	
MICROSOFT CORP	1,139,400	195.15	222,353,910.00	
NORTONLIFELOCK INC	91,000	20.81	1,893,710.00	
ORACLE CORPORATION	353,000	54.40	19,203,200.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	15,200	230.73	3,507,096.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,100	318.16	2,577,096.00	

PTC INC	17,000	78.71	1,338,070.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	11,200	276.17	3,093,104.00
SALESFORCE.COM INC	132,600	186.95	24,789,570.00
SERVICENOW INC	30,120	399.87	12,044,084.40
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	48,800	33.13	1,616,744.00
SPLUNK INC	24,800	187.16	4,641,568.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	36,700	58.63	2,151,721.00
SYNOPSYS INC	23,900	184.45	4,408,355.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,480	394.78	2,558,174.40
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,100	333.21	2,032,581.00
VMWARE INC - CLASS A	13,000	150.69	1,958,970.00
WORKDAY INC-CLASS A	26,500	183.56	4,864,340.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,200	243.48	4,187,856.00
ARISTA NETWORKS INC	8,700	218.01	1,896,687.00
CISCO SYSTEMS	670,800	45.32	30,400,656.00
F5 NETWORKS INC	9,300	136.65	1,270,845.00
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	23.27	1,233,310.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,800	138.88	3,721,984.00
APPLE INC	689,980	349.72	241,299,805.60
DELL TECHNOLOGIES-C	38,300	48.92	1,873,636.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	202,000	9.82	1,983,640.00
HP INC	223,000	16.78	3,741,940.00
NETAPP INC	35,200	44.08	1,551,616.00
SEAGATE TECHNOLOGY	37,300	52.05	1,941,465.00
WESTERN DIGITAL CORP	47,600	44.39	2,112,964.00
AMPHENOL CORP-CL A	46,400	97.03	4,502,192.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	66.24	801,504.00
CDW CORPORATION	22,400	116.95	2,619,680.00
COGNEX CORP	27,800	56.85	1,580,430.00
CORNING INC	119,000	26.70	3,177,300.00
FLIR SYSTEMS INC	20,700	39.96	827,172.00
IPG PHOTONICS CORP	5,900	162.24	957,216.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	30,400	106.44	3,235,776.00
TE CONNECTIVITY LTD	52,400	80.70	4,228,680.00
TRIMBLE INC	38,800	43.00	1,668,400.00

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,400	264.41	2,221,044.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	185,600	54.23	10,065,088.00	
ANALOG DEVICES INC	58,100	120.18	6,982,458.00	
APPLIED MATERIALS	143,800	60.95	8,764,610.00	
BROADCOM INC	62,810	302.77	19,016,983.70	
INTEL CORP	673,600	59.62	40,160,032.00	
KLA CORP	24,400	193.10	4,711,640.00	
LAM RESEARCH	23,100	315.25	7,282,275.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	106,400	33.98	3,615,472.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,400	60.45	2,563,080.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	37,300	103.45	3,858,685.00	
MICRON TECHNOLOGY	174,000	50.83	8,844,420.00	
NVIDIA CORP	96,360	370.45	35,696,562.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	44,700	117.27	5,241,969.00	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	69,000	19.39	1,337,910.00	
QORVO INC	17,700	111.80	1,978,860.00	
QUALCOMM INC	181,000	88.81	16,074,610.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	27,200	127.35	3,463,920.00	
TERADYNE INC	27,400	82.75	2,267,350.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	146,800	124.88	18,333,118.00	
XILINX INC	39,900	95.48	3,809,652.00	
AT & T INC	1,129,500	30.31	34,235,145.00	
CENTURYLINK INC	147,000	10.15	1,492,050.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	651,300	56.16	36,577,008.00	
T-MOBILE US INC	67,830	106.90	7,251,027.00	
ALLIANT ENERGY CORP	37,600	47.99	1,804,424.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,200	79.71	6,153,612.00	
DUKE ENERGY CORP	116,300	82.11	9,549,393.00	
EDISON INTERNATIONAL	58,000	55.66	3,228,280.00	
ENERGY CORP	31,300	94.52	2,958,476.00	
EVERGY INC	35,900	59.35	2,130,665.00	
EVERSOURCE ENERGY	52,100	82.89	4,318,569.00	
EXELON CORPORATION	154,800	37.53	5,809,644.00	
FIRSTENERGY CORP	86,600	38.98	3,375,668.00	
NEXTERA ENERGY INC	77,200	242.21	18,698,612.00	



NRG ENERGY INC	40,500	34.08	1,380,240.00
OGE ENERGY CORP	32,500	30.54	992,550.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,000	73.50	1,249,500.00
PPL CORPORATION	121,800	26.00	3,166,800.00
SOUTHERN CO.	165,200	53.61	8,856,372.00
XCEL ENERGY INC	83,600	64.01	5,351,236.00
ATMOS ENERGY CORP	18,400	99.72	1,834,848.00
UGI CORP	30,900	32.18	994,362.00
AMEREN CORPORATION	39,100	69.80	2,729,180.00
CENTERPOINT ENERGY INC	75,400	17.79	1,341,366.00
CMS ENERGY CORP	45,600	57.93	2,641,608.00
CONSOLIDATED EDISON INC	52,500	71.44	3,750,600.00
DOMINION ENERGY INC	133,000	81.72	10,868,760.00
DTE ENERGY COMPANY	30,500	103.76	3,164,680.00
NISOURCE INC	58,200	22.97	1,336,854.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	81,000	48.71	3,945,510.00
SEMPRA ENERGY	46,400	117.25	5,440,400.00
WEC ENERGY GROUP INC	49,800	88.07	4,385,886.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,300	126.36	3,575,988.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	34,900	42.01	1,466,149.00
ALLY FINANCIAL INC	57,400	19.21	1,102,654.00
AMERICAN EXPRESS CO	109,000	100.94	11,002,460.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72,500	68.07	4,935,075.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	49,600	53.73	2,665,008.00
SYNCHRONY FINANCIAL	88,000	23.77	2,091,760.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,000	148.35	2,818,650.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,500	53.08	1,459,700.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	127,100	39.23	4,986,133.00
BLACKROCK INC	23,930	555.37	13,290,004.10
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	106,900	59.00	6,307,100.00
CARLYLE GROUP INC/THE	22,000	29.85	656,700.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	98.75	1,767,625.00
CME GROUP INC	56,500	175.52	9,916,880.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	48.43	1,695,050.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,920	303.62	1,797,430.40

FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	21.95	952,630.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	52,100	201.63	10,504,923.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	86,700	94.52	8,194,884.00	
INVESCO LTD	58,000	11.09	643,220.00	
KKR & CO INC-A	78,400	31.80	2,493,120.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,160	520.28	3,204,924.80	
MOODYS CORP	26,800	275.23	7,376,164.00	
MORGAN STANLEY	190,300	46.93	8,930,779.00	
MSCI INC	13,650	333.46	4,551,729.00	
NASDAQ INC	18,400	118.83	2,186,472.00	
NORTHERN TRUST CORP	32,100	82.66	2,653,386.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,600	73.66	1,443,736.00	
S&P GLOBAL INC	38,520	323.73	12,470,079.60	
SCHWAB(CHARLES)CORP	183,700	36.67	6,736,279.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	55.69	1,063,679.00	
STATE STREET CORP	56,200	65.40	3,675,480.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	36,600	128.61	4,707,126.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	41,200	39.51	1,627,812.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	13,000	64.42	837,460.00	
AES CORP	101,000	13.34	1,347,340.00	
VISTRA ENERGY CORP	70,000	19.83	1,388,100.00	
CERNER CORP	49,900	73.18	3,651,682.00	
TELADOC HEALTH INC	11,200	201.53	2,257,136.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	20,700	226.67	4,692,069.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	49,000	88.73	4,347,770.00	
AVANTOR INC	68,000	17.63	1,198,840.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	451.96	1,645,134.40	
ILLUMINA INC	23,390	368.77	8,625,530.30	
IQVIA HOLDINGS INC	30,600	136.08	4,164,048.00	
METTLER-TOLEDO INTL	3,880	795.24	3,085,531.20	
PERKINELMER INC	17,400	98.36	1,711,464.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	62,730	352.73	22,126,752.90	
WATERS CORP	9,500	190.37	1,808,515.00	
COSTAR GROUP INC	6,180	710.68	4,392,002.40	
EQUIFAX INC	19,500	167.90	3,274,050.00	

IHS MARKIT LTD	59,000	72.03	4,249,770.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	54,000	14.74	795,960.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	51.10	873,810.00
TRUNSION	29,000	87.64	2,541,560.00
VERISK ANALYTICS INC	24,100	164.18	3,956,858.50
CBRE GROUP INC	51,400	46.74	2,402,436.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	4.05	745,200.00
JONES LANG LASALLE INC	7,600	104.39	793,364.00
ALTICE USA INC-A	53,000	24.26	1,285,780.00
CABLE ONE INC	730	1,800.00	1,314,000.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,320	536.67	12,515,144.40
COMCAST CORP-CL A	717,700	39.10	28,062,070.00
DISCOVERY INC - A	24,500	22.15	542,675.00
DISCOVERY INC - C	57,000	20.14	1,147,980.00
DISH NETWORK CORP-A	38,400	35.45	1,361,280.00
FOX CORP-CLASS A	52,000	28.32	1,472,640.00
FOX CORP-CLASS B	25,400	27.82	706,628.00
INTERPUBLIC GROUP	58,000	17.06	989,480.00
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	128.61	514,440.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	16,700	130.35	2,176,845.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,000	22.73	1,454,720.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	23.16	555,960.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	25,800	35.27	909,966.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	35.69	460,401.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	11.86	652,300.00
OMNICOM GROUP	34,500	53.33	1,839,885.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	5.96	1,043,000.00
VIACOMCBS INC-CLASS B	88,000	23.69	2,084,720.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	120,900	76.58	9,258,522.00
DISNEY (WALT) CO	284,300	114.35	32,509,705.00
ELECTRONIC ARTS	46,100	130.19	6,001,759.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	34,000	33.06	1,124,040.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	23,000	46.51	1,069,730.00
NETFLIX INC	69,300	453.72	31,442,796.00
ROKU INC	14,200	128.50	1,824,700.00

	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	18,100	142.61	2,581,241.00	
	ALPHABET INC-CL A	47,260	1,424.64	67,328,486.40	
	ALPHABET INC-CL C	48,360	1,431.72	69,237,979.20	
	FACEBOOK INC-A	379,200	238.79	90,549,168.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	12,600	295.32	3,721,032.00	
	MATCH GROUP INC	8,400	95.73	804,132.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	58,000	23.21	1,346,180.00	
	SNAP INC-A	139,000	22.66	3,149,740.00	
	TWITTER INC	124,100	33.41	4,146,181.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	20,200	62.25	1,257,450.00	
小計	銘柄数：589			4,198,986,276.40	
				(448,325,764,731)	
	組入時価比率：68.3%			70.8%	
カナダドル	CAMECO CORP	69,000	14.21	980,490.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	187,000	23.33	4,362,710.00	
	CENOVUS ENERGY INC	156,000	6.18	964,080.00	
	ENBRIDGE INC	321,300	42.34	13,603,842.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	21.89	820,875.00	
	INTER PIPELINE LTD	60,000	12.35	741,000.00	
	KEYERA CORP	34,000	21.73	738,820.00	
	PARKLAND CORP	21,700	34.60	750,820.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	88,000	35.06	3,085,280.00	
	SUNCOR ENERGY INC	244,000	23.20	5,660,800.00	
	TC ENERGY CORP	146,800	59.33	8,709,644.00	
	NUTRIEN LTD	90,000	48.62	4,375,800.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	45.91	1,133,977.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	37,700	80.50	3,034,850.00	
	B2GOLD CORP	176,000	7.09	1,247,840.00	
	BARRICK GOLD	283,000	33.25	9,409,750.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	93,000	9.29	863,970.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	29,500	178.99	5,280,205.00	
	KINROSS GOLD CORP	198,000	8.69	1,720,620.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	44,100	52.05	2,295,405.00	
	LUNDIN MINING CORP	95,000	6.58	625,100.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	31,000	36.47	1,130,570.00	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	82,000	13.64	1,118,480.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	71,600	56.75	4,063,300.00	
YAMANA GOLD INC	163,000	6.86	1,118,180.00	
CAE INC	41,000	22.62	927,420.00	
WSP GLOBAL INC	17,700	81.90	1,449,630.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	18,800	54.10	1,017,080.00	
AIR CANADA	20,400	18.40	375,360.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	112,600	118.98	13,397,148.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,300	346.58	7,382,154.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,100	60.25	2,717,275.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	20.37	647,766.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	46,000	73.39	3,375,940.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	119.61	1,028,646.00	
DOLLARAMA INC	46,600	46.07	2,146,862.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	139,000	43.79	6,086,810.00	
EMPIRE CO LTD A	26,000	33.73	876,980.00	
LOBLAW COMPANIES	28,500	67.15	1,913,775.00	
METRO INC	39,600	56.71	2,245,716.00	
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	99.25	1,220,775.00	
SAPUTO INC	41,000	32.40	1,328,400.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	26.86	1,369,860.00	
CANOPY GROWTH CORP	33,000	23.64	780,120.00	
CRONOS GROUP INC	25,000	8.68	217,000.00	
BANK OF MONTREAL	102,000	75.99	7,750,980.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	189,900	57.03	10,829,997.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	69,600	93.49	6,506,904.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	52,300	61.97	3,241,031.00	
ROYAL BANK OF CANADA	223,700	92.36	20,660,932.00	
TORONTO DOMINION BANK	287,200	61.57	17,682,904.00	
ONEX CORPORATION	13,200	60.89	803,748.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,140	425.60	1,761,984.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	42,000	24.25	1,018,500.00	
IA FINANCIAL CORP INC	18,300	47.37	866,871.00	
INTACT FINANCIAL CORP	22,700	134.19	3,046,113.00	

	MANULIFE FINANCIAL CORP	303,000	18.69	5,663,070.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	86,950	23.73	2,063,323.50	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	92,300	49.96	4,611,308.00	
	CGI INC	38,400	86.61	3,325,824.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	16,400	1,204.74	19,757,736.00	
	BLACKBERRY LTD	71,000	6.99	496,290.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,200	1,471.80	4,709,760.00	
	OPEN TEXT CORP	41,700	58.04	2,420,268.00	
	BCE INC	25,600	57.96	1,483,776.00	
	TELUS CORP	58,600	23.72	1,389,992.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	54,500	56.65	3,087,425.00	
	EMERA INC	37,900	52.97	2,007,563.00	
	FORTIS INC	71,200	51.83	3,690,296.00	
	HYDRO ONE LTD	55,000	25.44	1,399,200.00	
	ALTAGAS LTD	42,000	16.06	674,520.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	85,000	18.36	1,560,600.00	
	ATCO LTD CL1	13,000	37.41	486,330.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	32.13	652,239.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	209,800	46.63	9,782,974.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	17.24	579,264.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	32.60	489,000.00	
	TMX GROUP LTD	9,500	130.29	1,237,755.00	
	THOMSON REUTERS CORP	27,800	92.05	2,558,990.00	
	QUEBECOR INC-CL B	27,000	29.96	808,920.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,000	23.06	1,775,620.00	
	小計銘柄数：81			279,223,132.50	
				(21,882,716,894)	
	組入時価比率：3.3%			3.5%	
ユーロ	TENARIS SA	71,000	6.18	439,348.00	
	ENI SPA	403,000	8.87	3,576,222.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	10.94	886,140.00	
	NESTE OYJ	66,800	35.43	2,366,724.00	
	OMV AG	25,200	30.32	764,064.00	
	REPSOL SA	220,484	8.29	1,829,576.23	
	REPSOL SA-RTS	220,484	0.46	101,422.64	

TOTAL SA	388,400	35.69	13,861,996.00
VOPAK	11,400	49.40	563,160.00
AIR LIQUIDE SA	75,100	128.10	9,620,310.00
AKZO NOBEL	30,800	80.34	2,474,472.00
ARKEMA	10,200	81.52	831,504.00
BASF SE	144,400	50.94	7,355,736.00
COVESTRO AG	26,900	33.95	913,255.00
EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	23.44	773,520.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	36.52	383,460.00
KONINKLIJKE DSM NV	27,300	121.70	3,322,410.00
LANXESS	12,000	48.17	578,040.00
SOLVAY SA	11,400	74.20	845,880.00
SYMRISE AG	21,000	99.68	2,093,280.00
UMICORE	31,000	42.86	1,328,660.00
CRH PLC	125,300	31.76	3,979,528.00
HEIDELBERGCEMENT AG	22,600	48.47	1,095,422.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	35,300	29.48	1,040,644.00
ARCELORMITTAL	108,000	9.32	1,006,776.00
THYSSENKRUPP AG	62,000	6.90	427,924.00
VOESTALPINE AG	20,000	19.59	391,900.00
STORA ENSO OYJ-R	97,000	11.19	1,085,915.00
UPM-KYMMENE OYJ	83,200	26.53	2,207,296.00
AIRBUS SE	91,800	68.86	6,321,348.00
DASSAULT AVIATION SA	330	813.00	268,290.00
LEONARDO SPA	64,000	6.43	411,520.00
MTU AERO ENGINES AG	8,400	162.75	1,367,100.00
SAFRAN SA	50,000	94.38	4,719,000.00
THALES SA	16,300	73.24	1,193,812.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	79,000	31.19	2,464,010.00
KINGSPAN GROUP PLC	24,500	57.70	1,413,650.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	40,394	23.75	959,357.50
BOUYGUES	34,800	28.61	995,628.00
EIFFAGE SA	12,100	82.08	993,168.00
FERROVIAL SA	78,084	25.10	1,959,908.40
HOCHTIEF AG	3,800	78.45	298,110.00

VINCI	80,800	84.74	6,846,992.00
LEGRAND SA	42,900	65.04	2,790,216.00
PRYSMIAN SPA	37,000	20.56	760,720.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	87,000	95.76	8,331,120.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	14.15	537,700.00
SIEMENS AG	120,600	103.82	12,520,692.00
ALSTOM	30,300	43.03	1,303,809.00
ANDRITZ AG	11,700	35.00	409,500.00
CNH INDUSTRIAL NV	154,000	6.23	960,036.00
GEA GROUP AG	24,200	28.92	699,864.00
KION GROUP AG	9,900	54.18	536,382.00
KNORR-BREMSE AG	7,100	91.96	652,916.00
KONE OYJ	54,000	61.66	3,329,640.00
METSO OYJ	16,200	30.14	488,268.00
WARTSILA OYJ	63,000	7.51	473,256.00
BRENNTAG AG	23,800	47.00	1,118,600.00
DEUTSCHE POST AG-REG	158,100	31.10	4,916,910.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	42,000	10.17	427,140.00
ADP	4,700	99.80	469,060.00
AENA SME SA	10,700	124.80	1,335,360.00
ATLANTIA SPA	79,000	14.59	1,152,610.00
FRAPORT AG	6,300	41.28	260,064.00
GETLINK	72,000	12.89	928,080.00
CONTINENTAL AG	17,500	85.92	1,503,600.00
FAURECIA	10,500	31.91	335,055.00
MICHELIN (CGDE)	26,700	88.76	2,369,892.00
PIRELLI & C. SPA	53,000	3.89	206,223.00
VALEO SA	37,300	21.52	802,696.00
BAYER MOTOREN WERK	52,100	56.93	2,966,053.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	44.08	449,616.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	135,800	36.76	4,992,008.00
FERRARI NV	20,000	151.70	3,034,000.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	170,000	8.45	1,437,010.00
PEUGEOT CITROEN	97,000	13.35	1,295,435.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25,400	51.66	1,312,164.00



RENAULT SA	28,100	21.13	593,753.00	
VOLKSWAGEN AG	5,100	142.70	727,770.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	28,900	130.68	3,776,652.00	
SEB SA	3,800	139.70	530,860.00	
ADIDAS AG	29,800	237.60	7,080,480.00	
ESSILORLUXOTTICA	45,300	117.70	5,331,810.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,010	739.20	3,703,392.00	
KERING SA	12,060	509.90	6,149,394.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	43,900	380.05	16,684,195.00	
MONCLER SPA	28,100	35.23	989,963.00	
PUMA SE	12,600	68.60	864,360.00	
ACCOR SA	32,000	25.49	815,680.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	15,939	123.50	1,968,466.50	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	30.08	463,232.00	
SODEXO	13,200	64.74	854,568.00	
DELIVERY HERO SE	20,900	90.26	1,886,434.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	18,900	86.54	1,635,606.00	
PROSUS NV	76,800	80.52	6,183,936.00	
ZALANDO SE	23,100	64.38	1,487,178.00	
INDITEX SA	174,000	24.95	4,341,300.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	95,000	14.10	1,339,975.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	33.01	273,983.00	
COLRUYT SA	8,700	49.69	432,303.00	
JERONIMO MARTINS	38,000	15.81	600,970.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	171,000	23.51	4,020,210.00	
METRO AG	25,000	8.59	214,850.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	120,100	45.81	5,502,381.50	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	91,000	7.71	701,792.00	
HEINEKEN HOLDING NV	17,500	77.05	1,348,375.00	
HEINEKEN NV	40,400	86.60	3,498,640.00	
PERNOD RICARD SA	33,500	142.70	4,780,450.00	
REMY COINTREAU	4,000	126.00	504,000.00	
DANONE	97,000	65.68	6,370,960.00	
KERRY GROUP PLC-A	24,500	111.00	2,719,500.00	
HENKEL AG & CO KGAA	16,300	75.65	1,233,095.00	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,400	83.76	2,295,024.00	
BEIERSDORF AG	16,000	101.25	1,620,000.00	
LOREAL-ORD	39,840	279.20	11,123,328.00	
UNILEVER NV	229,200	50.50	11,574,600.00	
BIOMERIEUX	6,900	121.90	841,110.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	91.25	547,500.00	
DIASORIN SPA	4,000	167.40	669,600.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	142,600	41.88	5,972,088.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,800	292.60	1,697,080.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,900	43.95	1,050,524.50	
FRESENIUS MEDICAL CARE	33,300	75.90	2,527,470.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	67,300	45.32	3,050,036.00	
ORPEA	8,700	109.70	954,390.00	
GALAPAGOS NV	7,000	186.55	1,305,850.00	
GRIFOLS SA	46,800	28.04	1,312,272.00	
BAYER AG-REG	154,800	69.42	10,746,216.00	
IPSEN	5,500	74.30	408,650.00	
MERCK KGAA	20,000	101.65	2,033,000.00	
ORION OYJ	16,500	45.75	754,875.00	
RECORDATI SPA	16,800	45.39	762,552.00	
SANOFI	178,100	94.12	16,762,772.00	
UCB SA	19,300	101.10	1,951,230.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	7.73	541,240.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,056,000	3.10	3,279,936.00	
BANCO SANTANDER SA	2,610,000	2.15	5,619,330.00	
BANKINTER S.A.	94,000	4.34	408,336.00	
BNP PARIBAS	176,000	35.30	6,212,800.00	
CAIXABANK	590,000	1.91	1,130,735.00	
COMMERZBANK AG	158,000	3.85	608,616.00	
CREDIT AGRICOLE SA	184,000	8.06	1,484,144.00	
ERSTE GROUP BANK AG	42,000	21.70	911,400.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	102,000	12.10	1,234,710.00	
ING GROEP NV	617,000	6.20	3,829,719.00	
INTESA SANPAOLO	2,320,000	1.68	3,908,736.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	

KBC GROEP NV	40,600	51.12	2,075,472.00
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	7.02	751,354.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	17.25	346,725.00
SOCIETE GENERALE	127,000	14.37	1,825,498.00
UNICREDIT SPA	337,000	8.25	2,781,935.00
EURAZEO SE	5,953	47.82	284,672.46
EXOR NV	17,200	51.12	879,264.00
GROUPE BRUXELLES LAM	17,794	72.40	1,288,285.60
SOFINA SA	2,300	237.50	546,250.00
WENDEL	4,300	84.75	364,425.00
AEGON NV	293,000	2.55	748,029.00
AGEAS	28,900	31.71	916,419.00
ALLIANZ SE-REG	65,500	181.40	11,881,700.00
ASSICURAZIONI GENERALI	175,000	13.61	2,382,625.00
AXA	308,000	18.48	5,691,840.00
CNP ASSURANCES	28,000	9.55	267,540.00
HANNOVER RUECK SE	9,600	154.10	1,479,360.00
MAPFRE SA	163,000	1.77	289,325.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	22,800	229.00	5,221,200.00
NN GROUP NV	47,000	28.85	1,355,950.00
POSTE ITALIANE SPA	88,000	8.22	723,360.00
SAMPO OYJ-A SHS	76,400	30.06	2,296,584.00
SCOR SE	23,200	23.66	548,912.00
ADYEN NV	2,850	1,276.00	3,636,600.00
AMADEUS IT GROUP SA	67,000	50.34	3,372,780.00
ATOS SE	15,300	75.00	1,147,500.00
CAPGEMINI SA	25,900	99.60	2,579,640.00
EDENRED	38,200	38.77	1,481,014.00
NEXI SPA	60,000	15.05	903,000.00
WIRECARD AG	19,000	25.82	490,580.00
WORLDLINE SA	22,600	70.62	1,596,012.00
DASSAULT SYSTEMES SA	20,900	153.20	3,201,880.00
NEMETSCHEK SE	9,200	62.90	578,680.00
SAP SE	164,300	123.48	20,287,764.00
TEAMVIEWER AG	20,600	47.44	977,264.00

NOKIA OYJ	878,000	3.90	3,431,663.00
INGENICO GROUP	9,500	131.25	1,246,875.00
ASML HOLDING NV	67,250	327.20	22,004,200.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	199,000	20.47	4,073,530.00
STMICROELECTRONICS NV	101,000	24.01	2,425,010.00
CELLNEX TELECOM SA	38,400	52.94	2,032,896.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	530,000	15.35	8,138,150.00
ELISA OYJ	22,100	52.76	1,165,996.00
ILIAD SA	2,400	173.90	417,360.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	38,000	9.10	345,800.00
KONINKLIJKE KPN NV	560,000	2.35	1,318,800.00
ORANGE SA	310,000	10.56	3,275,150.00
PROXIMUS	26,000	18.99	493,740.00
TELECOM ITALIA SPA	1,170,000	0.38	444,600.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.39	346,280.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.70	405,300.00
TELEFONICA SA	732,000	4.42	3,235,440.00
TELEFONICA SA-RTS	732,000	0.18	134,395.20
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	37.22	625,296.00
ELECTRICITE DE FRANCE	94,000	8.28	778,508.00
ELIA GROUP SA/NV	4,800	96.20	461,760.00
ENDESA S.A.	50,000	22.42	1,121,000.00
ENEL SPA	1,291,000	7.60	9,811,600.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	417,000	4.24	1,770,165.00
FORTUM OYJ	72,000	17.65	1,271,160.00
IBERDROLA SA	917,000	10.19	9,344,230.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	17.07	1,195,250.00
TERNA SPA	222,000	6.55	1,454,988.00
VERBUND AG	11,000	40.74	448,140.00
ENAGAS SA	39,000	21.93	855,270.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	49,000	16.93	829,570.00
SNAM SPA	320,000	4.62	1,481,280.00
E.ON SE	355,000	10.15	3,605,025.00
ENGIE	290,000	11.25	3,262,500.00
RWE AG	93,100	31.07	2,892,617.00

	SUEZ	52,000	10.51	546,780.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	87,000	20.70	1,800,900.00	
	AMUNDI SA	10,000	69.40	694,000.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	314,000	8.34	2,619,388.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	30,400	158.40	4,815,360.00	
	NATIXIS	158,000	2.17	343,018.00	
	UNIPER SE	31,100	28.92	899,412.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,950	582.80	1,136,460.00	
	QIAGEN NV	35,400	38.11	1,349,094.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,600	224.80	1,034,080.00	
	BUREAU VERITAS SA	47,000	19.89	935,065.00	
	RANDSTAD NV	18,400	39.51	726,984.00	
	TELEPERFORMANCE	9,000	215.30	1,937,700.00	
	WOLTERS KLUWER	43,800	68.30	2,991,540.00	
	AROUNDTOWN SA	185,000	5.45	1,008,250.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	52,500	39.62	2,080,050.00	
	LEG IMMOBILIEN AG	11,000	121.26	1,333,860.00	
	VONOVIA SE	82,400	54.60	4,499,040.00	
	ALTICE EUROPE N.V.	99,000	3.86	382,437.00	
	JC DECAUX SA	15,000	17.48	262,200.00	
	PUBLICIS GROUPE	32,400	29.25	947,700.00	
	SES FDR	56,000	6.22	348,768.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	37.70	252,590.00	
	BOLLORE	138,000	2.86	395,508.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	68.98	993,312.00	
	VIVENDI SA	130,000	23.03	2,993,900.00	
	SCOUT24 AG	17,100	70.20	1,200,420.00	
小計	銘柄数：244			590,073,356.53	
				(70,437,056,568)	
	組入時価比率：10.7%			11.1%	
英債券	BP PLC	3,213,000	3.21	10,328,188.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	653,000	13.75	8,983,974.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	588,000	13.18	7,751,016.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	21,500	52.40	1,126,600.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	21.33	644,166.00	

ANGLO AMERICAN PLC	191,000	18.31	3,497,210.00
ANTOFAGASTA PLC	59,000	8.92	526,398.00
BHP GROUP PLC	337,000	16.13	5,436,484.00
EVRAZ PLC	76,000	2.94	224,048.00
GLENCORE PLC	1,590,000	1.71	2,734,482.00
RIO TINTO PLC-REG	175,800	44.67	7,852,986.00
MONDI PLC	75,000	15.53	1,164,750.00
BAE SYSTEMS PLC	502,000	5.06	2,540,120.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	277,000	3.34	925,734.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	730,000	1.19	874,175.00
DCC PLC	16,000	68.82	1,101,120.00
SMITHS GROUP PLC	61,000	13.23	807,030.00
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,600	99.50	1,154,200.00
ASHTED GROUP PLC	69,200	27.36	1,893,312.00
BUNZLE	56,000	21.02	1,177,120.00
FERGUSON PLC	36,600	65.66	2,403,156.00
RENTOKIL INTIAL PLC	285,000	5.04	1,436,970.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	159,000	5.08	808,038.00
PERSIMMON PLC	48,000	23.32	1,119,360.00
TAYLOR WIMPEY PLC	500,000	1.48	744,750.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	19,500	43.04	839,280.00
BURBERRY GROUP PLC	66,000	15.64	1,032,570.00
COMPASS GROUP PLC	277,000	11.79	3,265,830.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8,561	112.80	965,680.80
GVC HOLDINGS PLC	87,000	7.62	662,940.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	28,500	39.95	1,138,575.00
WHITBREAD PLC	31,650	23.65	748,522.50
OCADO GROUP PLC	72,000	19.54	1,406,880.00
NEXT PLC	22,100	52.42	1,158,482.00
JD SPORTS FASHION PLC	76,000	6.47	491,720.00
KINGFISHER PLC	308,000	2.08	643,412.00
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	1.90	704,480.00
SAINSBURY	299,000	2.00	598,897.00
TESCO PLC	1,520,000	2.27	3,456,480.00
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	21.03	715,020.00

DIAGEO PLC	366,900	29.00	10,640,100.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	54,100	20.03	1,083,623.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	363,700	31.70	11,531,108.50
IMPERIAL BRANDS PLC	149,000	15.54	2,315,460.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	112,700	71.80	8,091,860.00
UNILEVER PLC	183,200	46.32	8,485,824.00
SMITH & NEPHEW PLC	137,000	16.34	2,239,265.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.24	3,192.00
ASTRAZENECA PLC	207,300	84.89	17,597,697.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	788,000	16.57	13,057,160.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	24,900	25.05	623,745.00
BARCLAYS PLC	2,740,000	1.16	3,193,744.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,207,000	3.91	12,552,198.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,050,000	0.32	3,561,967.50
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	770,000	1.21	937,090.00
STANDARD CHARTERED PLC	438,000	4.27	1,870,260.00
M&G PLC	440,000	1.60	705,980.00
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	23.19	714,252.00
AVIVA PLC	604,000	2.78	1,683,348.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	2.79	611,229.00
LEGAL & GENERAL	940,000	2.21	2,077,400.00
PRUDENTIAL PLC	410,000	12.07	4,950,750.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	162,000	4.18	677,808.00
AVEVA GROUP PLC	11,200	41.61	466,032.00
SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	6.91	1,210,650.00
HALMA PLC	59,000	23.04	1,359,360.00
BT GROUP PLC	1,370,000	1.18	1,624,135.00
VODAFONE GROUP PLC	4,190,000	1.27	5,353,144.00
SSE PLC	165,000	13.87	2,289,375.00
NATIONAL GRID PLC	547,000	9.73	5,324,498.00
SEVERN TRENT PLC	37,000	25.68	950,160.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	106,000	9.78	1,036,892.00
3I GROUP PLC	155,000	8.44	1,308,510.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	52,000	16.65	866,060.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	49,300	82.38	4,061,334.00

	SCHRODERS PLC	19,700	29.90	589,030.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	81,000	9.40	761,400.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.55	936,228.00	
	EXPERIAN PLC	145,200	28.21	4,096,092.00	
	INTERTEK GROUP PLC	25,600	54.06	1,383,936.00	
	RELX PLC	308,000	19.15	5,898,200.00	
	INFORMA PLC	248,000	4.95	1,228,344.00	
	ITV PLC	640,000	0.78	500,736.00	
	PEARSON	126,000	5.86	738,360.00	
	WPP PLC	200,000	6.60	1,320,400.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,000	5.45	780,494.00	
小計	銘柄数：86			238,372,587.80	
				(31,412,739,620)	
	組入時価比率：4.8%			5.0%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	32,000	18.52	592,640.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	714.50	871,690.00	
	GIVAUDAN-REG	1,458	3,476.00	5,068,008.00	
	SIKA AG-REG	22,000	187.85	4,132,700.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	81,200	41.37	3,359,244.00	
	GEBERIT AG-REG	5,960	474.90	2,830,404.00	
	ABB LTD	294,000	20.64	6,068,160.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	223.80	671,400.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,700	227.60	1,524,920.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	154.05	1,294,020.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	81,400	61.62	5,015,868.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	194.40	913,680.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	37.64	278,536.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,863.00	856,980.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	177	7,630.00	1,350,510.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	16	80,800.00	1,292,800.00	
	NESTLE SA-REG	468,800	107.50	50,396,000.00	
	ALCON INC	76,500	58.38	4,466,070.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	8,858	202.80	1,796,402.40	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,600	787.20	1,259,520.00	
	NOVARTIS AG-REG	338,100	86.84	29,360,604.00	
		110,640	343.30	37,982,712.00	



	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)				
	VIFOR PHARMA AG	7,600	148.80	1,130,880.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	5,400	92.50	499,500.00	
	BALOISE HOLDING AG	7,400	141.90	1,050,060.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,190	351.00	1,821,690.00	
	SWISS RE LTD	46,200	73.64	3,402,168.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	23,520	331.90	7,806,288.00	
	TEMENOS AG-REG	10,400	145.65	1,514,760.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	27,100	58.54	1,586,434.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,030	503.60	2,029,508.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	385,000	9.76	3,759,910.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	35,800	40.55	1,451,690.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,990	832.80	2,490,072.00	
	UBS GROUP AG	582,000	10.41	6,061,530.00	
	LONZA AG-REG	11,880	493.00	5,856,840.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	24,900	45.17	1,124,733.00	
	SGS SA-REG	980	2,330.00	2,283,400.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	11,400	91.00	1,037,400.00	
小計	銘柄数：39			206,289,731.40	
				(23,129,204,684)	
	組入時価比率：3.5%			3.7%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	28,800	229.30	6,603,840.00	
	BOLIDEN AB	44,000	205.60	9,046,400.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	100,000	117.45	11,745,000.00	
	ASSA ABLOY AB-B	159,000	192.95	30,679,050.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	51,000	205.50	10,480,500.00	
	SKANSKA AB-B SHS	51,000	189.05	9,641,550.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	170.00	4,420,000.00	
	ALFA LAVAL AB	51,000	202.00	10,302,000.00	
	ATLAS COPCO AB-A	107,600	394.00	42,394,400.00	
	ATLAS COPCO AB-B	62,700	344.00	21,568,800.00	
	EPIROC AB - A	103,000	116.60	12,009,800.00	
	EPIROC AB - B	58,000	114.25	6,626,500.00	
	SANDVIK AB	178,000	160.45	28,560,100.00	
	SKF AB-B SHARES	58,000	173.30	10,051,400.00	

	VOLVO AB-B SHS	234,000	147.30	34,468,200.00	
	SECURITAS AB-B SHS	55,000	123.10	6,770,500.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	158.20	5,378,800.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	58,000	74.06	4,295,480.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	21,000	588.40	12,356,400.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	127,000	144.15	18,307,050.00	
	ICA GRUPPEN AB	13,800	429.50	5,927,100.00	
	SWEDISH MATCH AB	26,000	639.80	16,634,800.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	97,400	300.50	29,268,700.00	
	NORDEA BANK ABP	515,000	66.85	34,427,750.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	250,000	79.06	19,765,000.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	243,000	91.74	22,292,820.00	
	SWEDBANK AB	148,000	120.34	17,810,320.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	216.80	5,420,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	71,500	503.60	36,007,400.00	
	KINNEVIK AB - B	39,000	247.70	9,660,300.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	430.40	5,423,040.00	
	ERICSSON LM-B	463,000	86.08	39,855,040.00	
	HEXAGON AB-B SHS	42,300	544.00	23,011,200.00	
	TELIA CO AB	381,000	33.80	12,877,800.00	
	TELE 2 AB-B SHS	78,000	123.80	9,656,400.00	
	EQT AB	41,000	162.20	6,650,200.00	
小計	銘柄数：36			590,393,640.00	
				(6,659,640,259)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	158,000	141.65	22,380,700.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	365.00	10,804,000.00	
	NORSK HYDRO	218,000	26.80	5,842,400.00	
	MOWI ASA	69,000	181.35	12,513,150.00	
	ORKLA ASA	115,000	85.24	9,802,600.00	
	DNB ASA	145,000	130.85	18,973,250.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	179.40	5,561,400.00	
	TELENOR ASA	116,000	146.20	16,959,200.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	233.20	3,008,280.00	
小計	銘柄数：9			105,844,980.00	

				(1,169,587,029)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	16,700	682.80	11,402,760.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	383.30	12,917,210.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	31,600	663.60	20,969,760.00	
	DSV PANALPINA A S	34,000	777.00	26,418,000.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	460	7,410.00	3,408,600.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	8,008.00	8,328,320.00	
	PANDORA A/S	16,000	366.20	5,859,200.00	
	CARLSBERG B	17,300	890.40	15,403,920.00	
	AMBU A/S-B	24,000	229.60	5,510,400.00	
	COLOPLAST-B	19,300	1,073.00	20,708,900.00	
	DEMANT A/S	16,000	191.90	3,070,400.00	
	GN STORE NORD A/S	19,000	370.20	7,033,800.00	
	GENMAB A/S	10,000	2,098.00	20,980,000.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	253.30	2,659,650.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	279,500	449.30	125,579,350.00	
	DANSKE BANK AS	109,000	89.22	9,724,980.00	
	TRYG A/S	19,900	184.90	3,679,510.00	
	ORSTED A/S	30,000	753.80	22,614,000.00	
小計	銘柄数：18			326,268,760.00	
				(5,223,562,847)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	28.40	1,136,000.00	
	OIL SEARCH LTD	280,000	3.47	971,600.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	265,000	6.13	1,624,450.00	
	SANTOS LTD.	265,000	5.50	1,457,500.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	19.50	331,500.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	152,000	21.88	3,325,760.00	
	ORICA LTD	59,000	17.02	1,004,180.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	67,000	26.70	1,788,900.00	
	BHP GROUP LIMITED	462,000	35.01	16,174,620.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	88,000	12.00	1,056,000.00	
	EVOLUTION MINING LTD	272,000	5.25	1,428,000.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	273,000	13.79	3,764,670.00	

NEWCREST MINING	125,000	29.85	3,731,250.00
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	124,000	13.03	1,615,720.00
RIO TINTO LTD	59,600	96.28	5,738,288.00
SOUTH32 LTD	780,000	1.99	1,556,100.00
CIMIC GROUP LTD	18,000	24.98	449,640.00
BRAMBLES LTD	251,000	11.01	2,763,510.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	108,000	4.37	471,960.00
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	4.79	1,460,950.00
SYDNEY AIRPORT	168,000	6.05	1,016,400.00
TRANSURBAN GROUP	434,000	15.16	6,579,440.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	88,000	26.88	2,365,440.00
CROWN RESORTS LTD	55,000	10.44	574,200.00
TABCORP HOLDINGS	340,000	3.43	1,166,200.00
WESFARMERS LIMITED	181,000	43.14	7,808,340.00
COLES GROUP LTD	213,000	16.68	3,552,840.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	201,000	36.55	7,346,550.00
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	9.32	717,640.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	10.69	1,186,590.00
COCHLEAR LTD	10,300	194.66	2,004,998.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29,500	65.97	1,946,115.00
SONIC HEALTHCARE LTD	69,000	28.88	1,992,720.00
CSL LIMITED	71,600	288.25	20,638,700.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	453,000	18.75	8,493,750.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	280,800	68.68	19,285,344.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	500,000	18.67	9,335,000.00
WESTPAC BANKING CORP	563,000	18.17	10,229,710.00
AMP LIMITED	530,000	1.75	930,150.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	361,000	5.99	2,162,390.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	3.07	1,381,500.00
QBE INSURANCE	241,000	9.05	2,181,050.00
SUNCORP GROUP LTD	190,000	9.51	1,806,900.00
AFTERPAY LTD	35,800	58.69	2,101,102.00
COMPUTERSHARE LTD	76,000	13.20	1,003,200.00
WISETECH GLOBAL LTD	21,000	23.40	491,400.00
TELSTRA CORP LTD	650,000	3.19	2,073,500.00

	TPG TELECOM LTD	52,000	9.09	472,680.00	
	AUSNET SERVICES	330,000	1.70	562,650.00	
	APA GROUP	180,000	11.54	2,077,200.00	
	AGL ENERGY LTD	105,000	17.25	1,811,250.00	
	ASX LTD	30,700	85.88	2,636,516.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	53,000	121.53	6,441,090.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	57.54	1,104,768.00	
	REA GROUP LTD	8,800	110.41	971,608.00	
	SEEK LTD	48,000	21.69	1,041,120.00	
小計	銘柄数：56			189,340,649.00	
				(13,795,359,686)	
	組入時価比率：2.1%			2.2%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	193,000	6.81	1,314,330.00	
	A2 MILK CO LTD	117,000	20.33	2,378,610.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	95,000	28.71	2,727,450.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	13.50	783,000.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.31	1,324,705.00	
	MERCURY NZ LTD	100,000	4.82	482,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	5.03	1,011,030.00	
小計	銘柄数：7			10,021,125.00	
				(685,645,372)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	425,040	51.80	22,017,072.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	7.03	1,550,115.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	212,000	78.10	16,557,200.00	
	MTR CORP	243,000	40.15	9,756,450.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	335,000	54.35	18,207,250.00	
	SANDS CHINA LTD	384,000	31.95	12,268,800.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	9.17	2,475,900.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	14.20	3,237,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	290,000	23.20	6,728,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,440,000	6.91	9,950,400.00	
	BANK OF EAST ASIA	220,060	18.34	4,035,900.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	564,000	24.50	13,818,000.00	

	HANG SENG BANK	119,000	135.30	16,100,700.00	
	AIA GROUP LTD	1,909,000	71.80	137,066,200.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	85.85	4,120,800.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	11.34	6,799,464.00	
	PCCW LTD	750,000	4.45	3,337,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	42.85	4,584,950.00	
	CLP HLDGS	265,000	77.50	20,537,500.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	44.10	9,922,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,640,365	12.22	20,045,260.30	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	188,100	300.40	56,505,240.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	409,040	48.00	19,633,920.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	17.90	5,549,000.00	
	HENDERSON LAND	229,443	30.95	7,101,260.85	
	KERRY PROPERTIES	114,000	21.05	2,399,700.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	939,666	9.59	9,011,396.94	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	10.02	4,809,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	207,000	103.20	21,362,400.00	
	SWIRE PACIFIC-A	75,000	46.25	3,468,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	20.50	3,546,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	154,000	39.10	6,021,400.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	134,000	61.30	8,214,200.00	
小計	銘柄数：33			490,740,929.49	
				(6,762,410,008)	
	組入時価比率：1.0%				1.1%
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.36	836,640.00	
	KEPPEL CORP.	232,000	6.09	1,412,880.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	440,000	0.96	424,600.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	192,600	4.00	770,400.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	850,000	0.77	658,750.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	21.00	294,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	289,000	3.82	1,103,980.00	
	DBS GROUP HLDGS	284,000	21.16	6,009,440.00	
	OCBC-ORD	524,000	9.10	4,768,400.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	187,000	20.78	3,885,860.00	

	VENTURE CORP LTD	45,000	16.28	732,600.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,290,000	2.52	3,250,800.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	8.29	1,069,410.00	
	CAPITALAND LIMITED	430,000	2.93	1,259,900.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	8.50	595,000.00	
	UOL GROUP LIMITED	85,000	7.09	602,650.00	
	小計 銘柄数：16			27,675,310.00	
	組入時価比率：0.3%			(2,113,840,177)	0.3%
新シケル	ICL GROUP LTD	125,000	10.83	1,353,750.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	484.50	1,744,200.00	
	BANK HAPOALIM BM	183,000	20.79	3,804,570.00	
	BANK LEUMI LE- ISRAEL	238,000	18.56	4,417,280.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	11.20	1,926,400.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	68.32	1,571,360.00	
	NICE LTD	10,100	659.50	6,660,950.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	168.80	1,097,200.00	
	小計 銘柄数：8			22,575,710.00	
	組入時価比率：0.1%			(697,815,196)	0.1%
合計				632,295,343,071	(632,295,343,071)

(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22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	1,031,200.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,500	3,233,880.00	
		AMERICAN TOWER CORP	70,200	18,645,120.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	237,000	1,585,530.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,900	3,396,471.00	

BOSTON PROPERTIES	22,600	2,051,176.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	1,496,160.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	66,000	11,249,700.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	41,900	5,859,715.00	
DUKE REALTY CORP	56,600	2,014,960.00	
EQUINIX INC	13,540	9,632,762.20	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,500	1,703,420.00	
EQUITY RESIDENTIAL	59,900	3,568,842.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,700	2,501,446.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	1,924,479.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	940,725.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	81,000	2,131,920.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	1,272,030.00	
INVITATION HOMES INC	85,000	2,366,400.00	
IRON MOUNTAIN INC	43,100	1,135,254.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,597,750.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,600	2,018,368.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	27,900	999,936.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	1,078,940.00	
PROLOGIS INC	117,000	10,748,790.00	
PUBLIC STORAGE	24,500	4,669,455.00	
REALTY INCOME CORP	52,400	3,224,172.00	
REGENCY CENTERS CORP	26,200	1,169,437.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	17,770	5,371,871.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	3,215,048.00	
SUN COMMUNITIES INC	14,300	2,035,748.00	
UDR INC	46,300	1,748,288.00	
VENTAS INC	57,400	2,054,920.00	
VEREIT INC	160,000	1,084,800.00	
VICI PROPERTIES INC	76,000	1,708,480.00	
VORNADO REALTY TRUST	27,000	1,057,050.00	
WELLTOWER INC	63,100	3,218,100.00	
WEYERHAEUSER CO	115,000	2,610,500.00	
WP CAREY INC	27,400	1,889,504.00	
小計	銘柄数 : 39	2,129,510	129,242,347.20



			(13,799,205,410)	
	組入時価比率：2.1%		84.1%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	742,318.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	229,920.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	347,380.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	228,360.00	
小計	銘柄数：4	63,900	1,547,978.00	(121,315,035)
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	COVIVIO	8,500	577,150.00	
	GECINA SA	7,100	810,110.00	
	ICADE	5,200	329,420.00	
	KLEPIERRE	32,300	569,287.50	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,400	1,181,280.00	
小計	銘柄数：5	74,500	3,467,247.50	(413,885,334)
	組入時価比率：0.1%		2.5%	
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	518,656.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	672,438.00	
	SEGRO PLC	176,000	1,549,504.00	
小計	銘柄数：3	415,000	2,740,598.00	(361,156,004)
	組入時価比率：0.1%		2.2%	
豪ドル	DEXUS	171,000	1,718,550.00	
	GOODMAN GROUP	254,000	3,873,500.00	
	GPT GROUP	330,000	1,475,100.00	
	LENDLEASE GROUP	111,000	1,436,340.00	
	MIRVAC GROUP	660,000	1,544,400.00	
	SCENTRE GROUP	790,000	1,745,900.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	350,000	1,267,000.00	
	VICINITY CENTRES	470,000	712,050.00	
小計	銘柄数：8	3,136,000	13,772,840.00	(1,003,489,122)
	組入時価比率：0.2%		6.1%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,872,800.00	

小計	LINK REIT	330,000	21,681,000.00
	銘柄数：2	800,000	25,553,800.00
	組入時価比率：0.1%		(352,131,364) 2.1%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	440,800	1,375,296.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	439,972	761,151.56
	CAPITALAND MALL TRUST	390,000	791,700.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	747,400.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	420,000	814,800.00
	SUNTEC REIT	300,000	432,000.00
	小計	銘柄数：6	2,360,772
	組入時価比率：0.1%		(375,968,906) 2.3%
合計			16,427,151,175 (16,427,151,175)

(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22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	7,684,439,309	-	7,708,395,023	23,955,714
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	456,732,755	-	454,960,000	1,772,755
米ドル	379,651,555	-	378,998,000	653,555
ユーロ	30,091,950	-	29,842,500	249,450
英ポンド	46,989,250	-	46,119,500	869,750
売建	344,671,600	-	343,935,000	736,600
米ドル	278,025,800	-	277,576,000	449,800
ユーロ	35,956,200	-	35,811,000	145,200

シンガポールドル	30,689,600	-	30,548,000	141,600
合計	-	-	-	22,919,559

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,056,615,660
コール・ローン	46,547,774
株式	36,768,207,231
投資信託受益証券	1,494,697,466
投資証券	36,001,813
派生商品評価勘定	13,247,536
未収入金	2,357,091
未収配当金	100,369,436
差入委託証拠金	479,824,645
流動資産合計	39,997,868,652
資産合計	39,997,868,652
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,948,592
未払金	67,235,167
未払解約金	6,055,346
未払利息	55
その他未払費用	1,821,500
流動負債合計	87,060,660
負債合計	87,060,660

(2020年 6月22日現在)

純資産の部	
元本等	
元本	33,700,514,136
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,210,293,856
元本等合計	39,910,807,992
純資産合計	39,910,807,992
負債純資産合計	39,997,868,652

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 6月22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	1,1843円
(10,000口当たり純資産額)	(11,843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25日 至 2020年 6月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 6月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

### 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

### 投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

### 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

### 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月22日現在		2019年 6月25日
期首		2019年 6月25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		30,998,359,536円
同期中における追加設定元本額		7,580,875,598円
同期中における一部解約元本額		4,878,720,998円
期末元本額		33,700,514,136円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		29,311,940円
野村資産設計ファンド2020		32,999,864円
野村資産設計ファンド2025		54,689,558円
野村資産設計ファンド2030		67,480,419円
野村資産設計ファンド2035		52,250,484円
野村資産設計ファンド2040		108,819,684円
野村資産設計ファンド2045		16,625,071円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,673,397,458円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		322,471,219円
野村資産設計ファンド2050		26,949,751円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		9,003,956円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		4,188,704円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		3,319,110円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		2,112,648円
インデックス・ブレンド(タイプ )		1,284,998円
インデックス・ブレンド(タイプ )		1,561,259円
インデックス・ブレンド(タイプ )		8,326,335円
インデックス・ブレンド(タイプ )		2,675,437円
インデックス・ブレンド(タイプ )		9,273,081円
野村つみたて外国株投信		1,809,139,338円
野村外国株(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)		573,234,031円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)		1,328,433,620円
世界6資産分散ファンド		175,441,502円

野村資産設計ファンド2060	10,005,192円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIEマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)運動型上場投信	507,023,069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)	11,865,740円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)	442,688,085円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	106,995円
野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)	24,397,709,888円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	6,491,750円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	4,891,370円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	4,624,512円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,118,068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22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	12,600	11.31	142,506.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	57,700	0.66	38,428.20	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	25,390	78.50	1,993,115.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	5,790	151.90	879,501.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	361,800	5.57	2,015,226.00	
		ROSNEFT OJSC - GDR	72,800	5.35	389,916.80	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	85,200	5.57	474,564.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	14,000	50.00	700,000.00	
		YPF S.A. -SPONSORED ADR	10,600	5.57	59,042.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	12.96	90,849.60	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	7,400	26.54	196,396.00	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	9,600	8.65	83,040.00	
		MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	10,700	7.41	79,287.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	7,370	20.04	147,694.80	
		PJSC ALROSA	176,000	0.92	162,615.20	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	38,300	27.20	1,041,760.00	
		POLYUS PJSC-REG S-GDR	3,960	79.15	313,434.00	
SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	12.50	197,500.00			

SOUTHERN COPPER CORP	6,300	37.80	238,140.00
BEST INC - ADR	8,600	4.86	41,796.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	24,100	38.64	931,224.00
DP WORLD PLC	11,000	16.23	178,530.00
NIO INC ADR	56,000	7.34	411,040.00
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	8,800	37.40	329,120.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	21,500	51.31	1,103,165.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	116,350	220.64	25,671,464.00
BAOZUN INC-SPN ADR	2,300	40.52	93,196.00
JD.COM INC-ADR	52,690	58.64	3,089,741.60
PINDUODUO INC ADR	15,500	87.58	1,357,490.00
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	28,300	26.00	735,800.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	25,500	21.19	540,345.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	25,900	12.59	326,081.00
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	32.62	277,270.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	15.05	60,200.00
ZAI LAB LTD - ADR	3,370	80.85	272,464.50
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD - ADR	3,890	23.61	91,842.90
BANCO DE CHILE-ADR	14,300	18.45	263,835.00
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	8,400	17.17	144,228.00
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	7,330	27.40	200,842.00
CREDICORP LTD	4,350	147.93	643,495.50
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	673,300	2.97	2,005,188.39
STATE BANK OF INDIA-GDR	11,070	24.20	267,894.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	0.99	87,011.10
GDS HOLDINGS LTD-ADR	4,340	75.16	326,194.40
GLOBANT SA	1,850	143.76	265,956.00
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	5,300	9.48	50,244.00
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	9.19	263,293.50
ENEL AMERICAS S.A-ADR	38,500	7.57	291,445.00
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	3.69	158,301.00
INTER RAO UES PJSC	2,280,000	0.07	162,108.00
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	1.66	141,737.35
NOAH HLDS LTD ADR	1,500	25.48	38,220.00
GSX TECHEDU INC- ADR	5,000	57.81	289,050.00



	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	8,600	136.90	1,177,340.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	23,280	67.05	1,560,924.00	
	51JOB INC-ADR	2,210	71.14	157,219.40	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.77	68,277.79	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	6,300	44.72	281,736.00	
	HUYA INC-ADR	2,700	20.22	54,594.00	
	IQIYI INC-ADR	14,300	24.46	349,778.00	
	NETEASE INC-ADR	4,980	413.21	2,057,785.80	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	23,500	13.58	319,130.00	
	58.COM INC-ADR	5,780	54.50	315,010.00	
	AUTOHOME INC-ADR	3,860	80.54	310,884.40	
	BAIDU INC - SPON ADR	16,740	123.08	2,060,359.20	
	JOYY INC	3,160	97.23	307,246.80	
	MOMO INC-SPON ADR	8,800	19.97	175,736.00	
	SINA CORP	4,150	35.90	148,985.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,400	34.88	118,592.00	
	小計銘柄数：69			59,816,427.23	
				(6,386,599,935)	
	組入時価比率：16.0%			17.5%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	60,458	35.41	2,140,817.78	
	CEMEX SAB - CPO	829,985	6.35	5,270,404.75	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	186,983	53.23	9,953,105.09	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	217.85	1,832,118.50	
	ALFA S.A.B. -A	172,100	13.07	2,249,347.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	48.20	1,682,180.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	264.50	3,782,350.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	21,400	164.37	3,517,518.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	163.32	2,106,828.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	341,000	54.98	18,748,180.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	100.45	2,621,745.00	
	BECLE SAB DE CV	25,000	42.65	1,066,250.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	32,495	106.29	3,453,893.55	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	116,200	148.00	17,197,600.00	
	GRUMA S.A.B. -B	13,400	246.53	3,303,502.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	101,000	37.83	3,820,830.00	

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	95,000	34.80	3,306,000.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	167,300	85.89	14,369,397.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	17.59	2,466,118.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,041,000	15.20	31,023,200.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	38,700	64.54	2,497,698.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	153,400	26.14	4,009,876.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	66.92	1,545,852.00	
小計	銘柄数：23			141,964,810.67	
				(670,073,906)	
	組入時価比率：1.7%			1.8%	
リアル	COSAN SA	9,100	70.54	641,914.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	223,400	22.28	4,977,352.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	287,700	21.47	6,176,919.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	18.66	895,680.00	
	BRASKEM SA-PREF A	12,100	25.70	310,970.00	
	KLABIN SA-UNIT	42,700	20.51	875,777.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	11.21	517,902.00	
	GERDAU SA PFD NPV	74,500	15.45	1,151,025.00	
	VALE SA	226,421	55.17	12,491,646.57	
	SUZANO SA	39,060	39.50	1,542,870.00	
	WEG SA	51,924	46.21	2,399,408.04	
	LOCALIZA RENT A CAR	37,760	41.90	1,582,144.00	
	RUMO SA	70,600	23.83	1,682,398.00	
	CCR SA	75,600	15.00	1,134,000.00	
	B2W CIA DIGITAL	13,500	104.00	1,404,000.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	50,492	32.93	1,662,701.56	
	LOJAS RENNER S.A.	49,595	43.91	2,177,716.45	
	MAGAZINE LUIZA SA	46,000	71.40	3,284,400.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,600	22.22	968,792.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	19.81	586,376.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICIAO	11,103	68.42	759,667.26	
	RAIA DROGASIL SA	11,900	114.23	1,359,337.00	
	AMBEV SA	308,956	13.84	4,275,951.04	
	BRF SA	39,700	22.45	891,265.00	
	JBS SA	74,600	22.36	1,668,056.00	

NATURA &CO HOLDING SA	40,900	42.23	1,727,207.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	13,900	62.81	873,059.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	30,300	64.67	1,959,501.00	
HYPERA SA	23,900	34.37	821,443.00	
BANCO BRADESCO S.A.	73,954	19.99	1,478,340.46	
BANCO BRADESCO SA - PREF	267,536	22.36	5,982,104.96	
BANCO DO BRASIL SA	53,600	33.94	1,819,184.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	31.34	764,696.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	294,291	28.09	8,266,634.19	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	284,017	10.41	2,956,616.97	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	28.79	1,269,639.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	44,700	10.39	464,433.00	
PORTO SEGURO SA	7,000	54.42	380,940.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	18,149	45.06	817,793.94	
CIELO SA	73,763	5.70	420,449.10	
TELEFONICA BRASIL-PREF	26,805	50.40	1,350,972.00	
TIM PARTICIPACOES SA	46,552	14.48	674,072.96	
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	31.60	568,800.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,500	30.79	508,035.00	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	60,029	11.38	683,130.02	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	8,600	65.90	566,740.00	
CPFL ENERGIA SA	19,300	32.18	621,074.00	
ENERGISA SA-UNITS	10,200	48.85	498,270.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	50,000	22.15	1,107,500.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	57.66	1,228,158.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	124,433	51.00	6,346,083.00	
BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	16,100	72.00	1,159,200.00	
COGNA EDUCACAO	103,956	6.31	655,962.36	
ENGIE BRASIL SA	12,000	43.25	519,000.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	46,700	10.72	500,624.00	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	17,600	22.03	387,728.00	
小計 銘柄数：56			102,795,658.88	
			(2,066,192,743)	
組入時価比率：5.2%				5.6%

チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	5,701.00	147,655,900.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,775.00	127,713,025.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,510.00	126,002,000.00	
	CENCOSUD SA	80,738	1,182.00	95,432,316.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	28,800	2,052.80	59,120,640.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,085	27,960.00	86,256,600.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	8,972	5,505.00	49,390,860.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	216,000	266.00	57,456,000.00	
	COLBUN SA	471,000	126.10	59,393,100.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	23,000	1,595.00	36,685,000.00	
小計	銘柄数：10			845,105,441.00	
				(110,624,302)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	27,380.00	435,342,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	19,300.00	250,900,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	18,860.00	637,468,000.00	
	小計	銘柄数：3			1,323,710,000.00
				(37,725,735)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	3,800	13.93	52,934.00	
	FF GROUP	2,030	0.96	1,948.80	
	OPAP SA	13,190	8.91	117,522.90	
	JUMBO SA	6,732	16.50	111,078.00	
	HELLENIC TELECOM	12,600	12.16	153,216.00	
	小計	銘柄数：5			436,699.70
				(52,128,843)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,000	15.30	229,500.00	
	小計	銘柄数：1			229,500.00
				(30,243,510)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	88.40	733,720.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	61,000	8.32	507,520.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	20,730	32.72	678,285.60	
	KOC HLDGS	53,000	17.26	914,780.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	12.52	402,968.72	

	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,660	19.27	186,148.20	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	69.35	230,242.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	30,000	67.45	2,023,500.00	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII	12,740	20.60	262,444.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	5.99	1,227,950.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	8.33	1,184,192.80	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	5.30	486,540.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI A.S.	190,000	2.39	454,100.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	40,000	9.20	368,000.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	77,000	16.95	1,305,150.00	
小計	銘柄数：15			10,965,541.32	
				(170,952,789)	
	組入時価比率：0.4%			0.5%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	581.00	2,934,050.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	55.60	2,335,200.00	
	CEZ AS	8,500	488.00	4,148,000.00	
小計	銘柄数：3			9,417,250.00	
				(42,189,280)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	25,000	1,914.00	47,850,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	7,200	6,930.00	49,896,000.00	
	OTP BANK NYRT	14,400	11,440.00	164,736,000.00	
小計	銘柄数：3			262,482,000.00	
				(90,530,041)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	6,800	60.40	410,720.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	66.24	1,245,312.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	4.52	442,409.25	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	87.90	870,210.00	
	LPP SA	94	6,825.00	641,550.00	
	DINO POLSKA SA	2,390	202.80	484,692.00	
	BANK PEKAO SA	10,520	54.94	577,968.80	
	MBANK	900	242.40	218,160.00	
	PKO BANK POLSKI SA	56,200	23.00	1,292,600.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,550	181.30	281,015.00	

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	37,500	29.68	1,113,000.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	6.36	249,189.75	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	8.07	417,564.56	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	27.68	523,152.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,080	392.70	1,602,216.00	
小計	銘柄数：15			10,369,759.36	
				(277,079,970)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	7.35	735,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,434,900	3.43	4,921,707.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	231,000	12.88	2,975,280.00	
	CNOOC LTD	1,082,000	8.93	9,662,260.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H	66,000	4.00	264,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,400,000	2.79	3,906,000.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	6.65	638,400.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	206,000	2.09	430,540.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	77,000	53.00	4,081,000.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	8.70	2,044,500.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	152,000	9.79	1,488,080.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	1.52	319,200.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	104,000	3.60	374,400.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	2.65	477,000.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	7.59	743,820.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	8.41	479,370.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	3.35	1,162,450.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	4.41	343,980.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	7.13	720,130.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	3.73	753,460.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	10.90	1,002,800.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	299,000	4.66	1,393,340.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	5.24	913,856.00	

CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	94,000	34.75	3,266,500.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	4.17	959,100.00
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	135,000	6.88	928,800.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	4.83	740,197.50
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.55	253,825.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	2.33	293,580.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	39,984	7.80	311,875.20
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	21.75	789,525.00
CITIC LTD	362,000	7.84	2,838,080.00
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	165,940	10.04	1,666,037.60
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	30,000	12.60	378,000.00
CRRC CORP LTD-H	275,350	3.60	991,260.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	15.14	484,480.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	37,500	20.65	774,375.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	117,800	14.70	1,731,660.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	61,000	6.18	376,980.00
BOC AVIATION LTD	11,300	50.35	568,955.00
A-LIVING SERVICES CO LTD	33,000	43.15	1,423,950.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	281,000	4.14	1,163,340.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	79,000	37.25	2,942,750.00
GREENTOWN SER	60,000	9.80	588,000.00
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	4.98	507,960.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	76,000	2.95	224,200.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	3.67	389,020.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	140,000	2.35	329,000.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	5.23	512,540.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	82,000	9.57	784,740.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	4.25	433,500.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	9.46	643,280.00
SHENZHEN EXPRESSWAY-H	32,000	8.05	257,600.00
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	12.98	1,025,420.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	5.83	664,620.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO	39,200	19.20	752,640.00

LTD				
BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED	96,000	3.76	360,960.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	7.54	1,643,720.00	
BYD CO LTD-H	44,000	59.85	2,633,400.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	5.06	931,040.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	344,000	12.52	4,306,880.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	238,000	5.36	1,275,680.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	6.47	1,293,288.30	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	87,000	24.85	2,161,950.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70,000	71.40	4,998,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	2.22	452,880.00	
LI NING CO LTD	136,000	25.65	3,488,400.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	50,100	97.65	4,892,265.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	51,000	34.80	1,774,800.00	
MEITUAN DIANPING B	218,900	174.00	38,088,600.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	54,800	14.04	769,392.00	
GOME RETAIL HODINGS LTD	523,360	1.35	706,536.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	77,000	10.20	785,400.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	29,500	42.00	1,239,000.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	149,000	12.98	1,934,020.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	82.29	576,030.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	93,333	44.15	4,120,651.95	
TSING TAO BREWERY CO-H	24,000	55.15	1,323,600.00	
CHINA FEIHE LTD	58,000	15.98	926,840.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	180,000	30.45	5,481,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.61	514,015.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	12.20	1,439,600.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	8.15	570,500.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	364,000	6.20	2,256,800.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	28,000	74.10	2,074,800.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	26.50	609,500.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	61.15	2,721,175.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	24,000	23.85	572,400.00	



SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	160,000	15.52	2,483,200.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	13.56	690,204.00
SINOPHARM GROUP CO-H	87,200	20.40	1,778,880.00
3SBIO, INC	77,000	10.16	782,320.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	58,500	49.50	2,895,750.00
CANSINO BIOLOGICS INC	3,800	185.30	704,140.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	9.95	805,950.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	4.51	419,430.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	124,000	3.62	448,880.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	367,200	13.92	5,111,424.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	30,000	39.40	1,182,000.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	62,500	5.19	324,375.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	27.60	952,200.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	411,000	14.82	6,091,020.00
SSY GROUP LTD	82,000	5.51	451,820.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,638,000	3.13	5,126,940.00
BANK OF CHINA LTD-H	4,841,000	2.91	14,087,310.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	597,790	4.82	2,881,347.80
CHINA CITIC BANK-H	560,000	3.46	1,937,600.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,925,000	6.26	37,090,500.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	3.00	771,000.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	235,692	36.25	8,543,835.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	374,800	5.44	2,038,912.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	3.15	431,550.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,719,000	5.18	19,264,420.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	640,000	4.61	2,950,400.00
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.67	1,027,180.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	445,000	16.04	7,137,800.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	172,200	21.50	3,702,300.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	308,000	0.87	267,960.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	12.84	1,328,580.48
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	26.80	1,583,880.00
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.49	1,461,630.00

PICC PROPERTY & CASUALTY -H	434,420	7.37	3,201,675.40	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	369,500	79.15	29,245,925.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	25,000	33.65	841,250.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	14.76	974,160.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	142,000	15.88	2,254,960.00	
KINGSOFT CORP LTD	54,000	30.20	1,630,800.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	17.34	572,220.00	
ZTE CORP-H	47,252	27.05	1,278,166.60	
LEGEND HLDS CORP	18,100	8.96	162,176.00	
LENOVO GROUP LTD	498,000	4.28	2,131,440.00	
XIAOMI CORPORATION	628,000	12.90	8,101,200.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	45,000	46.45	2,090,250.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	80,000	3.37	269,600.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	43,000	20.95	900,850.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	58,500	8.03	469,755.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	41,900	114.10	4,780,790.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	26,000	21.10	548,600.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	192,000	22.90	4,396,800.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	262,000	6.85	1,794,700.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	866,000	2.29	1,983,140.00	
CHINA TOWER CORP LTD	2,790,000	1.51	4,212,900.00	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	378,000	4.45	1,682,100.00	
CHINA MOBILE LTD	376,500	54.25	20,425,125.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	27.40	986,400.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	153,000	28.20	4,314,600.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	56,000	40.90	2,290,400.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	49,600	91.75	4,550,800.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	186,000	5.11	950,460.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	3.15	1,275,750.00	
GUANGDONG INVESTMENT	184,000	13.94	2,564,960.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.48	917,600.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	11.28	541,440.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.05	1,077,300.00	

CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	0.80	473,600.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	92,400	14.58	1,347,192.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	123,000	15.24	1,874,520.00
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	8.77	724,402.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	62,000	11.62	720,440.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	6.45	1,119,720.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	13.10	1,336,200.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	46,000	14.90	685,400.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	25,000	12.90	322,500.00
CHINA YUHUA EDUCATION CO.LTD	76,000	7.09	538,840.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	15,000	33.85	507,750.00
CGN POWER CO LTD-H	627,000	1.71	1,072,170.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	218,000	4.48	976,640.00
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	1.51	362,400.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	9.07	1,360,500.00
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	3.02	718,760.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	232,000	22.05	5,115,600.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	23,200	112.70	2,614,640.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	56,000	16.24	909,440.00
WUXI APPTec CO LTD	13,384	96.90	1,296,909.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	58,500	138.60	8,108,100.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	9.32	876,080.00
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	98,000	9.93	973,140.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	126,000	20.55	2,589,300.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	330,000	5.65	1,864,500.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	244,000	25.30	6,173,200.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	8.26	702,100.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	208,444	31.40	6,545,141.60
CHINA VANKE CO LTD-H	99,300	25.50	2,532,150.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	6.42	1,258,320.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	494,380	10.02	4,953,687.60
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	80,000	9.31	744,800.00

	KAISA GROUP HLDS LTD	115,000	3.26	374,900.00	
	KWG GROUP HOLDINGS LTD	68,500	12.82	878,170.00	
	LOGAN GROUP CO LTD	74,000	14.26	1,055,240.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	116,500	37.75	4,397,875.00	
	POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO	7,400	82.65	611,610.00	
	SEAZEN GROUP LTD	168,000	7.33	1,231,440.00	
	SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	2.37	417,120.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	33.35	2,401,200.00	
	SHUI ON LAND LTD	197,000	1.40	275,800.00	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	1.94	283,240.00	
	SOHO CHINA LTD	106,000	2.86	303,160.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	165,000	35.05	5,783,250.00	
	WHARF(HOLDING)	94,000	17.12	1,609,280.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	370,000	1.43	529,100.00	
	YUZHOU PROPERTIES CO LTD	91,000	3.53	321,230.00	
	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	67,000	4.99	334,330.00	
	CHINA LITERATURE LTD	20,800	52.50	1,092,000.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	1.09	948,300.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	355,400	460.40	163,626,160.00	
小計	銘柄数：208			664,813,516.63	
				(9,161,130,259)	
	組入時価比率：23.0%			25.0%	
リング	DIALOG GROUP BHD	219,344	3.56	780,864.64	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	22.16	321,320.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	144,000	6.27	902,880.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	81,100	4.65	377,115.00	
	GAMUDA BERHAD	100,200	3.55	355,710.00	
	IJM CORP	152,600	1.81	276,206.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	9.00	304,200.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.14	470,800.00	
	MISC BHD	99,960	7.72	771,691.20	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	5.65	318,999.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.70	190,180.00	
	GENTING BHD	112,000	4.34	486,080.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.74	627,460.00	

	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA BERHAD	9,500	22.90	217,550.00
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	32.60	251,020.00
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	10.00	146,000.00
	IOI CORP	162,000	4.40	712,800.00
	KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	22.22	586,608.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	139.00	611,600.00
	PPB GROUP BERHAD	35,040	17.30	606,192.00
	QL RESOURCES BHD	40,000	9.80	392,000.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	5.05	728,715.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	93,000	12.08	1,123,440.00
	TOP GLOVE CORP BHD	99,000	15.40	1,524,600.00
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	5.40	842,400.00
	AMMB HOLDING	125,000	3.12	390,000.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	416,000	3.68	1,530,880.00
	HONG LEONG BANK	37,460	14.42	540,173.20
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	14.02	188,176.44
	MALAYAN BANKING	246,000	7.66	1,884,360.00
	PUBLIC BANK BHD	172,660	16.58	2,862,702.80
	RHB BANK BHD	125,023	4.80	600,110.40
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	3.91	242,420.00
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.46	674,700.00
	DIGI.COM BERHAD	186,000	4.29	797,940.00
	MAXIS BHD	146,200	5.45	796,790.00
	TENAGA NASIONAL	147,000	11.80	1,734,600.00
	PETRONAS GAS BERHAD	41,500	17.12	710,480.00
	YTL CORPORATION	210,847	0.81	170,786.07
小計	銘柄数：39			27,050,549.75 (675,181,721)
	組入時価比率：1.7%			1.8%
パーツ	IRPC PCL - NVDR	900,000	2.78	2,502,000.00
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	86,400	95.50	8,251,200.00
	PTT PCL-NVDR	681,000	38.25	26,048,250.00
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	46.25	3,838,750.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	29.00	3,218,043.00
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	46.75	7,105,719.50

SIAM CEMENT PCL-NVDR	50,600	358.00	18,114,800.00
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	11.60	5,521,600.00
AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	250,000	61.50	15,375,000.00
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	9.90	4,426,290.00
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	290,000	4.56	1,322,400.00
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	163,000	22.10	3,602,300.00
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	86,025	34.25	2,946,356.25
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	16.00	5,673,552.00
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	39.50	2,911,150.00
CP ALL PCL-NVDR	375,000	69.00	25,875,000.00
OSOTSPA PCL-NVDR	33,000	41.50	1,369,500.00
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	32.25	8,997,750.00
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	12.60	2,517,480.00
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	547,000	22.20	12,143,400.00
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	117.50	3,783,500.00
BANGKOK BANK(F)	28,600	116.50	3,331,900.00
KASIKORNBANK PCL-NVDR	37,300	95.75	3,571,475.00
KASIKORNBANK PCL(F)	72,000	95.25	6,858,000.00
KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	10.80	2,884,140.00
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	77.25	3,924,300.00
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,098,957	1.10	1,208,852.70
TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	3.68	3,385,600.00
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	74,200	190.00	14,098,000.00
INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	56.50	7,910,000.00
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	43,000	41.50	1,784,500.00
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	35,000	31.75	1,111,250.00
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	55.00	2,695,000.00
SRI SAWAD CORP PCL-NVDR	32,000	57.25	1,832,000.00
BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	80,000	25.50	2,040,000.00
B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	53.25	1,810,500.00
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	258.00	4,463,400.00
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	40.75	3,871,250.00
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	77.25	4,557,750.00
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	165,000	36.25	5,981,250.00
RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	64.50	2,773,500.00

	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	133,900	51.00	6,828,900.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	7.75	4,805,000.00	
小計	銘柄数：43			257,270,608.45	
				(887,583,599)	
	組入時価比率：2.2%			2.4%	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	50.00	7,300,000.00	
	AYALA CORPORATION	15,402	808.50	12,452,517.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	474.00	2,590,410.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	173,700	63.25	10,986,525.00	
	SM INVESTMENTS CORP	13,300	949.00	12,621,700.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	98.00	6,762,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	150.00	3,660,000.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	65,000	45.40	2,951,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	129.50	8,676,500.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	53,599	72.60	3,891,287.40	
	BDO UNIBANK INC	124,998	100.00	12,499,800.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	38.60	4,929,027.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.79	2,834,162.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,154.00	4,458,780.00	
	PLDT INC	4,970	1,231.00	6,118,070.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	265.00	4,478,500.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	27.80	2,132,260.00	
	AYALA LAND LTD	499,000	36.30	18,113,700.00	
	MEGAWORLD CORP	910,000	3.27	2,975,700.00	
	ROBINSONS LAND CO	132,000	18.24	2,407,680.00	
	SM PRIME HLDGS	652,975	31.45	20,536,063.75	
小計	銘柄数：21			153,375,682.15	
				(326,690,202)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	1,040.00	872,768,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	17,850.00	1,769,827,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,660,000	1,160.00	1,925,600,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	64,000	12,250.00	784,000,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	9,500.00	1,672,000,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	148,600	5,800.00	861,880,000.00	

	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,335,000	4,890.00	6,528,150,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	300,000	1,500.00	450,000,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	8,925.00	1,588,650,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	6,575.00	1,750,265,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	5,675.00	2,831,825,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	49,000.00	1,430,800,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	640,000	1,730.00	1,107,200,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	8,050.00	4,214,175,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,460.00	2,248,400,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	596,000	27,875.00	16,613,500,000.00	
	BANK MANDIRI	1,107,000	4,880.00	5,402,160,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	4,480.00	2,235,520,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,536,000	3,100.00	10,961,600,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	2,930,000	3,280.00	9,610,400,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	160,000	2,790.00	446,400,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	593,500	1,080.00	640,980,000.00	
小計	銘柄数：22			75,946,100,500.00	
				(577,190,363)	
	組入時価比率：1.4%			1.6%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	37,900.00	136,440,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,690	67,900.00	182,651,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,580	126,000.00	451,080,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	6,330	18,550.00	117,421,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	78,200.00	78,043,600.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	276,500.00	106,176,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	2,750	512,000.00	1,408,000,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	183,500.00	192,675,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,810	76,000.00	137,560,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	22,500.00	107,527,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	592	355,000.00	210,160,000.00	
	POSCO	4,400	190,500.00	838,200,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	25,500.00	115,260,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	1,600	88,000.00	140,800,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,690	3,615.00	35,029,350.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	26,700.00	112,674,000.00	
		4,650	33,300.00	154,845,000.00	



HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR				
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	12,550.00	106,926,000.00	
CJ CORP	1,100	89,400.00	98,340,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,470	23,150.00	57,180,500.00	
LG CORP	6,050	75,300.00	455,565,000.00	
LOTTE CORP	1,620	35,050.00	56,781,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	5,700	120,000.00	684,000,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	2,340	293,000.00	685,620,000.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,900	25,600.00	74,240,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	28,200.00	94,470,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	262,000.00	156,414,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	2,377	93,700.00	222,724,900.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	30,700	6,440.00	197,708,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,900	14,700.00	57,330,000.00	
S-1 CORPORATION	1,450	87,700.00	127,165,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	107,000.00	121,980,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,576	19,450.00	50,103,200.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD RTS	1,704	4,850.00	8,264,400.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	3,855.00	57,400,950.00	
CJ LOGISTICS	780	162,500.00	126,750,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	26,100.00	138,852,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	9,410.00	109,626,500.00	
HYUNDAI MOBIS	3,960	185,500.00	734,580,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	8,920	100,000.00	892,000,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	59,800.00	157,872,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	57,700.00	84,819,000.00	
KIA MOTORS CORP	16,400	33,050.00	542,020,000.00	
COWAY CO LTD	3,340	73,300.00	244,822,000.00	
LG ELECTRONICS INC	5,970	68,800.00	410,736,000.00	
HLB INC	2,431	103,500.00	251,608,500.00	
FILA HOLDINGS CORP	2,930	37,000.00	108,410,000.00	
KANGWON LAND INC	7,900	22,600.00	178,540,000.00	
CJ ENM CO LTD	657	112,300.00	73,781,100.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,140	59,200.00	67,488,000.00	

LOTTE SHOPPING CO	800	81,700.00	65,360,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	427	220,500.00	94,153,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	72,000.00	141,120,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	140,000.00	67,900,000.00	
E-MART CO	1,181	113,500.00	134,043,500.00	
GS RETAIL CO LTD	1,140	38,500.00	43,890,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	510	332,000.00	169,320,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	134,500.00	242,100,000.00	
OTTOGI CORPORATION	70	587,000.00	41,090,000.00	
KT & G CORP	7,280	80,600.00	586,768,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,930	162,000.00	312,660,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	64,600.00	26,486,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	51,900.00	78,888,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	584	1,287,000.00	751,608,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	718,000.00	74,672,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,501	106,400.00	372,506,400.00	
CELLTRION INC	5,680	291,500.00	1,655,720,000.00	
HELIXMITH CO LTD	1,500	64,500.00	96,750,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,030	137,400.00	141,522,000.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	481	260,000.00	125,060,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,620	54,000.00	195,480,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	22,800	5,240.00	119,472,000.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	20,100	27,850.00	559,785,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	8,640.00	129,945,600.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	25,550	36,000.00	919,800,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	28,600	30,800.00	880,880,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	29,800	9,310.00	277,438,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	44,200.00	125,970,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	24,700.00	83,980,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,890	186,000.00	351,540,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	47,100.00	218,544,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	1,950	177,000.00	345,150,000.00	
DUZONBIZON CO., LTD.	1,240	110,000.00	136,400,000.00	
KMW CO.LTD.	1,140	60,000.00	68,400,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	295,450	52,900.00	15,629,305,000.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	50,190	47,000.00	2,358,930,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	860	166,500.00	143,190,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	16,200	11,750.00	190,350,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,490	130,500.00	455,445,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	3,310	385,000.00	1,274,350,000.00	
	SK HYNIX INC	33,420	85,400.00	2,854,068,000.00	
	LG UPLUS CORP	13,300	12,300.00	163,590,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	1,270	206,000.00	261,620,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	14,200	20,300.00	288,260,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,599	27,150.00	43,412,850.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,360	27,750.00	37,740,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	49,050.00	154,017,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	3,345.00	81,952,500.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	24,737	6,780.00	167,716,860.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	9,710.00	75,058,300.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	28,600.00	101,959,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,024	801,000.00	820,224,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	16,300.00	96,170,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	972	857,000.00	833,004,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	97,200.00	142,884,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	310	207,700.00	64,387,000.00	
	KAKAO CORP	3,530	263,500.00	930,155,000.00	
	NAVER CORP	7,780	249,500.00	1,941,110,000.00	
小計	銘柄数：108			50,701,961,510.00	
				(4,461,772,612)	
	組入時価比率：11.2%			12.1%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	61,360	88.10	5,405,816.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	218,998	73.10	16,008,753.80	
	FORMOSA PLASTIC	246,424	85.80	21,143,179.20	
	NAN YA PLASTICS CORP	304,726	63.80	19,441,518.80	
	ASIA CEMENT	126,980	43.45	5,517,281.00	
	TAIWAN CEMENT	266,371	42.55	11,334,086.05	
	CHINA STEEL	754,544	20.50	15,468,152.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	148,454	27.40	4,067,639.60	

AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	8,000	513.00	4,104,000.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,243	301.50	3,992,764.50
CHINA AIRLINES	133,561	8.25	1,101,878.25
EVA AIRWAYS CORP	180,918	11.30	2,044,373.40
EVERGREEN MARINE	202,375	10.80	2,185,650.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	36.50	5,219,500.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	83,036	35.00	2,906,260.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	288.50	2,885,000.00
TATUNG CO LTD	130,000	20.95	2,723,500.00
GIANT MANUFACTURING	18,752	253.50	4,753,632.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,443	346.00	3,959,278.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	22,346	179.00	3,999,934.00
FORMOSA TAFFETA CO.	65,000	39.95	2,596,750.00
POU CHEN CORP	135,468	28.50	3,860,838.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	18,000	693.00	12,474,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	37,816	298.50	11,288,076.00
STANDARD FOODS CORP	27,079	63.90	1,730,348.10
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	286,836	71.20	20,422,723.20
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	341,788	19.60	6,699,044.80
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,131,212	20.10	22,737,361.20
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	658,425	27.80	18,304,215.00
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	617,787	22.50	13,900,207.50
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	489,305	19.80	9,688,239.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	644,380	31.25	20,136,875.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	550,549	11.00	6,056,039.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	664,776	13.20	8,775,043.20
TAIWAN BUSINESS BANK	320,616	10.80	3,462,652.80
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	571,312	20.70	11,826,158.40
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	220,574	45.20	9,969,944.80
CHAILEASE HOLDING CO LTD	73,051	127.00	9,277,477.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	619,377	18.15	11,241,692.55
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	497,035	42.10	20,925,173.50
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	838,789	9.26	7,767,186.14
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	176,754	22.00	3,888,588.00

FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	425,541	43.60	18,553,587.60	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	708,228	8.64	6,119,089.92	
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	32,000	230.00	7,360,000.00	
ACER INC	160,767	17.55	2,821,460.85	
ADVANTECH CO.,LTD.	21,594	295.50	6,381,027.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	45,805	236.50	10,832,882.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,840	222.50	9,086,900.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	48,645	83.70	4,071,586.50	
COMPAL ELECTRONICS	244,590	19.50	4,769,505.00	
INVENTEC CO.,LTD	136,911	25.80	3,532,303.80	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	52.40	7,645,002.80	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	102.50	5,330,000.00	
PEGATRON CORP	121,692	68.80	8,372,409.60	
QUANTA COMPUTER INC	175,684	69.60	12,227,606.40	
WISTRON CORP	144,457	34.65	5,005,435.05	
WIWYNN CORP	5,000	830.00	4,150,000.00	
AU OPTRONICS CORP	489,008	9.25	4,523,324.00	
DELTA ELECTRONICS INC	123,681	166.50	20,592,886.50	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	54.10	2,966,519.40	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	760,649	78.80	59,939,141.20	
INNOLUX CORP	505,322	7.88	3,981,937.36	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	4,055.00	24,492,200.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	40.80	3,164,692.80	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	187.00	3,366,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	38.80	4,671,015.60	
YAGEO CORPORATION	23,377	404.50	9,455,996.50	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	36,410	137.00	4,988,170.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	186,658	68.20	12,730,075.60	
GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	402.50	5,232,500.00	
MEDIATEK INC	93,538	546.00	51,071,748.00	
NANYA TECHNOLOGY CO	61,000	59.80	3,647,800.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,058	222.00	7,560,876.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	291.00	2,708,046.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	46,147	101.50	4,683,920.50	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,417	295.00	8,383,015.00	

	SILERGY CORP	4,000	1,815.00	7,260,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,528,000	314.50	480,556,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	704,500	15.40	10,849,300.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	77.00	5,313,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	297.00	6,237,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	13.40	3,242,800.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	242,065	113.00	27,353,345.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	66.40	6,972,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	102,200	107.00	10,935,400.00	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	43.50	1,701,285.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	31,006	50.20	1,556,501.20	
小計	銘柄数：88			1,291,686,122.47	
				(4,662,986,902)	
	組入時価比率：11.7%			12.7%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	380.55	17,012,487.75	
	COAL INDIA LTD	76,900	137.25	10,554,525.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	223.65	7,689,087.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	85.30	9,638,900.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	157,000	85.75	13,462,750.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	260.40	9,108,792.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	175,300	1,759.40	308,422,820.00	
	ASIAN PAINTS LTD	19,300	1,622.50	31,314,250.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	500.50	9,509,500.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,620	1,398.85	9,260,387.00	
	UPL LTD	32,100	436.90	14,024,490.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	190.80	5,708,736.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	601.25	10,642,125.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	470	21,678.95	10,189,106.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	6,180	3,836.35	23,708,643.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	71,770	151.05	10,840,858.50	
	JSW STEEL LTD	53,000	194.30	10,297,900.00	
	TATA STEEL LIMITED	18,606	320.55	5,964,153.30	
	VEDANTA LTD	126,000	105.25	13,261,500.00	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	31,100	898.20	27,934,020.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	566.35	10,024,395.00	

SIEMENS LIMITED	3,100	1,066.90	3,307,390.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,027.60	5,148,276.00
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	409.05	5,064,039.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	348.90	14,863,140.00
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	375.80	4,772,660.00
BOSCH LTD	390	10,949.10	4,270,149.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	57,438	97.35	5,591,589.30
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	2,674.35	14,949,616.50
EICHER MOTORS LTD	820	17,349.35	14,226,467.00
HERO MOTOCORP LTD	6,210	2,355.85	14,629,828.50
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	50,800	500.05	25,402,540.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	7,060	5,897.35	41,635,291.00
TATA MOTORS LTD	104,000	102.50	10,660,000.00
PAGE INDUSTRIES LTD	340	18,113.20	6,158,488.00
TITAN CO LTD	21,000	975.85	20,492,850.00
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	4,700	1,689.10	7,938,770.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	7,800	2,363.15	18,432,570.00
UNITED SPIRITS LTD	22,600	618.05	13,967,930.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,530	3,438.55	15,576,631.50
NESTLE INDIA LIMITED	1,550	16,094.85	24,947,017.50
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	27,900	377.30	10,526,670.00
ITC LTD	221,100	184.05	40,693,455.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	49,900	2,092.75	104,428,225.00
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	2,900	1,356.70	3,934,430.00
DABUR INDIA LTD	37,800	443.05	16,747,290.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	650.50	17,693,600.00
MARICO LIMITED	26,340	331.90	8,742,246.00
BIOCON LTD	18,600	381.25	7,091,250.00
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	783.45	14,650,515.00
CIPLA LIMITED	20,980	636.20	13,347,476.00
DR.REDDYS LABORATORIES	7,130	4,005.60	28,559,928.00
LUPIN LTD	14,900	914.45	13,625,305.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	1,163.00	9,219,101.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	47,000	488.10	22,940,700.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,270	2,543.35	8,316,754.50

	AXIS BANK LIMITED	123,600	417.05	51,547,380.00	
	BANDHAN BANK LTD	28,900	290.60	8,398,340.00	
	ICICI BANK LTD	290,300	363.80	105,611,140.00	
	REC LTD	39,810	106.60	4,243,746.00	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,320	5,899.80	13,687,536.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	45,500	521.10	23,710,050.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	10,200	1,270.15	12,955,530.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	17,100	391.60	6,696,360.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	25,800	775.85	20,016,930.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	69,600	569.60	39,644,160.00	
	INFOSYS LTD	207,800	705.55	146,613,290.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	54,700	2,044.60	111,839,620.00	
	TECH MAHINDRA LTD	28,300	538.85	15,249,455.00	
	WIPRO LTD	80,400	222.05	17,852,820.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	16,510	218.85	3,613,213.50	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	147,900	572.50	84,672,750.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	127,000	171.40	21,767,800.00	
	GAIL INDIA LTD	94,600	99.50	9,412,700.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	13,500	447.65	6,043,275.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	100,700	1,835.10	184,794,570.00	
	LIC HOUSING FINANCE	18,050	284.75	5,139,737.50	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,130	2,698.60	30,035,418.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	5,200	658.85	3,426,020.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,990	2,444.70	4,864,953.00	
	NTPC LIMITED	142,008	93.00	13,206,744.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	5,900	2,304.75	13,598,025.00	
	DLF LIMITED	26,000	161.80	4,206,800.00	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	70,000	172.95	12,106,500.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	4,860	2,677.95	13,014,837.00	
小計	銘柄数：85			2,149,091,314.85	
				(3,030,218,753)	
	組入時価比率：7.6%			8.2%	
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	51,000	108.85	5,551,350.00	



	HABIB BANK LTD	35,600	98.75	3,515,500.00	
	MCB BANK LIMITED	34,000	155.18	5,276,120.00	
小計	銘柄数：3			14,342,970.00	
				(9,179,500)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	16.85	584,695.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.10	642,940.00	
	INDUSTRIES QATAR	111,700	8.35	933,030.10	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	3.84	453,797.10	
	MASRAF AL RAYAN	237,000	3.89	924,063.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	8.83	415,010.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	64,300	16.25	1,044,875.00	
	QATAR NATIONAL BANK	274,100	17.90	4,906,390.00	
	OOREDOO QSC	43,100	6.70	288,770.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	16.26	559,344.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	113,000	3.07	346,910.00	
小計	銘柄数：11			11,099,824.20	
				(323,892,870)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
エジプトポンド	ELSWEDY ELECTRIC CO	41,500	6.94	288,010.00	
	EASTERN TOBACCO	51,525	13.31	685,797.75	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	91,300	67.58	6,170,054.00	
小計	銘柄数：3			7,143,861.75	
				(47,149,487)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	15,000	141.46	2,121,900.00	
	SASOL LTD	36,200	146.00	5,285,200.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,171.69	4,815,645.90	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	26,400	452.38	11,942,832.00	
	GOLD FIELDS LTD	51,700	143.77	7,432,909.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	45,200	118.07	5,336,764.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,900	492.73	1,921,647.00	
	NORTHAM PLATINUM LTD	17,900	110.71	1,981,709.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	161,000	34.89	5,617,290.00	
	BIDVEST GROUP LTD	17,200	145.00	2,494,000.00	
	NASPERS LTD-N SHS	27,390	3,050.00	83,539,500.00	

	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	34.30	2,113,223.00	
	MR PRICE GROUP LTD	16,700	145.32	2,426,844.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	38,000	12.59	478,420.00	
	BID CORP LTD	22,800	292.80	6,675,840.00	
	CLICKS GROUP LTD	18,300	229.03	4,191,249.00	
	PICKN PAY STORES LTD	26,700	54.15	1,445,805.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	29,200	110.00	3,212,000.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	175.58	2,686,374.00	
	TIGER BRANDS LTD	12,800	179.38	2,296,064.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	102,000	17.58	1,793,160.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	143.01	3,093,306.30	
	ABSA GROUP LTD	42,300	94.38	3,992,274.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,130	906.38	2,836,969.40	
	NEDBANK GROUP LTD	21,300	113.73	2,422,449.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	75,600	107.09	8,096,004.00	
	FIRSTRAND LTD	216,300	40.67	8,796,921.00	
	PSG GROUP LTD	8,660	166.40	1,441,024.00	
	REMGRO LTD	33,200	108.37	3,597,884.00	
	RMB HOLDINGS LTD	61,020	54.18	3,306,063.60	
	DISCOVERY LTD	25,800	111.00	2,863,800.00	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	56,462	18.63	1,051,887.06	
	OLD MUTUAL LTD	294,000	12.35	3,630,900.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	32.23	1,300,480.50	
	SANLAM LIMITED	119,300	61.02	7,279,686.00	
	MTN GROUP LTD	109,700	56.00	6,143,200.00	
	VODACOM GROUP	39,800	128.09	5,097,982.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	8,790	300.00	2,637,000.00	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	25,200	92.16	2,322,432.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	108.50	2,892,610.00	
小計	銘柄数：40			232,611,248.76	
				(1,428,233,067)	
	組入時価比率：3.6%			3.9%	
U A E デ ィ ル ハ ム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	173,870	5.13	891,953.10	
	DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	3.87	394,852.23	

	EMIRATES NBD PJSC	81,000	8.84	716,040.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	173,200	11.50	1,991,800.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	100,700	16.72	1,683,704.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	1.75	484,750.00	
	EMAAR MALLS PJSC	211,000	1.30	274,300.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	172,000	2.74	471,280.00	
小計	銘柄数：8			6,908,679.33	
				(201,180,742)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	13.86	133,056.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	74,800	32.90	2,460,920.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,020	52.40	472,648.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	10,000	10.40	104,000.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	14.50	424,850.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	11,900	78.70	936,530.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	54,400	91.60	4,983,040.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	18,700	20.70	387,090.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	47,000	8.62	405,140.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	14,300	52.60	752,180.00	
	SAUDI CEMENT	6,400	51.30	328,320.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	28,200	37.25	1,050,450.00	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	1,200	77.20	92,640.00	
	JARIR MARKETING CO	3,730	145.00	540,850.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,700	115.20	426,240.00	
	ALMARAI CO	18,000	55.20	993,600.00	
	SAVOLA	16,600	44.25	734,550.00	
	AL RAJHI BANK	73,900	58.80	4,345,320.00	
	ALINMA BANK	61,066	14.88	908,662.08	
	ARAB NATIONAL BANK	32,800	20.70	678,960.00	
	BANK AL - JAZIRA	34,100	11.38	388,058.00	
	BANK ALBILAD	23,300	22.26	518,658.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,400	30.30	1,133,220.00	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	88,100	37.65	3,316,965.00	
	RIYAD BANK	80,300	17.54	1,408,462.00	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	65,800	23.70	1,559,460.00	

	SAUDI BRITISH BANK	41,600	23.30	969,280.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	3,900	114.80	447,720.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	71.60	193,320.00	
	SAUDI TELECOM CO	36,000	99.30	3,574,800.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	23,900	28.70	685,930.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	16.16	940,512.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	23,000	7.17	164,910.00	
	EMAAR ECONOMIC CITY	12,000	6.89	82,680.00	
	小計 銘柄数：34			36,543,021.08	
				(1,041,476,100)	
	組入時価比率：2.6%			2.8%	
	合計			36,768,207,231	
				(36,768,207,231)	

(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22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	483,900	13,999,227.00	
	小計	銘柄数：1	483,900	13,999,227.00	
		組入時価比率：3.7%		(1,494,697,466)	97.7%
	合計			1,494,697,466	
				(1,494,697,466)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,100	3,972,629.00	
	小計	銘柄数：1	208,100	3,972,629.00	
		組入時価比率：0.0%		(18,750,808)	1.2%
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	191,000	2,809,610.00	
	小計	銘柄数：1	191,000	2,809,610.00	
		組入時価比率：0.0%		(17,251,005)	1.1%
	合計			36,001,813	

		(36,001,813)
合計		1,530,699,279 (1,530,699,279)

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 6月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	1,568,252,441	-	1,569,579,325	1,326,884
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	32,061,060	-	32,028,000	33,060
米ドル	32,061,060	-	32,028,000	33,060
売建	4,275,520	-	4,270,400	5,120
米ドル	4,275,520	-	4,270,400	5,120
合計	-	-	-	1,298,944

### (注) 時価の算定方法

#### 1 先物取引

##### 外国先物取引について

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

#### 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	942,617,839
投資証券	34,242,182,240
未収入金	2,005,821
未収配当金	195,552,823
差入委託証拠金	208,685,100
流動資産合計	35,591,043,823
資産合計	35,591,043,823
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,139,230
未払金	32,213,080
未払解約金	49,106,421
未払利息	1,130
流動負債合計	128,459,861
負債合計	128,459,861
純資産の部	
元本等	
元本	16,726,361,153
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	18,736,222,809
元本等合計	35,462,583,962
純資産合計	35,462,583,962
負債純資産合計	35,591,043,823

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 6月22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	2,1202円
(10,000口当たり純資産額)	(21,202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25日 至 2020年 6月22日	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。	
当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。	
これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	
委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。	
市場リスクの管理	
市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。	
信用リスクの管理	
信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。	
流動性リスクの管理	
流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 6月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

### 投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

### 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## (その他の注記)

### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月22日現在	
期首	2019年 6月25日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	17,584,991,977円
同期中における追加設定元本額	8,445,114,493円
同期中における一部解約元本額	9,303,745,317円
期末元本額	16,726,361,153円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,999,839,281円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,622,780,120円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	825,797,197円
野村資産設計ファンド2015	17,955,449円
野村資産設計ファンド2020	18,445,762円
野村資産設計ファンド2025	20,987,754円
野村資産設計ファンド2030	22,192,848円
野村資産設計ファンド2035	20,994,506円
野村資産設計ファンド2040	35,937,740円
野村資産設計ファンド2045	3,339,578円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,300,106,690円
ネクストコア	7,848,696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	1,092,690,993円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	2,617,091,191円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	361,551,322円
野村資産設計ファンド2050	5,021,932円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,345,251円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,306,578円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,250,698円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,623,628円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,468,764円
野村6資産均等バランス	960,936,601円
野村世界REITインデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	96,501,986円
野村資産設計ファンド2060	1,750,155円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	125,655,930円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用)	57,194,561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)	159,649,583円



J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,707,409,550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)	461,882,602円
野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	55,025円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)	19,690,854円
野村DC運用戦略ファンド	120,762,941円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	9,288,360円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	5,387,038円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,670,540円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	4,966,120円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	2,134,989円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,615,459円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	861,643円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	371,238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22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22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	478	52,102,000	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	570	55,461,000	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	876	114,142,800	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,306	835,840,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法 人 投資証券	5,043	410,500,200	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,522	639,863,000	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,062	844,341,600	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,728	1,165,000,000	

ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,564	476,904,000	
アクティブア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,969	758,065,000	
GLP投資法人 投資証券	9,789	1,396,890,300	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,711	558,641,500	
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,914	1,812,641,000	
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	598	287,638,000	
Oneリート投資法人 投資証券	613	158,092,700	
イオンリート投資法人 投資証券	4,242	498,859,200	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,343	444,953,300	
日本リート投資法人 投資証券	1,277	453,335,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	25,251	374,724,840	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,492	822,827,200	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	855	90,886,500	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,518	312,708,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	838	103,660,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	787	83,500,700	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,689	1,680,023,600	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	651	47,523,000	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,654	596,332,800	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	1,304	123,749,600	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	387	44,698,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,119	537,120,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	668	45,758,000	

さくら総合リート投資法人 投資証券	850	70,975,000	
投資法人みらい 投資証券	4,470	172,989,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	922	94,320,600	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	774	297,216,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	739	109,889,300	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	570	55,290,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,115	100,127,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	818	107,812,400	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,806	2,458,676,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,930	2,189,010,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,428	1,054,776,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,831	1,148,024,600	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,583	852,390,000	
プレミア投資法人 投資証券	3,550	417,125,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,635	384,446,500	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,729	274,537,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,825	1,044,880,000	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,809	375,001,500	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,240	526,682,000	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,396	502,560,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,448	257,040,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,568	748,828,800	

	福岡リート投資法人 投資証券	2,033	269,169,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,216	738,112,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投 資証券	3,043	232,180,900	
	大和証券オフィス投資法人 投資証 券	907	542,386,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,775	234,832,500	
	スタートプロシード投資法人 投資 証券	612	124,542,000	
	大和ハウスリート投資法人 投資証 券	5,608	1,459,201,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	12,661	615,324,600	
	大和証券リビング投資法人 投資証 券	4,811	481,100,000	
	ジャパンエクセレント投資法人 投 資証券	3,636	475,952,400	
小計	銘柄数：63 組入時価比率：96.6%	231,156	34,242,182,240	100.0%
合計			34,242,182,240	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 6月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	1,266,037,600	-	1,218,979,000	47,139,230
合計	1,266,037,600	-	1,218,979,000	47,139,230

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

#### 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 海外REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	55,624,220
コール・ローン	32,646,443
投資証券	26,656,714,456
未収入金	953,132
未収配当金	61,550,025
差入委託証拠金	95,197,786
流動資産合計	26,902,686,062
資産合計	26,902,686,062
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,804,264
未払金	54,557,029
未払解約金	7,959,030
未払利息	39
その他未払費用	367,600
流動負債合計	66,687,962
負債合計	66,687,962
純資産の部	
元本等	
元本	13,168,369,904
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,667,628,196
元本等合計	26,835,998,100
純資産合計	26,835,998,100
負債純資産合計	26,902,686,062

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	受取配当金

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

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 6月22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	2.0379円
(10,000口当たり純資産額)	(20,379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25日 至 2020年 6月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 6月22日現在	
期首	2019年 6月25日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	10,809,294,964円
同期中における追加設定元本額	6,766,516,410円
同期中における一部解約元本額	4,407,441,470円
期末元本額	13,168,369,904円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,145,991,120円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,814,461,007円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	886,143,832円
野村資産設計ファンド2015	19,266,312円
野村資産設計ファンド2020	19,793,839円
野村資産設計ファンド2025	22,521,703円
野村資産設計ファンド2030	23,814,637円
野村資産設計ファンド2035	22,528,714円
野村資産設計ファンド2040	38,564,061円
野村資産設計ファンド2045	3,583,653円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,549,250,617円
ネクストコア	6,821,206円

野村インデックスファンド・海外5資産バランス	355,895,838円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	375,977,268円
野村資産設計ファンド2050	5,388,411円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,352,061円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,538,169円
インデックス・ブレンド(タイプ )	6,097,834円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,146,342円
インデックス・ブレンド(タイプ )	6,787,953円
野村6資産均等バランス	1,031,162,426円
野村資産設計ファンド2060	1,877,942円
NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数(除く日本・為替 ヘッジなし)連動型上場投信	2,024,254,235円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	1,134,803,071円
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA(適格機関投資家専用)	479,658,165円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT(適格機関投資家専用)	59,747,141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)	59,050円
野村DC運用戦略ファンド	102,743,087円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	6,817,394円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	5,780,695円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,865,560円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	5,329,054円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	2,291,015円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,733,512円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	924,615円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	398,365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22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22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	20,300	269,787.00	
		AGREE REALTY CORP	11,200	755,776.00	
		ALEXANDERS INC	500	128,635.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,130	4,665,079.20	



AMERICAN ASSETS TRUST INC	11,200	316,736.00	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	31,200	1,142,856.00	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	25,000	209,750.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	59,000	1,588,280.00	
AMERICOLD REALTY TRUST	44,000	1,586,640.00	
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	34,500	1,316,175.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	48,800	488,976.00	
ARA US HOSPITALITY TRUST	107,000	44,940.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	13,105.56	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	32,040	4,969,083.60	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	33,516.00	
BOSTON PROPERTIES	32,920	2,987,819.20	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,000	19,860.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	41,200	426,832.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	67,700	857,082.00	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	14,400	157,392.00	
BRT APARTMENTS CORP	2,400	25,584.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	22,130	2,069,376.30	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	22,300	406,306.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	40,000	11,844.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	16,000	16,160.00	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	67,932.00	
CITY OFFICE REIT INC	12,600	125,496.00	
CLIPPER REALTY INC	2,400	17,016.00	
COLONY CAPITAL INC	112,000	296,800.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	26,600	362,558.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,800	208,512.00	
CORECIVIC INC	27,600	271,584.00	
COREPOINT LODGING INC	8,900	35,956.00	
CORESITE REALTY CORP	9,260	1,124,997.40	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	25,600	649,216.00	
COUSINS PROPERTIES INC	33,300	1,023,642.00	
CUBESMART	44,900	1,208,259.00	
CYRUSONE INC	25,950	1,989,456.75	

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	47,000	266,020.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	60,380	8,444,143.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	53,000	209,615.00	
DOUGLAS EMMETT INC	38,100	1,151,763.00	
DUKE REALTY CORP	84,200	2,997,520.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	6,800.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	17,300	406,550.00	
EASTGROUP PROPERTIES	8,830	1,037,966.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	34,600	237,010.00	
EPR PROPERTIES	17,900	656,572.00	
EQUINIX INC	20,240	14,399,343.20	
EQUITY COMMONWEALTH	28,300	893,148.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	41,700	2,680,476.00	
EQUITY RESIDENTIAL	80,100	4,772,358.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,600	352,054.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	15,210	3,555,793.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	29,650	2,756,560.50	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	36,300.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	16,220	1,374,645.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	29,200	1,115,148.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	16,000	379,520.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	118,250.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	11,300	97,745.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46,800	1,778,400.00	
GEO GROUP INC/THE	27,600	326,508.00	
GETTY REALTY CORP	7,900	239,528.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,300	154,006.50	
GLADSTONE LAND CORP	4,200	63,966.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,200	111,044.00	
GLOBAL NET LEASE INC	20,800	346,944.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	31,100	946,684.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	48,000	1,308,480.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	118,100	3,108,392.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,800	48,594.00	

HIGHWOODS PROPERTIES INC	23,700	914,820.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	163,900	1,912,713.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	35,700	900,354.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,500	225,705.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	15,200	312,360.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	3,950	377,817.50	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,700	190,215.00	
INVITATION HOMES INC	124,100	3,454,944.00	
IRON MOUNTAIN INC	65,900	1,735,806.00	
JBG SMITH PROPERTIES	27,400	829,672.00	
KILROY REALTY CORP	22,400	1,400,672.00	
KIMCO REALTY CORP	96,900	1,232,568.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	19,000	215,460.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	56,600	603,922.00	
LIFE STORAGE INC	10,590	995,248.20	
LTC PROPERTIES INC	9,200	347,208.00	
MACERICH CO /THE	27,342	241,976.70	
MACK-CALI REALTY CORP	20,900	328,966.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	343,515	261,071.40	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	119,100	2,292,675.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,110	2,994,294.80	
MONMOUTH REIT-CLASS A	22,500	326,025.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	39,000	1,397,760.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,400	378,818.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	10,200	611,286.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,000	67,680.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,400	188,136.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	11,200	302,960.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,100	1,480,956.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,400	58,276.00	
PARAMOUNT GROUP INC	45,600	358,416.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	54,700	585,837.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,700	403,029.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	15,640.00	

PHYSICIANS REALTY TRUST	44,800	798,784.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	28,800	478,944.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	46,478.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	10,600	79,288.00	
PRIME US REIT	90,000	72,000.00	
PROLOGIS INC	169,450	15,567,371.50	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,570	602,417.40	
PUBLIC STORAGE	34,560	6,586,790.40	
QTS REALTY TRUST INC CL A	13,400	845,272.00	
REALTY INCOME CORP	78,800	4,848,564.00	
REGENCY CENTERS CORP	38,400	1,713,984.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	27,500	306,212.50	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	50,000	323,500.00	
RETAIL VALUE INC	3,221	40,584.60	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	27,100	1,110,829.00	
RLJ LODGING TRUST	38,900	376,163.00	
RPT REALTY	19,000	127,490.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,600	443,268.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	46,200	668,052.00	
SAFEHOLD INC	3,100	200,198.00	
SAUL CENTERS INC	2,700	87,723.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	7,000	83,580.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	37,000	314,130.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	70,400	4,725,248.00	
SITE CENTERS CORP	34,000	257,040.00	
SL GREEN REALTY CORP	18,900	980,343.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,700	811,071.00	
STAG INDUSTRIAL INC	33,600	977,760.00	
STORE CAPITAL CORP	49,200	1,205,400.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	24,000	146,160.00	
SUN COMMUNITIES INC	21,820	3,106,295.20	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	51,600	448,404.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	22,000	157,740.00	
TAUBMAN CENTERS INC	14,200	529,802.00	

	TERRENO REALTY CORP	15,500	834,520.00	
	UDR INC	67,100	2,533,696.00	
	UMH PROPERTIES INC	8,400	106,512.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,940	250,429.20	
	URBAN EDGE PROPERTIES	27,100	288,073.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	6,900	82,731.00	
	VENTAS INC	85,300	3,053,740.00	
	VEREIT INC	243,000	1,647,540.00	
	VICI PROPERTIES INC	105,300	2,367,144.00	
	VORNADO REALTY TRUST	36,600	1,432,890.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	42,000	42,000.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	18,600	403,806.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	27,400	507,174.00	
	WELLTOWER INC	93,100	4,748,100.00	
	WHITESTONE REIT	8,300	57,104.00	
	WP CAREY INC	39,500	2,723,920.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	26,300	251,691.00	
小計	銘柄数：157	5,768,828	186,608,107.91	
			(19,924,147,681)	
	組入時価比率：74.2%		74.6%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,700	561,426.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	123,680.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,600	159,768.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	18,700	931,634.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	33,600	434,112.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,000	168,000.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	10,900	141,482.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	12,200	167,628.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	15,700	165,321.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,800	136,136.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	24,900	357,813.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,700	449,503.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	33,200	333,328.00	

	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,700	199,198.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	11,400	199,500.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,000	82,960.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,600	68,402.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	7,200	248,040.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	18,200	192,738.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	35,400	558,966.00	
	SLATE OFFICE REIT	5,900	22,302.00	
	SLATE RETAIL REIT	4,300	43,860.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	15,400	319,704.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	15,000	165,000.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	10,000	57,000.00	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	4,700	86,010.00	
小計	銘柄数：26	368,800	6,373,511.00	
			(499,492,057)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
ユーロ	AEDIFICA	6,160	629,552.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	35,800	492,250.00	
	ALTAREA	840	117,600.00	
	BEFIMMO S.C.A.	5,200	211,640.00	
	COFINIMMO	5,660	718,820.00	
	COVIVIO	10,300	699,370.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	8,800	112,992.00	
	GECINA SA	12,520	1,428,532.00	
	HAMBORNER REIT AG	16,000	137,968.00	
	HIBERNIA REIT PLC	156,000	173,160.00	
	ICADE	6,420	406,707.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,000	34,200.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	55,900	451,113.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	5,300	119,780.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	100,000	140,000.00	
	KLEPIERRE	48,100	847,762.50	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,000	66,500.00	
	MERCIALYS	5,200	39,832.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	85,500	666,472.50	

小計	MONTEA	2,610	228,636.00
	NSI NV	3,700	132,645.00
	RETAIL ESTATES	2,600	155,480.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	31,700	1,749,840.00
	VASTNED RETAIL NV	4,600	87,400.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,400	721,035.00
	WERELDHAVE NV	10,000	85,150.00
	銘柄数：26	672,310	10,654,437.00 (1,271,820,144)
組入時価比率：4.7%		4.8%	
英ボンド	AEW UK REIT PLC	32,000	22,528.00
	ASSURA PLC	542,000	441,188.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	36,000	366,840.00
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	190,000	138,510.00
	BRITISH LAND	218,000	883,336.00
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	200,000	342,400.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	9,300	9,681.30
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	146,000	159,140.00
	DERWENT LONDON PLC	24,200	720,192.00
	ELITE COMMERCIAL REIT	60,000	42,300.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	146,000	81,176.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	58,100	377,650.00
	HAMMERSON PLC	181,000	189,416.50
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	9,200.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	172,600	1,045,610.80
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	191,000	426,312.00
	LXI REIT PLC	123,000	140,220.00
	NEWRIVER REIT PLC	63,000	42,651.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	131,000	89,735.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	283,000	461,856.00
	RDI REIT PLC	56,000	43,792.00
	REGIONAL REIT LTD	100,000	75,000.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	47,700	352,741.50
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	110,000	35,970.00	
SEGRO PLC	251,200	2,211,564.80	

	SHAFTESBURY PLC	50,400	287,532.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	80,000	76,800.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	386,000	563,560.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	198,000	130,680.00	
	UNITE GROUP PLC	82,200	768,570.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	30,400	212,496.00	
小計	銘柄数：31	4,382,100	10,748,648.90	
			(1,416,456,952)	
	組入時価比率：5.3%		5.3%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	86,000	239,080.00	
	APN INDUSTRIA REIT	30,000	79,800.00	
	ARENA REIT	63,000	148,680.00	
	BWP TRUST	111,000	437,340.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	78,000	163,800.00	
	CHARTER HALL GROUP	107,000	1,080,700.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	96,000	443,520.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	101,000	360,570.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	54,000	140,940.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	430,000	384,850.00	
	DEXUS	249,000	2,502,450.00	
	GDI PROPERTY GROUP	130,000	157,950.00	
	GOODMAN GROUP	369,200	5,630,300.00	
	GPT GROUP	438,000	1,957,860.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	68,000	228,480.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	40,000	126,400.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	59,000	276,120.00	
	MIRVAC GROUP	906,000	2,120,040.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	219,000	432,525.00	
	RURAL FUNDS GROUP	80,000	167,200.00	
	SCENTRE GROUP	1,217,000	2,689,570.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	234,000	554,580.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	559,000	2,023,580.00	
	VICINITY CENTRES	924,000	1,399,860.00	
	WAYPOINT REIT LTD	161,000	444,360.00	
小計	銘柄数：25	6,809,200	24,190,555.00	



			(1,762,523,837)	
	組入時価比率：6.6%		6.6%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	180,000	208,800.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	259,000	549,080.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	360,000	388,800.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	250,000	417,500.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	80,000	205,600.00	
小計	銘柄数：5	1,129,000	1,769,780.00	
			(121,088,347)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
香港ドル	CHAMPION REIT	460,000	1,932,000.00	
	FORTUNE REIT	320,000	2,265,600.00	
	LINK REIT	481,400	31,627,980.00	
	PROSPERITY REIT	260,000	608,400.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	240,000	938,400.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	340,000	1,264,800.00	
小計	銘柄数：6	2,101,400	38,637,180.00	
			(532,420,340)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	91,000	113,750.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	209,860	119,620.20	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	687,760	2,145,811.20	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	429,956	464,352.48	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	663,964	1,148,657.72	
	CAPITALAND MALL TRUST	658,000	1,335,740.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	181,136	237,288.16	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	200,000	224,000.00	
	ESR REIT	509,760	206,452.80	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	200,000	107,000.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	120,000	86,400.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	169,596	415,510.20	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000	70,000.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	545,746	638,522.82	
	KEPPEL DC REIT	281,211	694,591.17	

	KEPPEL REIT	443,000	491,730.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	160,000	117,600.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	350,000	50,050.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	495,716	1,001,346.32	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	343,000	974,120.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	695,000	1,348,300.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	490,000	465,500.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	610,216	244,086.40	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	91,000	311,220.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,764	81,312.68	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	103,000	78,280.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	161,306	64,522.40	
	SPH REIT	210,000	187,950.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	330,000	181,500.00	
	SUNTEC REIT	532,000	766,080.00	
小計	銘柄数：30	10,321,991	14,371,294.55	
			(1,097,679,477)	
	組入時価比率：4.1%		4.1%	
ウォン	LOTTE REIT CO LTD	20,000	116,200,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,546	43,858,200.00	
小計	銘柄数：2	26,546	160,058,200.00	
			(14,085,121)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
新シェケル	REIT 1 LTD	40,000	550,000.00	
小計	銘柄数：1	40,000	550,000.00	
			(17,000,500)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計			26,656,714,456	
			(26,656,714,456)	

(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22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	163,657,055	-	159,950,001	3,707,054
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	17,192,410	-	17,095,200	97,210
カナダドル	6,296,080	-	6,268,800	27,280
英ポンド	3,990,540	-	3,953,100	37,440
シンガポールドル	6,905,790	-	6,873,300	32,490
合計	-	-	-	3,804,264

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040

2020年7月31日現在

資産総額	57,100,163円
負債総額	64,019円
純資産総額（ - ）	57,036,144円
発行済口数	54,474,492口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0470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

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

## （参考）外国債券マザーファンド

2020年7月31日現在

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

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2020年7月31日現在

資産総額	6,733,067,784円
負債総額	13,654,125円
純資産総額（ - ）	6,719,413,659円
発行済口数	5,107,131,482口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3157円

## （参考）国内株式マザーファンド

2020年7月31日現在

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

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2020年7月31日現在

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

## （参考）新興国株式マザーファンド

2020年7月31日現在

資産総額	43,614,991,060円
負債総額	128,662,473円
純資産総額（ - ）	43,486,328,587円
発行済口数	34,434,363,042口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2629円

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2020年7月31日現在

資産総額	37,696,300,104円
負債総額	1,963,621,779円
純資産総額（ - ）	35,732,678,325円
発行済口数	16,945,019,593口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1087円

## （参考）海外REITインデックス マザーファンド

2020年7月31日現在

資産総額	27,141,648,646円
負債総額	31,016,999円
純資産総額（ - ）	27,110,631,647円
発行済口数	13,198,090,336口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0541円

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

##### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

##### (3) 受益権の譲渡

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

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

委託者は、上記の振替について、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、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7月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)会社の機構

###### (a)会社の意思決定機構

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

###### 代表取締役・業務執行取締役

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

###### 監査等委員会

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



## (b)投資信託の運用体制



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年6月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	1,011	30,063,056
単位型株式投資信託	182	833,280
追加型公社債投資信託	14	5,668,377
単位型公社債投資信託	461	1,626,797
合計	1,668	38,191,510

### 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】

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(資産の部)</b>					
<b>流動資産</b>					
現金・預金			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
<b>固定資産</b>					
<b>有形固定資産</b>					
建物	2	320		295	
器具備品	2	393		349	
<b>無形固定資産</b>					
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

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			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					
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】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
		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	当事業年度
	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	(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
經常利益			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 準備金	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		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								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	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	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。)</p> <p>時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>								

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

#### [ 未適用の会計基準等 ]

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

##### (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

##### (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

##### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。



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

## (1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

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

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

## その他有価証券

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

## (6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

## 注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 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。

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

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.7%
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業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

## 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)
31.0%	31.0%
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
0.1%	0.0%
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
5.6%	4.4%
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
2.6%	2.6%
外国税額控除	外国税額控除
0.6%	0.7%
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
0.3%	0.2%
その他	その他
1.3%	0.4%
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
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

##### 売上高

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

##### 有形固定資産

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

#### (3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 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  役員の兼任	資金の借入 (*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息 の支払	1	未払費用	-

(イ) 子会社等  
該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (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㈱（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㈱（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。

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

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

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

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



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

## 5【その他】

### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2)訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託者

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

\* 2020年6月末現在

#### (2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(c)事業の内容
株式会社ゆうちょ銀行	3,500,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	

\* 2020年6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・連絡等を行いません。

#### (2)販売会社

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

### 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

#### (1)受託者

該当事項はありません。

## (2)販売会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 9月 3日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年 9月18日	有価証券届出書
2019年 9月18日	有価証券報告書
2019年10月 1日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年 3月16日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年 3月16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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

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

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040の2019年6月25日から2020年6月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040の2020年6月22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、継続企業的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。