

【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 (D C ・ つみたて N I S A) 2 0 5 0 |
| 【発行者名】 | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | C E O 兼代表取締役社長 中川 順子 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都江東区豊洲二丁目 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。

<商品分類>

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

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

(野村資産設計ファンド(D C ・ つみたて N I S A) 2050)

《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 | |
| 追 加 型 | 海 外 内 外 | 債 券 不動産投信 その他資産 () 資産複合 | インデックス型 特 殊 型 |

《属性区分表》

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

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

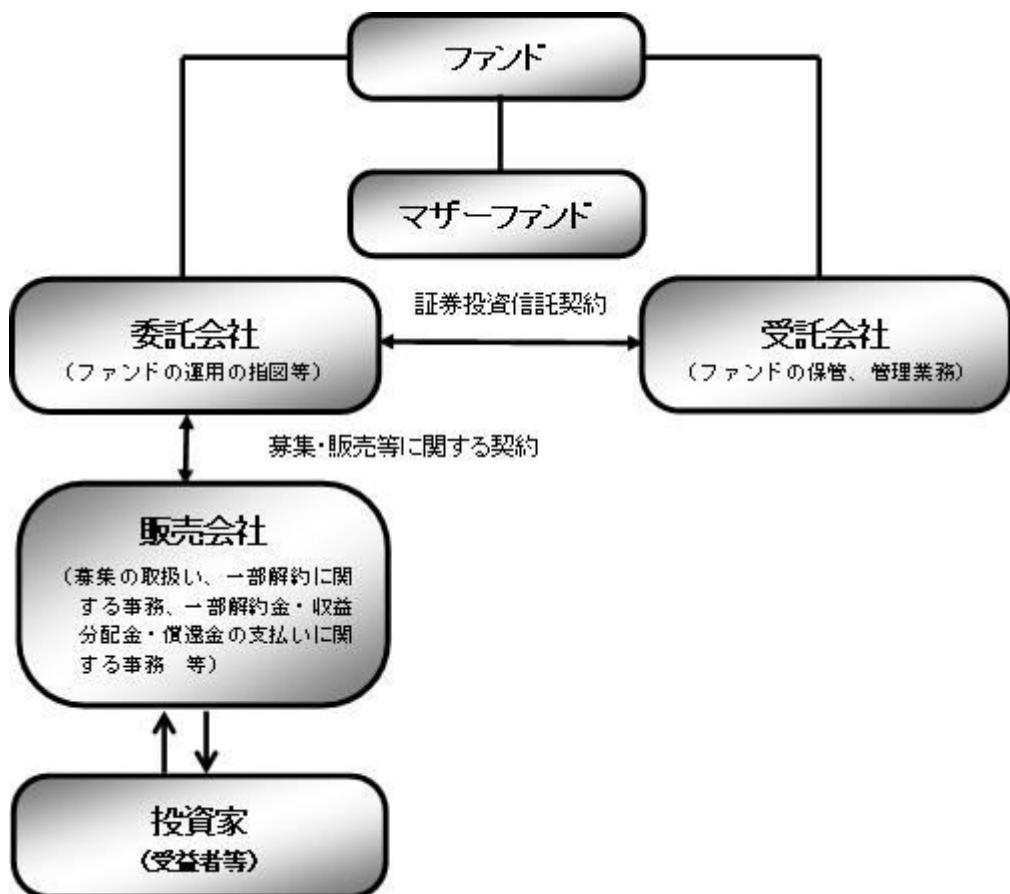
[特殊型]

- (1)ブル・ペア型…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標・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 】

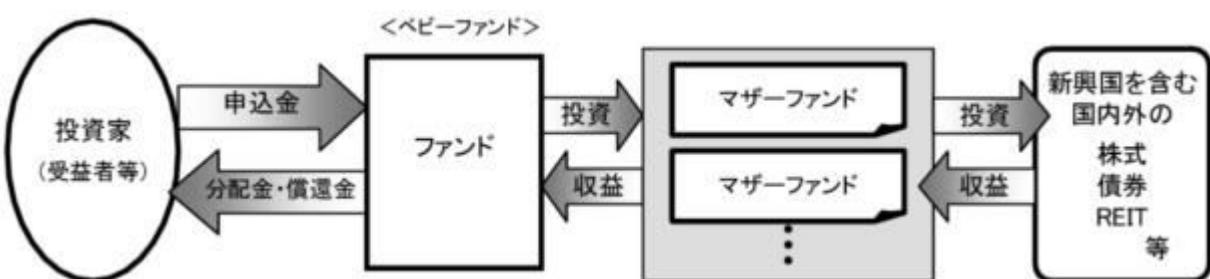
| | |
|------------|--|
| 2017年8月31日 | 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始 |
| 2019年10月1日 | 「野村資産設計ファンド（D C）2050」から「野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2050」へ名称を変更 |

(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います。



| | |
|--------------------|----------------------------------|
| ファンド | 野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A ）2050 |
| マザーファンド (親投資信託) | 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 |
| 委託会社(委託者) | 野村アセットマネジメント株式会社 |

| | |
|------------------|------------|
| 受託会社(受託者) | 野村信託銀行株式会社 |
|------------------|------------|

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 野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月 1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村
アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月 1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

2050年6月の決算日の翌日（第34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、各々以下の対象指數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 | 対象指數 |
|-----------------------------|---------|-------------------------------------|
| 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) をもとに、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-KOKUSAIMザーファンド | 外国の株式 | MSCI-KOKUSAII指数（円ベース・為替ヘッジなし） ・ MSCI-KOKUSAII 指数をもとに、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 (預託証書) ^{*1} を含みます。） | MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） ・ MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。 |
| J - REITインデックス マザーファンド | J-REIT ^{*2} | 東証REIT指数（配当込み） |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 日本を除く世界各国 のREIT ^{*3} | S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） ・ S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。 |

*1 Depositary Receipt (預託証書) 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。

ファンダは、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。

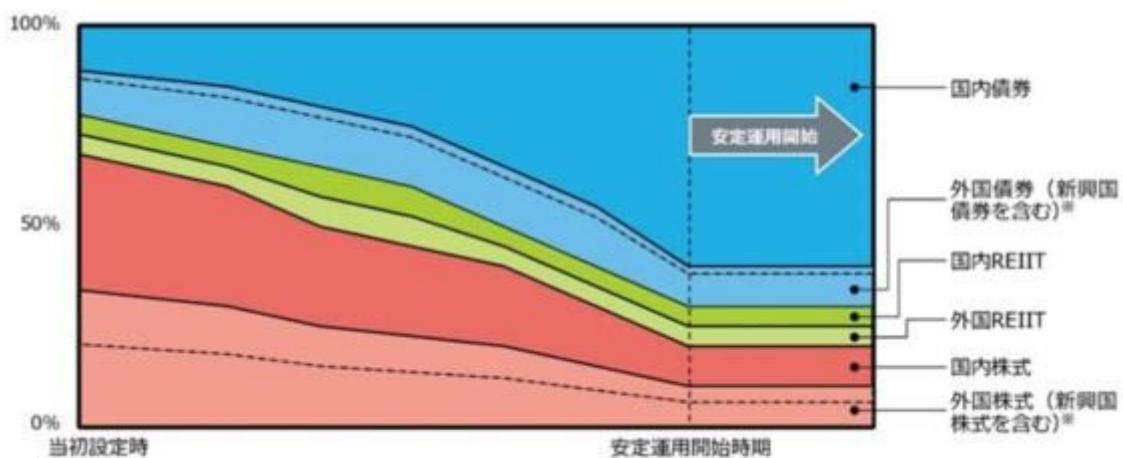
定期的な基本投資割合の変更は、家計や市場の構造変化等を考慮し、原則年1回行なうことを基本とします。

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 | 11.0% | 60% | 12.5% |
| 外国債券 | 外国債券マザーファンド | 9.0% | 10% | 8.1% |
| | 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | 2.0% | | 4.4% |
| 国内株式 | 国内株式マザーファンド | 34.0% | 10% | 32.5% |
| 外国株式 | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 20.4% | 10% | 18.7% |
| | 新興国株式マザーファンド | 13.6% | | 13.8% |
| 国内REIT | J-REITインデックス マザーファンド | 5.0% | 5% | 5.0% |
| 外国REIT | 海外REITインデックス マザーファンド | 5.0% | 5% | 5.0% |

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。

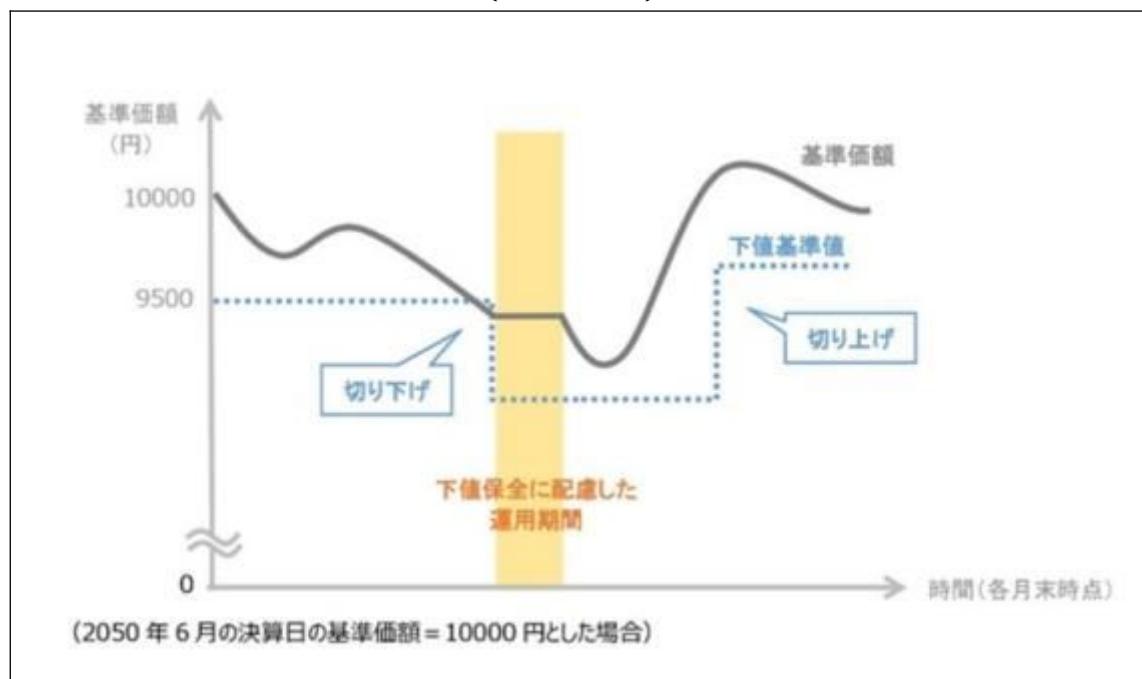
安定運用開始時期以降は、各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する各資産への実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する運用（「下値保全に配慮した運用」といいます。）を行ないます。

各資産への実質的なエクspo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、2050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2050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spoージャーを引き上げます。

基準価額と下値保全に配慮した運用（イメージ図）



実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。ただし、2050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、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、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みますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるのですが、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、アドバイサー又は貸主となっている可能性があります。

ジャー・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ponサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参考する証券、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pon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、又は金融市场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pon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のですが、インデックス・スpon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ponサーに帰属し、インデックス・スpon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、ジャー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エー、JPMSL、ジャー・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をご覧ください。

当情報の著作権は、ジャー・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、株価指値の算出、指値の公表、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の指値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指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の指値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の指數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、同指數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指數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指數は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指數は、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指數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指數の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIとその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指數は、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指數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指數の決定、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指數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指數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數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指數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、本件指數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指數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數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指數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、本件指數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。本件指數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指數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指數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指數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指數（配当込み）

東証REIT指數（配当込み）の指數値及び東証REIT指數（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、株価指數の算出、指數値の公表、利用など東証R

EIT指数（配当込み）に関するすべての権利及び東証REIT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REIT指数（配当込み）の指數値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数（配当込み）の指數値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数（配当込み）の商標の変更若しくは使用的の停止を行うことができます。

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

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

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

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

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

(株)東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数（配当込み）の指數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、責任を負いません。

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-BP1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（預託証書）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。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（5）投資制限 、 、 及び 」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。）

二．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみたす資産

- ・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。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約

権付社債」といいます。)

6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 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

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

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、債券等エクスポート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・マーケッツ・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・マーケッツ・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トジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ等エクスポート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ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポートジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ等エクスポート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トジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ等エクスポート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（預託証書）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（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

スポージャー、債券等エクスポートジャーヤーおよびデリバティブ等エクスポートジャーヤ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（これに準ずるものも含みます。）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トジャーヤー、債券等エクスポートジャーヤーおよびデリバティブ等エクスポートジャーヤ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。

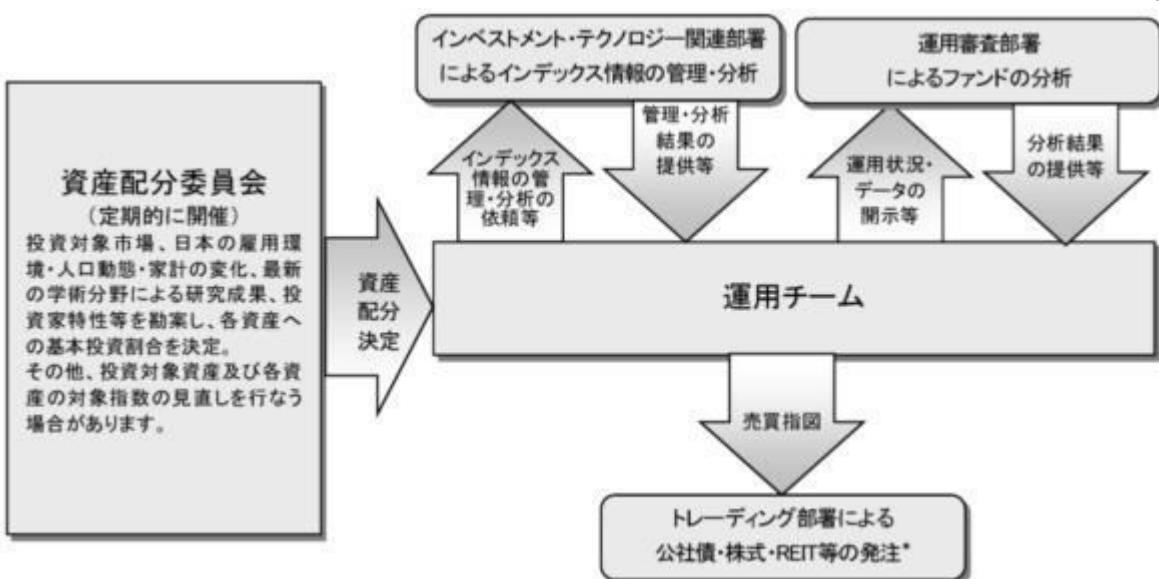
同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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トジャー、債券等エクスポートジャーおよびデリバティブ等エクスポート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。



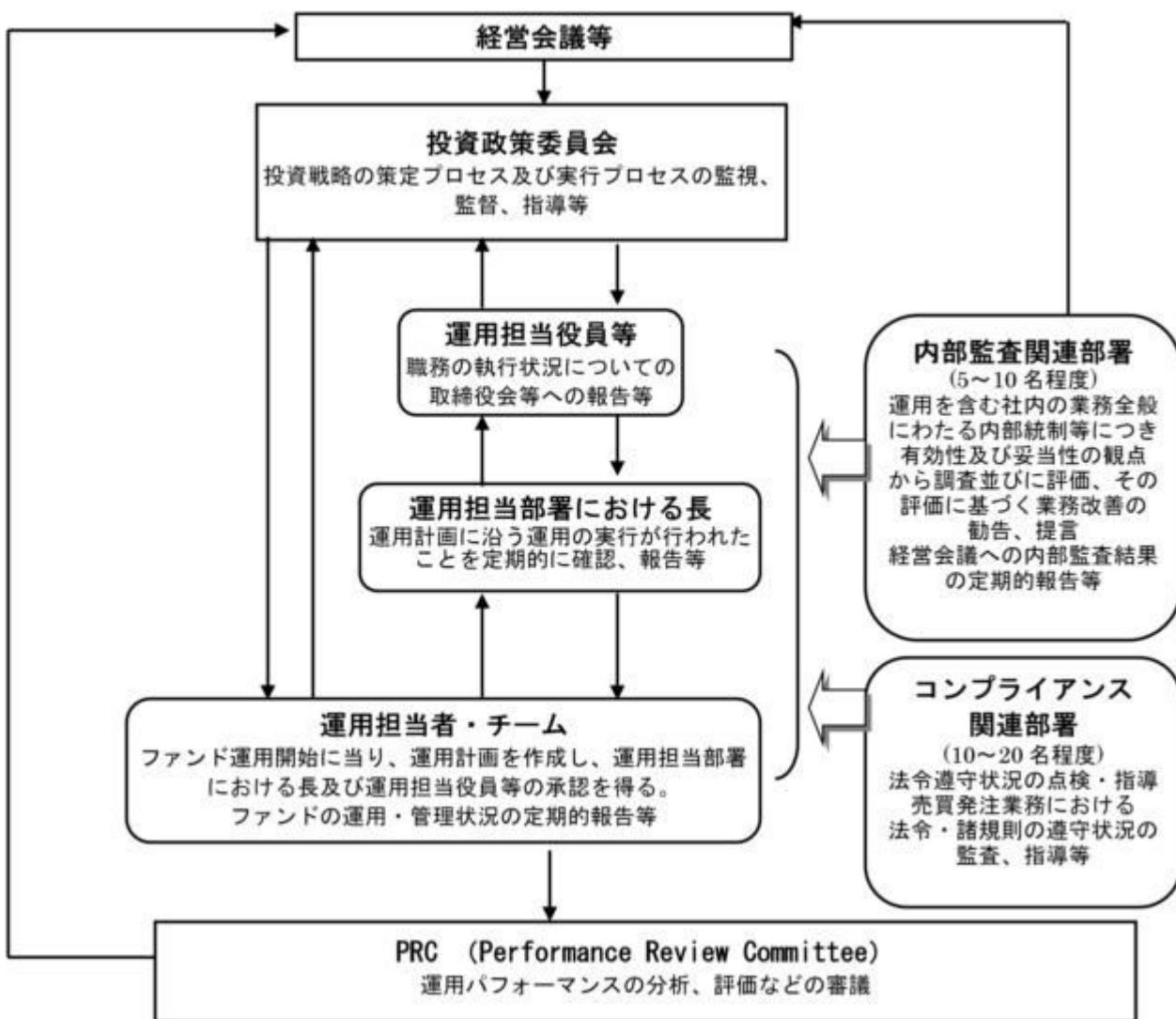
* 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴なう裁量権は付与しないものとします。）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドに代行させます。

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自、取扱い基準を設けております。

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

す。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（4）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

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

3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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る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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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たときは、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たときは、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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り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、資金借り入れ（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な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

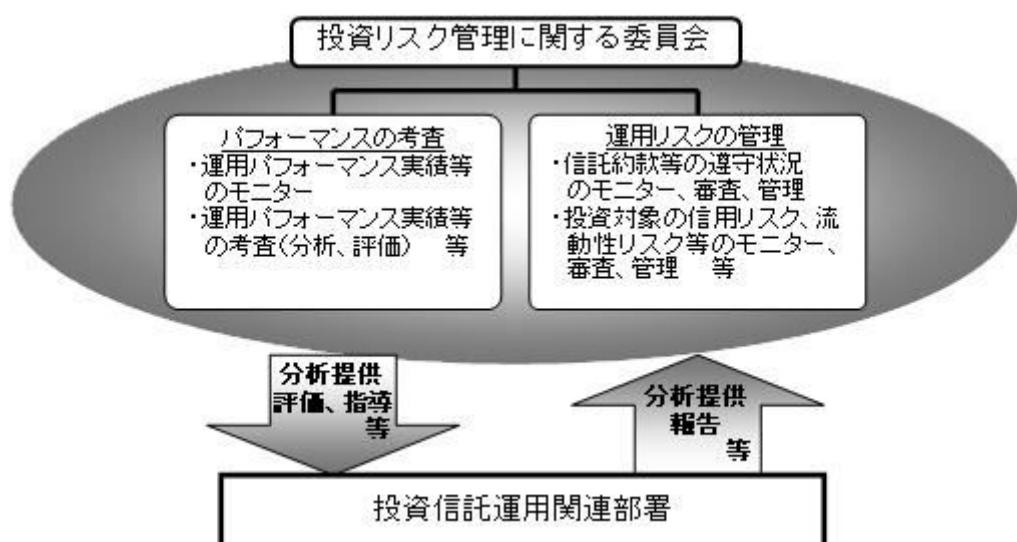
リスク管理関連の委員会

パフォーマンスの考查

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查（分析、評価）の結果の報告、審議を行ないます。

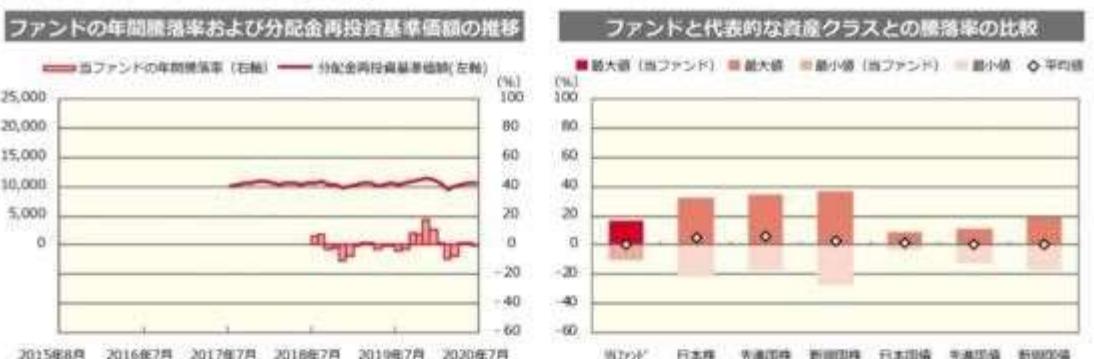
運用リスクの管理

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)



- * 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。
- * 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標> | |
|---|--|
| ○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み） | |
| ○先進国株：MSCI-KOKUSA1指標（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-BP1 国債 | |
| ○先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） | |
| ○新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース） | |

■ 代表的な資産クラスの指標の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指標の算出、権利の公表、利用など同指標に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- MSCI-KOKUSA1指標（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指標（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 が開発した指標です。同指標に対する著作権、知的所有権の他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指標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-BP1 国債・・・NOMURA-BP1 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BP1 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-BP1 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 の知的財産により運営され、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。同指標は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指標に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指標」と呼びます）についてここに提供された情報は、指標のレベルも含め、但しそれに附帯することなく、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ームーション、或いは指標に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものではありません。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はありません。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ていますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング、ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットマークを行ったりすることがあります。また、発行体の引受人、ブレースメント・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 JP Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指標スポンサー」）は、指標に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保険または販売促進を行いません。証券成りは金融商品全般、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標に運動させる或いはそれを目的とする推薦の苟否について、指標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。指標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。指標は信頼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、また指標に付随する情報について保証するものではありません。指標は指標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標スポンサーに帰属します。
- JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA; JPSI; JP Morgan Securities PLC. またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4 【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

申込手数料はありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に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ヶ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～33期 (設定日～2050年決算日) | 34期以降 (2050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ます。

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

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

(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。

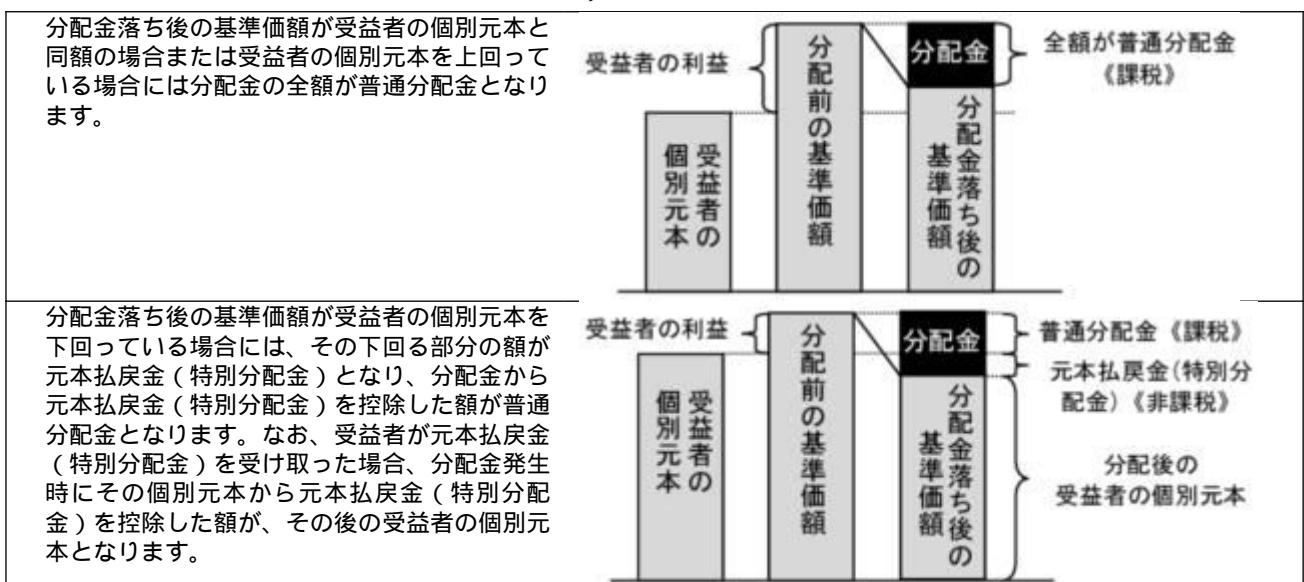
個別元本について

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。

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(D C ・ つみたてN I S A) 2 0 5 0

| 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 | 40,812,987 | 99.89 |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) | | 41,364 | 0.10 |
| 合計(純資産総額) | | 40,854,351 | 100.00 |

(参考) 国内債券N O M U R A - B P I 総合 マザーファンド

| 資産の種類 | 国 / 地域 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|--------------------|--------|-----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 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 | 3.65 |
| | 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M S C I - K O K U S A I 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 |
| 新株予約権証券 | 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 |
| 投資証券 | アメリカ | 12,996,550 | 0.00 |
| | カナダ | 14,010,528,247 | 2.07 |
| | フランス | 117,180,818 | 0.01 |
| | イギリス | 372,900,050 | 0.05 |
| | オーストラリア | 377,695,771 | 0.05 |
| | 香港 | 986,444,067 | 0.14 |
| | | 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 |
| 投資証券 | メキシコ | 17,614,624 |
| | 南アフリカ | 16,497,625 |
| | 小計 | 34,112,249 |
| 現金・預金・その他資産(負債控除後) | | 1,907,363,444 |
| 合計(純資産総額) | | 43,486,328,587 |
| | | 100.00 |

その他の資産の投資状況

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 - R E I T 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

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 R E I T 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)2050

| 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 | 8,270,318 | 1.6148 | 13,354,910 | 1.5330 | 12,678,397 | 31.03 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド | 2,702,089 | 2.8296 | 7,645,832 | 2.9070 | 7,854,972 | 19.22 |
| 3 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 新興国株式マザーファンド | 4,719,798 | 1.1889 | 5,611,530 | 1.2629 | 5,960,632 | 14.58 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内債券N O M U R A - B P I 総合 マザーファンド | 3,826,299 | 1.3297 | 5,087,830 | 1.3322 | 5,097,395 | 12.47 |
| 5 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 外国債券マザーファンド | 1,349,114 | 2.4044 | 3,243,810 | 2.4640 | 3,324,216 | 8.13 |
| 6 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 海外R E I T インデックス マ ザーファンド | 1,008,017 | 2.0367 | 2,053,029 | 2.0541 | 2,070,567 | 5.06 |
| 7 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | J - R E I T インデックス マ ザーファンド | 966,224 | 2.1191 | 2,047,526 | 2.1087 | 2,037,476 | 4.98 |
| 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 | 1,359,985 | 1.3119 | 1,784,165 | 1.3157 | 1,789,332 | 4.37 |

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-BPI総合 マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|------|------|-------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第130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334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352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133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329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343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350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344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351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129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332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347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341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328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131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353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355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M S C I - K O K U S A I マザーファンド

| 順位 | 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|--------|----|------------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 株式 | APPLE INC | コンピュータ・周辺機器 | 689,980 | 26,679.27 | 18,408,166,854 | 40,245.89 | 27,768,863,322 | 4.10 |
| 2 | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア | 1,139,400 | 16,769.47 | 19,107,136,397 | 21,327.94 | 24,301,054,836 | 3.59 |
| 3 | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | インターネット販売・通信販売 | 66,720 | 206,036.89 | 13,746,781,702 | 319,226.64 | 21,298,801,955 | 3.15 |
| 4 | アメリカ | 株式 | FACEBOOK INC-A | インターネット・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 | インターネット・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 | インターネット・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 | 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 | インターネット・メディアおよびサービス | 3.95 |

| | |
|-------------------------|-------|
| 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 | インターネット・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 | インターネット・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 | インターネット・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ィート投資法人 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トファンド投資法人 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 | アクティビア・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(D C ・ つみたてN I S A) 2 0 5 0

該当事項はありません。

(参考) 国内債券N O M U R A - B P I 総合 マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(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M S C I - K O K U S A I 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 - R E I T インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 海外R E I T インデックス マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村資産設計ファンド(D C ・ つみたてN I S A) 2 0 5 0

該当事項はありません。

(参考) 国内債券N O M U R A - B P I 総合 マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(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M S C I - K O K U S A I マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類 | 国 / 地域 | 取引所 | 名称 | 買建 / 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額(円) | 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(円) | 評価額(円) | 投資比率(%) | | |
|----------|--------|----------------|---|---------|-----|-----|------------|---------------|------------|---------------|------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | インターランチネンタル取引所 | 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 |

| | | | | | | | | | | |
|-----------|-----------|------------------------------------|----|-----|-----|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| シンガポール取引所 | 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(円) | 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(D C ・ つみたて N I S A) 2 0 5 0

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) | 7 | 7 | 1.0526 | 1.0531 |
| 第2計算期間 | (2019年 6月24日) | 15 | 15 | 1.0425 | 1.0430 |
| 第3計算期間 | (2020年 6月22日) | 37 | 37 | 1.0499 | 1.0504 |
| | 2019年 7月末日 | 17 | | 1.0567 | |
| | 8月末日 | 18 | | 1.0251 | |
| | 9月末日 | 22 | | 1.0620 | |
| | 10月末日 | 25 | | 1.1001 | |
| | 11月末日 | 27 | | 1.1154 | |

| | | | | |
|------------|----|--|--------|--|
| 12月末日 | 28 | | 1.1356 | |
| 2020年 1月末日 | 30 | | 1.1242 | |
| 2月末日 | 29 | | 1.0573 | |
| 3月末日 | 27 | | 0.9481 | |
| 4月末日 | 31 | | 0.9930 | |
| 5月末日 | 35 | | 1.0313 | |
| 6月末日 | 38 | | 1.0464 | |
| 7月末日 | 40 | | 1.0502 | |

【分配の推移】

野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050

| | 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）2050

| | 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 | 5.3% |
| 第2計算期間 | 2018年 6月23日～2019年 6月24日 | 0.9% |
| 第3計算期間 | 2019年 6月25日～2020年 6月22日 | 0.8% |

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）2050

| | 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 | 7,018,323 | 196,166 | 6,822,157 |
| 第2計算期間 | 2018年 6月23日～2019年 6月24日 | 9,778,587 | 1,957,990 | 14,642,754 |
| 第3計算期間 | 2019年 6月25日～2020年 6月22日 | 24,259,426 | 3,091,526 | 35,810,654 |

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 | 31.0 |
| 2 | 外国株式MSCI-KOKUSAIMマザーファンド | 19.2 |
| 3 | 新興国株式マザーファンド | 14.6 |
| 4 | 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 12.5 |
| 5 | 外国債券マザーファンド | 8.1 |
| 6 | 海外REITインデックス マザーファンド | 5.1 |
| 7 | J-REITインデックス マザーファンド | 5.0 |
| 8 | 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | 4.4 |

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 | 0.1 |
| 2 | 国庫債券 利付(10年)第334回 | 国債証券 | 0.1 |
| 3 | 国庫債券 利付(10年)第352回 | 国債証券 | 0.1 |
| 4 | 国庫債券 利付(5年)第133回 | 国債証券 | 0.1 |
| 5 | 国庫債券 利付(10年)第329回 | 国債証券 | 0.1 |

・「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 | 0.1 |
| 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 | 1.0 |
| 2 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 0.7 |
| 3 | ソニー | 電気機器 | 0.7 |
| 4 | キーエンス | 電気機器 | 0.6 |
| 5 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 0.5 |

・「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 | 0.8 |
| 2 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア | 0.7 |
| 3 | AMAZON.COM INC | インターネット販売・通信販売 | 0.6 |
| 4 | FACEBOOK INC-A | インターネット・メディアおよびサービス | 0.3 |
| 5 | ALPHABET INC-CL C | インターネット・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 | 1.1 |
| 2 | TENCENT HOLDINGS LTD | インターネット・メディアおよびサービス | 0.9 |
| 3 | TAIWAN SEMICONDUCTOR | 半導体・半導体製造装置 | 0.8 |
| 4 | XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF | — | 0.6 |
| 5 | SAMSUNG ELECTRONICS | コンピュータ・周辺機器 | 0.5 |

・「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 | 0.3 |
| 2 | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.3 |
| 3 | ジャパンリアルエスティート投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.3 |
| 4 | G L P 投資法人 投資証券 | 投資証券 | 0.3 |
| 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 | 0.2 |

・「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 | 0.3 |
| 2 | EQUINIX INC | 投資証券 | 0.3 |
| 3 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 投資証券 | 0.2 |
| 4 | PUBLIC STORAGE | 投資証券 | 0.1 |
| 5 | WELLTOWER INC | 投資証券 | 0.1 |

■ 年間收益率の推移（曆年ベース）



- ・ファンドの年間收益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドは合成指數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、曆年ベースで收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）から年末までの收益率。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの收益率。

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

ファンドの申込(販売)手続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できます。

- ・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号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、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けを中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付けを取り消す場合があります。

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

2 【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、委託者に1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けについては、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けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・換金価額は、換金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 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額 |
| 株式 | 原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。 |
| REIT (不動産投資信託) | 原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。 |
| 外貨建資産 | 原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。 |

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】

2075年6月24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たときは、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。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

() 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、これ行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないとき

は、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- ()上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ()上記()から()までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記()から()までに規定するこの信託契約の解約の手続を行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」をいいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- ()委託者は、上記()の事項（上記()の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- ()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っても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決され

た場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

して5営業日までに支払いを開始します。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（D C・つみたてN I S A）2050】

(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) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 48,232 | 110,021 |
| 親投資信託受益証券 | 15,249,923 | 37,559,728 |
| 未収入金 | 13,833 | 35,211 |
| 流動資産合計 | <u>15,311,988</u> | <u>37,704,960</u> |
| 資産合計 | <u>15,311,988</u> | <u>37,704,960</u> |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 7,321 | 17,905 |
| 未払解約金 | 10,438 | 17,775 |
| 未払受託者報酬 | 2,706 | 6,730 |
| 未払委託者報酬 | 25,763 | 63,857 |
| その他未払費用 | 179 | 437 |
| 流動負債合計 | <u>46,407</u> | <u>106,704</u> |
| 負債合計 | <u>46,407</u> | <u>106,704</u> |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 14,642,754 | 35,810,654 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（） | 622,827 | 1,787,602 |
| （分配準備積立金） | <u>252,392</u> | <u>702,146</u> |
| 元本等合計 | <u>15,265,581</u> | <u>37,598,256</u> |
| 純資産合計 | <u>15,265,581</u> | <u>37,598,256</u> |
| 負債純資産合計 | <u>15,311,988</u> | <u>37,704,960</u> |

(2)【損益及び剩余金計算書】

(単位：円)

| | 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 |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 12,517 | 376,876 |
| 営業収益合計 | 12,517 | 376,876 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 4,615 | 11,384 |
| 委託者報酬 | 43,893 | 107,972 |
| その他費用 | 331 | 733 |
| 営業費用合計 | 48,839 | 120,089 |
| 営業利益又は営業損失() | 36,322 | 256,787 |
| 経常利益又は経常損失() | 36,322 | 256,787 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 36,322 | 256,787 |
| 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() | 38,219 | 58,933 |
| 期首剩余金又は期首次損金() | 358,910 | 622,827 |
| 剩余金増加額又は欠損金減少額 | 359,741 | 1,150,963 |
| 当期追加信託に伴う剩余金増加額又は欠損金減少額 | 359,741 | 1,150,963 |
| 剩余金減少額又は欠損金増加額 | 90,400 | 166,137 |
| 当期一部解約に伴う剩余金減少額又は欠損金増加額 | 90,400 | 166,137 |
| 分配金 | 7,321 | 17,905 |
| 期末剩余金又は期末欠損金() | 622,827 | 1,787,602 |

(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 14,642,754口 | 1. 計算期間の末日における受益権の総数 35,810,654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 1.0425円 (10,000口当たり純資産額) (10,425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 1.0499円 (10,000口当たり純資産額) (10,499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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---------------------------------------|-------------|--|--------------|---|----------|---------------------------|---|----|--------|---|----------|----------|---|---------|---------------|-----------|----------|--------------|---|-------------|-------------------|----------------|------|----------------|---|----|---------|----------------|--------|---|----|--|--|--------------|---|----------|---------------------------|---|----|--------|---|------------|----------|---|----------|---------------|-----------|------------|--------------|---|-------------|-------------------|----------------|------|----------------|---|----|---------|----------------|---------|
| <p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1"> <tr> <td>項目</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>217,788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>370,435円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>41,925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>630,148円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>14,642,754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>430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>7,321円</td> </tr> </table> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 217,788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 | 370,435円 | 分配準備積立金額 | D | 41,925円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 630,148円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 14,642,754口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 430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 | 7,321円 | <p>1. 分配金の計算過程</p> <table border="1"> <tr> <td>項目</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>496,622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>1,085,456円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>223,429円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,805,507円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>35,810,654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>504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>17,905円</td> </tr> </table> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 496,622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 | 1,085,456円 | 分配準備積立金額 | D | 223,429円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,805,507円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 35,810,654口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 504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 | 17,905円 |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 217,788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 | 370,435円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 41,925円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 630,148円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 14,642,754口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 430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 | 7,321円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 496,622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 | 1,085,456円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 223,429円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,805,507円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 35,810,654口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F × 10,000 | 504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 | 17,905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</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あります。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>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查及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> | <p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

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

(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、一般的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 6,822,157円 | 期首元本額 14,642,754円 |
| 期中追加設定元本額 9,778,587円 | 期中追加設定元本額 24,259,426円 |
| 期中一部解約元本額 1,957,990円 | 期中一部解約元本額 3,091,526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 | 39,880 | 360,362 |
| 合計 | 39,880 | 360,362 |

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 | 7,605,271 | 12,286,315 | |
| | | 外国債券マザーファンド | 1,505,441 | 3,615,015 | |
| | | 外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド | 2,565,274 | 7,242,025 | |
| | | 国内債券N O M U R A - B P I 総合 マザーファンド | 3,318,838 | 4,414,386 | |
| | | J - R E I T インデックス マザーファンド | 861,643 | 1,826,855 | |
| | | 海外R E I T インデックス マザーファンド | 924,615 | 1,884,272 | |
| | | 新興国株式マザーファンド | 4,624,512 | 5,476,809 | |
| | | 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド | 622,840 | 814,051 | |
| | | 銘柄数:8 組入時価比率:99.9% | 22,028,434 | 37,559,728 100.0% | |
| 合計 | | | | 37,559,728 | |

(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N O M U R A - B P I 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M S C I - K O K U S A I マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J - R E I T インデックス マザーファンド」および「海外R E I T インデックス 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N O M U R A - B P I 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。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 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。 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查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、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 |
| のむラップ・ファンド（保守型） | 12,709,631,678円 |
| のむラップ・ファンド（普通型） | 9,010,629,020円 |
| のむラップ・ファンド（積極型） | 1,158,950,511円 |
| 野村日本債券インデックス（野村SMA向け） | 10,843,404,236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 |
| のむラップ・ファンド（やや保守型） | 765,916,069円 |
| のむラップ・ファンド（やや積極型） | 228,123,713円 |
| インデックス・ブレンド（タイプ） | 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 2 5 V A (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 V A (適格機関投資家専用) | 288,595,622円 |
| ノムラ F O F s 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 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) | 1,412,928円 |
| マイバランス 3 0 (確定拠出年金向け) | 33,478,298,341円 |
| マイバランス 5 0 (確定拠出年金向け) | 41,114,863,694円 |
| マイバランス 7 0 (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 - B P I 総合 (確定拠出年金向け) | 49,141,387,374円 |
| マイバランス D C 3 0 | 11,107,915,273円 |
| マイバランス D C 5 0 | 8,366,913,750円 |
| マイバランス D C 7 0 | 2,642,277,011円 |
| 野村D C 国内債券インデックスファンド・NOMURA - B P I 総合 | 12,509,379,961円 |
| マイターゲット 2 0 5 0 (確定拠出年金向け) | 626,071,091円 |
| マイターゲット 2 0 3 0 (確定拠出年金向け) | 1,436,449,824円 |
| マイターゲット 2 0 4 0 (確定拠出年金向け) | 630,816,240円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (D C) 安定コース | 103,737,229円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (D C) インカムコース | 17,143,325円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (D C) 成長コース | 15,940,024円 |
| 野村資産設計ファンド (D C ・つみたてN I S A) 2 0 3 0 | 20,558,655円 |
| 野村資産設計ファンド (D C ・つみたてN I S A) 2 0 4 0 | 7,036,876円 |
| 野村資産設計ファンド (D C ・つみたてN I S A) 2 0 5 0 | 3,318,838円 |
| マイターゲット 2 0 3 5 (確定拠出年金向け) | 385,663,127円 |
| マイターゲット 2 0 4 5 (確定拠出年金向け) | 182,294,795円 |
| マイターゲット 2 0 5 5 (確定拠出年金向け) | 56,509,428円 |
| マイターゲット 2 0 6 0 (確定拠出年金向け) | 65,535,699円 |
| 野村資産設計ファンド (D C ・つみたてN I S A) 2 0 6 0 | 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 | 497,436,000,000 | 542,442,014,790 | |
| | 組入時価比率: 78.8% | | 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 公募第111回 | 200,000,000 | 203,492,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第112回 | 100,000,000 | 101,715,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第113回 | 800,000,000 | 813,064,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第114回 | 243,700,000 | 248,093,911 |
| 共同発行市場地方債 公募第115回 | 100,000,000 | 101,827,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第116回 | 200,000,000 | 203,784,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第118回 | 100,000,000 | 102,125,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第119回 | 200,000,000 | 204,172,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第120回 | 300,000,000 | 305,448,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第121回 | 100,000,000 | 101,561,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第122回 | 400,000,000 | 407,008,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第124回 | 300,000,000 | 308,244,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第126回 | 100,000,000 | 102,574,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第128回 | 700,000,000 | 715,330,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第129回 | 100,000,000 | 102,420,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第130回 | 100,000,000 | 102,658,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第132回 | 100,000,000 | 102,402,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第136回 | 200,000,000 | 204,830,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第137回 | 200,000,000 | 204,550,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第139回 | 155,000,000 | 158,523,150 |
| 共同発行市場地方債 公募第143回 | 540,000,000 | 550,897,200 |
| 共同発行市場地方債 公募第145回 | 1,000,000,000 | 1,018,910,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第156回 | 200,000,000 | 200,630,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第157回 | 300,000,000 | 300,609,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第161回 | 300,000,000 | 299,997,000 |
| 共同発行市場地方債 公募第172回 | 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 | 45,862,820,000 | 48,225,293,963 | |
| | 組入時価比率：7.0% | | 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関債券(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32回 | 100,000,000 | 101,423,000 | |
| 関西国際空港社債 財投機関債第38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61回 | 200,000,000 | 199,202,000 |
| 中日本高速道路 第63回 | 100,000,000 | 102,389,000 |
| 中日本高速道路 第66回 | 1,200,000,000 | 1,200,072,000 |
| 西日本高速道路 第20回 | 200,000,000 | 204,662,000 |
| 西日本高速道路 第22回 | 400,000,000 | 410,512,000 |
| 西日本高速道路 第23回 | 100,000,000 | 102,200,000 |
| 西日本高速道路 第30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62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68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69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71回 | 500,000,000 | 510,730,000 |
| 貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券 | 31,062,000 | 31,292,790 |
| 貸付債権担保第19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42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39回住宅金融公庫債券 | 26,256,000 | 27,115,621 |
| 貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券 | 30,110,000 | 31,491,145 |
| 貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券 | 33,786,000 | 34,277,248 |
| 貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券 | 55,912,000 | 57,626,821 |
| 貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券 | 58,020,000 | 59,256,986 |
| 貸付債権担保第44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25回住宅金融支援機構債券 | 22,940,000 | 24,779,329 |
| 貸付債権担保第28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16回住宅金融支援機構債券 | 14,404,000 | 14,666,152 |
| 貸付債権担保第42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 1 7 回住宅金融支援機構債券 | 28,946,000 | 29,493,658 |
| 貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券 | 93,300,000 | 99,271,200 |
| 貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援機構債券 | 70,400,000 | 74,388,160 |
| 貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券 | 40,690,000 | 43,613,983 |
| 貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援機構債券 | 88,227,000 | 93,851,471 |
| 貸付債権担保第 4 0 回住宅金融支援機構債券 | 97,635,000 | 102,249,230 |
| 貸付債権担保第 6 2 回住宅金融支援機構債券 | 134,619,000 | 141,288,025 |
| 貸付債権担保第 6 0 回住宅金融支援機構債券 | 130,245,000 | 137,358,981 |
| 貸付債権担保第 6 1 回住宅金融支援機構債券 | 84,148,000 | 88,432,816 |
| 貸付債権担保第 5 1 回住宅金融支援機構債券 | 32,518,000 | 34,438,513 |
| 貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援機構債券 | 75,756,000 | 80,425,599 |
| 貸付債権担保第 7 9 回住宅金融支援機構債券 | 43,674,000 | 45,548,051 |
| 貸付債権担保第 8 1 回住宅金融支援機構債券 | 93,988,000 | 98,127,231 |
| 貸付債権担保第 7 2 回住宅金融支援機構債券 | 42,494,000 | 44,325,916 |
| 貸付債権担保第 2 2 回住宅金融公庫債券 | 24,484,000 | 25,061,822 |
| 貸付債権担保第 7 0 回住宅金融支援機構債券 | 127,362,000 | 133,807,790 |
| 貸付債権担保第 3 3 回住宅金融支援機構債券 | 27,579,000 | 29,550,071 |
| 貸付債権担保第 3 4 回住宅金融支援機構債券 | 29,849,000 | 32,038,125 |
| 貸付債権担保第 3 5 回住宅金融支援機構債券 | 28,306,000 | 30,138,530 |
| 貸付債権担保第 4 6 回住宅金融支援機構債券 | 31,540,000 | 33,597,985 |
| 貸付債権担保第 5 5 回住宅金融支援機構債券 | 85,728,000 | 90,649,644 |
| 貸付債権担保第 5 6 回住宅金融支援機構債券 | 121,947,000 | 128,906,515 |
| 貸付債権担保第 5 7 回住宅金融支援機構債券 | 40,735,000 | 43,102,925 |
| 貸付債権担保第 7 6 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 1 4 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 1 5 回住宅金融支援機構債券 | | | |
| 貸付債権担保第 2 3 回住宅金融支援機構債券 | 78,880,000 | 84,282,491 | |
| 貸付債権担保第 3 2 回住宅金融支援機構債券 | 79,836,000 | 85,196,987 | |
| 貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援機構債券 | 157,090,000 | 165,285,385 | |
| 貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援機構債券 | 86,866,000 | 91,866,875 | |
| 貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援機構債券 | 141,735,000 | 148,543,949 | |
| 貸付債権担保第 7 1 回住宅金融支援機構債券 | 123,984,000 | 129,229,763 | |
| 貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援機構債券 | 95,906,000 | 101,230,701 | |
| 貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援機構債券 | 82,298,000 | 86,481,207 | |
| 貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援機構債券 | 199,244,000 | 207,819,461 | |
| 貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援機構債券 | 343,483,000 | 357,765,023 | |
| 貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援機構債券 | 52,100,000 | 54,076,674 | |
| 貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援機構債券 | 54,658,000 | 56,797,860 | |
| 貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援機構債券 | 55,935,000 | 57,924,607 | |
| 貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援機構債券 | 116,290,000 | 119,651,943 | |
| 貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援機構債券 | 122,330,000 | 124,936,852 | |
| 貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援機構債券 | 65,295,000 | 67,407,293 | |
| 貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援機構債券 | 68,912,000 | 70,933,188 | |
| 貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援機構債券 | 204,633,000 | 211,670,328 | |
| 貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援機構債券 | 211,791,000 | 219,936,481 | |
| 貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券 | 141,638,000 | 146,936,677 | |
| 貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券 | 69,566,000 | 72,046,027 | |
| 貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券 | 69,818,000 | 72,505,294 | |
| 貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券 | 253,635,000 | 256,064,823 | |
| 貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券 | 170,178,000 | 172,686,423 | |
| 貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券 | 171,128,000 | 173,395,446 | |
| | 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 | 60,065,824,000 | 63,011,430,074 | |
| | 組入時価比率: 9.2% | | 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(B F C M) 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(B F C M) 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(B F C M) 第31回円貨社債 | 100,000,000 | 95,518,000 |
| | | ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債 | 100,000,000 | 99,158,000 |
| | | ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第1回非上位円貨社債 | 200,000,000 | 200,334,000 |

| | | | |
|---------------------------------|-------------|-------------|--|
| 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 | |
| サンタンデール銀行 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 | |
| ウエストパック・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・ニュージーランド銀行 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 | |
| キリンホールディングス 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 | |
| 森ビ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 |
| 澁澤倉庫 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 組入時価比率：4.3% | 28,705,000,000 | 29,250,651,350 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)

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

| | |
|------------------------|---|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることがあります。 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 (10,000口当たり純資産額) | 2,4013円 (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 なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。 | 159,754,155,029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、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 | |
| 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 | |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | |
| 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考查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 | 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 |
| のむラップ・ファンド(保守型) | 5,709,278,603円 |
| のむラップ・ファンド(普通型) | 12,150,378,464円 |
| のむラップ・ファンド(積極型) | 2,504,634,992円 |
| 野村外国債券インデックス(野村SMA向け) | 588,325,145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 |
| のむラップ・ファンド（やや保守型） | 499,599,978円 |
| のむラップ・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D C 3 0 | 1,668,007,695円 |
| マイバランスD C 5 0 | 1,145,439,037円 |
| マイバランスD C 7 0 | 726,879,219円 |
| 野村D C 外国債券インデックスファンド | 6,080,731,953円 |
| 野村D C 運用戦略ファンド | 3,434,053,260円 |
| 野村D C 運用戦略ファンド（マイルド） | 328,337,110円 |
| マイターゲット 2 0 5 0（確定拠出年金向け） | 145,876,135円 |
| マイターゲット 2 0 3 0（確定拠出年金向け） | 208,370,309円 |
| マイターゲット 2 0 4 0（確定拠出年金向け） | 103,179,599円 |
| 野村世界 6 資産分散投信（D C）安定コース | 9,601,202円 |
| 野村世界 6 資産分散投信（D C）インカムコース | 23,803,981円 |
| 野村世界 6 資産分散投信（D C）成長コース | 8,852,537円 |
| 野村資産設計ファンド（D C・つみたてNISA）2 0 3 0 | 4,221,609円 |
| 野村資産設計ファンド（D C・つみたてNISA）2 0 4 0 | 2,509,316円 |
| 野村資産設計ファンド（D C・つみたてNISA）2 0 5 0 | 1,505,441円 |
| マイターゲット 2 0 3 5（確定拠出年金向け） | 54,840,312円 |
| マイターゲット 2 0 4 5（確定拠出年金向け） | 35,312,873円 |
| マイターゲット 2 0 5 5（確定拠出年金向け） | 15,693,180円 |
| マイターゲット 2 0 6 0（確定拠出年金向け） | 18,200,514円 |
| 野村資産設計ファンド（D C・つみたてNISA）2 0 6 0 | 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 |

| | | | |
|-------|---------------------|------------------|--|
| | 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 |
| 小計 | 銘柄数：153 | 2,143,620,000.00 | 2,445,661,700.10 (261,123,299,719) 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 |
| | 組入時価比率 : 0.8% | | (4,667,351,432) |
| | | | 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 |
| BUNDESOBLIGATION | 100,000.00 | 100,828.00 |
| BUNDESOBLIGATION | 3,700,000.00 | 3,744,511.00 |
| BUNDESOBLIGATION | 750,000.00 | 761,805.00 |
| BUNDESOBLIGATION | 1,000,000.00 | 1,019,890.00 |
| BUNDESOBLIGATION | 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% | |
| 英ポンド | 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 |

| | | | | |
|---------------|--------------------------|----------------|------------------|--|
| | UNITED KINGDOM(GOVERNMEN | 6,800,000.00 | 14,530,240.00 | |
| 小計 | 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 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 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 | |
| | 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 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 | |

| | | | |
|----------|------------------------|----------------|------------------------------------|
| | 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 |
| 小計 | 銘柄数：4 | 123,400,000.00 | 132,327,889.40 (3,535,801,204) |
| | 組入時価比率：0.6% | | 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 | 144,400,000.00 | 170,779,276.47 (12,442,978,083) |
| | 組入時価比率：2.2% | | 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% |
| リンク | MALAYSIA GOVERNMENT | 1,100,000.00 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 400,000.00 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 2,600,000.00 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 3,800,000.00 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | 400,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 400,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 6,200,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 500,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,600,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 500,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 13,500,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3,500,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,200,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5,800,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 600,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 9,600,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,600,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 7,000,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,200,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,700,000.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 280,000.00 |

| | | | |
|-------|----------------------|----------------|---|
| | 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) 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) 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) | | |
| | | | うち1年超 | 評価損益(円) |
| 市場取引以外の取引 | | | | |
| 為替予約取引 | | | | |
| 買建 | 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 | 国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、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 | 1,3070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 | |
|---|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | |
| 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク | |
| 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 | |
| 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 | |
| これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 | |
| 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用してあります。 | |
| 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查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タファンド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 | 9,323,225.00 | |
| 小計 | | 銘柄数：15 | 116,250,000.00 | 128,377,646.18 | |

| | | | |
|---------|--------------------------|-------------------|------------------------------------|
| | 組入時価比率 : 9.4% | (605,942,489) | |
| | | 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 |
| | 銘柄数 : 7 | 14,391,000.00 | 31,070,331.90 (624,513,671) |
| 小計 | 組入時価比率 : 9.7% | | 10.0% |
| | 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 |
| | 銘柄数 : 5 | 880,000,000.00 | 1,146,385,323.00 (150,061,838) |
| | 組入時価比率 : 2.3% | | 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 |
| | 銘柄数 : 5 | 10,870,000,000.00 | 12,340,814,760.00 (351,713,220) |
| | 組入時価比率 : 5.4% | | 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 |
| | 銘柄数 : 9 | 6,020,000.00 | 7,032,412.76 (214,418,265) |
| | 組入時価比率 : 3.3% | | 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 (9,016,006) |
| 小計 | | | |

| | | | |
|--------------|-------------------------|----------------|----------------|
| | 組入時価比率 : 0.1% | | 0.1% |
| ドミニカペソ 小計 | DOMINICAN REPUBLIC | 8,000,000.00 | 6,810,960.00 |
| | 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 小計 | 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 |
| | 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 小計 | 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 |
| | 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% |
| フォリント 小計 | 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 |
| | 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 |

| | | | |
|------|------------------------|----------------|---|
| | 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 |
| 小計 | 銘柄数：7 | 18,800,000.00 | 20,369,636.64 (544,276,691) 8.7% |
| | 組入時価比率：8.4% | | |
| 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) 8.7% |
| | 組入時価比率：8.5% | | |
| 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) 3.1% |
| | 組入時価比率：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 |

| | | | |
|---------|--------------------------|------------------|---|
| | 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 |
| 小計 | 銘柄数：14 | 16,320,000.00 | 17,334,579.72 (432,671,109) 6.9% |
| バーツ | 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) 9.3% |
| フィリピンペソ | REPUBLIC OF PHILIPPINES | 10,000,000.00 | 10,068,300.00 |
| | 銘柄数：1 | 10,000,000.00 | 10,068,300.00 (21,445,479) |
| | 組入時価比率：0.3% | | 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) 10.2% |
| | 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) 7.3% |
| | 組入時価比率：7.1% | | |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 1,000,000.00 | 1,021,990.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 10,000,000.00 | 10,495,900.00 |
| オフショア人民元 | 銘柄数：2 | 11,000,000.00 | 11,517,890.00 (173,804,960) 2.8% |
| 小計 | 組入時価比率：2.7% | | |
| 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 米ドル | 5,345,825 5,345,825 | - - | 5,338,000 5,338,000 |
| 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 |

(2020年 6月22日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 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つた場合、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查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**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

| | |
|----------------------------------|-------------|
| 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 | 2019年 6月25日 |
|----------------------------------|-------------|

| | |
|----------------|------------------|
| 同期中における追加設定元本額 | 257,882,366,025円 |
|----------------|------------------|

| | |
|----------------|-----------------|
| 同期中における一部解約元本額 | 69,717,244,724円 |
|----------------|-----------------|

| | |
|-------|-----------------|
| 期末元本額 | 55,506,641,673円 |
|-------|-----------------|

| | |
|-----------|------------------|
| 期末元本額の内訳* | 272,092,969,076円 |
|-----------|------------------|

| | |
|------------|--------------|
| 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 |
| のむラップ・ファンド(保守型) | 2,838,828,008円 |
| のむラップ・ファンド(普通型) | 8,875,761,120円 |
| のむラップ・ファンド(積極型) | 2,433,728,565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 |
| のむラップ・ファンド(やや保守型) | 309,561,400円 |
| のむラップ・ファンド(やや積極型) | 330,065,214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)

| 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 |
| | | ミライ特・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) |
| | | T A T E R U | 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 |
| ビ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 | |
| 錢高組 | 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 1,800株 | 貸付有価証券 |
| 大豊建設 | 13,700 | 2,395.00 | 32,811,500 | |
| 前田建設工業 | 152,700 | 852.00 | 130,100,400 100株 | 貸付有価証券 |
| 佐田建設 | 13,100 | 425.00 | 5,567,500 | |
| ナカノフドー建設 | 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 | |
| 淺沼組 | 6,800 | 4,225.00 | 28,730,000 | |
| 戸田建設 | 253,200 | 690.00 | 174,708,000 9,800株 | 貸付有価証券 |
| 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 | 10,914,300 200株 | 貸付有価証券 |
| 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 | |
| NIPPO | 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 | 42,716,000 900株 | 貸付有価証券 |
| 東亜建設工業 | 19,000 | 1,586.00 | 30,134,000 7,200株(2,700株) | 貸付有価証券 |
| 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 | 27,838,800 500株 | 貸付有価証券 |
| 五洋建設 | 241,700 | 574.00 | 138,735,800 9,100株 | 貸付有価証券 |
| 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 |
| 東京エナシス | 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 | |
| 大氣社 | 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 |
| O S J B 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 ポトラーズジャパンホールデ | 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 | |
| ダイド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 |
| キユーピー | 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 | |
| ピッ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) |
| ユーブレナ | 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 | |

| | | | |
|----------------|---------|----------|--------------------------------|
| 日本フエルト | 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 |
| 日東製綱 | 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 |
| クラウディ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 |
| ゴールドワイン | 34,500 | 7,120.00 | 245,640,000 貸付有価証券 100株 |
| デサント | 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 |
| ティカ | 14,000 | 1,451.00 | 20,314,000 | |
| 石原産業 | 34,100 | 720.00 | 24,552,000 | |
| 片倉コーポアグリ | 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 | |
| 東亞合成 | 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 |
| 積水化成品工業 | 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 | |
| ダイキヨーニシカワ | 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 S C 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 | |
| 富士フィ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 |
| コーワ | 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 | |
| シーポン | 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PMC | 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 | |
| ビオフェルミン製薬 | 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 | |
| 榮研化学 | 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 |
| キヨ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 | |
| ビービー・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 | |
| M O R E S C O | 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 |
| J X T G 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 |
| T O Y O T I R E | 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 |
| A G C | 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 |
| フジミ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 | |
| 日亜鋼業 | 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 |
| リヨービ | 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 | |

| | | | | |
|-----------------------------|---------|----------|-------------|-------------------------------|
| 稻葉製作所 | 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C o | 6,800 | 938.00 | 6,378,400 | |
| S U M C O | 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 | |
| R S T e c h n o l o g i e s | 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 |
| ホッカソーラルディングス | 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 | |
| L I X I L グループ | 283,700 | 1,630.00 | 462,431,000 | 貸付有価証券 27,800株 (1,400株) |
| 日本ファイルコン | 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 | |
| 高周波熱鍊 | 37,000 | 551.00 | 20,387,000 | 貸付有価証券 16,700株 |
| 東京製綱 | 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 | |
| バイオラックス | 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 | |

| | | | | |
|--------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| D M G 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) |
| O K K | 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 | |
| N C 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 | |
| フリュー | 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 | |
| ナブテスコ | 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 | |
| 日本エアーテック | 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 | |
| 濁谷工業 | 17,000 | 2,917.00 | 49,589,000 | |
| アイチ コーポレーション | 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 | |
| S A N K Y O | 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 | |
| オーアズミ | 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 | |
| 新昆工業 | 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 | |
| キツツ | 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 |
| プラザー工業 | 237,400 | 1,994.00 | 473,375,600 | 貸付有価証券 1,400株 |
| ミネペアミツミ | 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 | |
| IDEC | 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 |
| アルパック | 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 | |
| エスペック | 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 | |
| コーチセル | 25,900 | 924.00 | 23,931,600 | |
| イリソ電子工業 | 16,300 | 3,480.00 | 56,724,000 | |
| オプテックスグループ | 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 |
| キヤノン電子 | 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 |
| 日本車輌製造 | 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 | |
| G M B | 3,500 | 701.00 | 2,453,500 | |
| ファルテック | 3,400 | 671.00 | 2,281,400 | |
| 武藏精密工業 | 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 |
| N O K | 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 | |
| K Y B | 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 | 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 |
| ティ・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 | |
| インターラクション | 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 | 52,665,400 700株 | 貸付有価証券 |
| 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 1,400株 | 貸付有価証券 |
| 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 | |
| S H O E I | 17,000 | 2,485.00 | 42,245,000 | |
| フランスペ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 | |
| トップパン・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 | 89,816,000 100株 | 貸付有価証券 |
| タカラトミー | 87,200 | 869.00 | 75,776,800 8,600株 | 貸付有価証券 |
| 廣済堂 | 13,500 | 805.00 | 10,867,500 1,500株 | 貸付有価証券 |
| 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 | 629,640,000 100株 | 貸付有価証券 |
| 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 2,800株(2,400株) | 貸付有価証券 |
| 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 76,600株 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|--------------|-----------|-----------|---------------|--------------------|
| ツツミ | 6,100 | 1,942.00 | 11,846,200 | |
| 小松ウォール工業 | 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 |
| S B S 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 |
| ハマキヨウレックス | 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 |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| 滋澤倉庫 | 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 | |
| キユ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ран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 | |
| N E C ネッツエスアイ | 54,100 | 2,057.00 | 111,283,700 | 貸付有価証券 3,300株 |
| クロスキヤット | 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) |

| | | | | |
|-------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| ソフトクリエイトホールディングス | 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) |
| ポールトゥウィン・ピット | 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 |
| メディアドウ | 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 | |
| C A R T A H O L D I N G S | 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 |
| S H I F T | 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 |
| G M O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 | |
| G M O クラウド | 3,500 | 9,320.00 | 32,620,000 | 貸付有価証券 1,600株(1,100株) |
| S R A 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 |
| e B A S E | 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 | |
| フリーピット | 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) |
| マークライズ | 9,600 | 2,280.00 | 21,888,000 | |
| メディカル・データ・ビジョン | 14,500 | 1,225.00 | 17,762,500 | 貸付有価証券 600株 |
| g u m i | 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 | 7,500 | 1,504.00 | 11,280,000 | |
| P C I 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 |
| P R T I M E S | 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 | |
| U b i c o mホールディングス | 4,200 | 2,234.00 | 9,382,800 | |
| L I N E | 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 | |
| A O I T Y O H o l d i n g s | 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LOCAL | 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 |
| H E R O Z | 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 | |
| エックスネット | 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ＪＳＡＴ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) |
| U S E N - N E X T H O L D I N G S | 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 | |
| N T T 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 | |
| G M O 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) |
| アイドママークティング コミュニケーション | 5,700 | 494.00 | 2,815,800 | |
| K A D O K A W A | 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 | |
| カプコン | 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 |
| ホウスイ | 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 |
| ディープイエックス | 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・富士エレホーリングス | 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 | |
| ジユー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 | |
| O C H I ホールディングス | 5,500 | 1,470.00 | 8,085,000 | |
| T O K A I 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 | |
| ピューティガレージ | 3,100 | 1,706.00 | 5,288,600 | |
| ワイン・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 | |
| メディパ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 |
| SPK | 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 | |
| タカシヨー | 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 | |
| ダイトロン | 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 | |
| キヤ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 |
| 稻畑産業 | 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 | |
| リヨーサン | 21,100 | 2,280.00 | 48,108,000 | |
| 新光商事 | 30,000 | 850.00 | 25,500,000 | |
| トーホー | 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 | |
| P A L T A C | 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 | 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・ベイ 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 | |
| ジンズホールディングス | 10,100 | 6,680.00 | 67,468,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| ピックカメラ | 113,600 | 1,175.00 | 133,480,000 | |
| D C M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) |
| M o n o t a R O | 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 |
| D D 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 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| プロンコビリー | 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 |
| Hamee | 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 |
| クリエイト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) |
| キリン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 |
| SFP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 | |
| ユナイテッド・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・ホールディングス | 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 |
| TOKYO BASE | 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 |
| JM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 |
| バ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ビバ | 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 | |
| カッパ・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) |
| ハーカスレイ | 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 |
| ポプラ | 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 | |
| ハイディ日高 | 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 |
| M r M a x H D | 26,300 | 529.00 | 13,912,700 | |
| テンアライド | 17,600 | 386.00 | 6,793,600 | 貸付有価証券 8,400株 |
| A O K I 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・オーリテイリング | 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 | |
| ケーズホールディングス | 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 Drugs 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) |
| AIN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 |
| パロー・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 | |
| サックスバー 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 | 419,600 | 454.00 | 190,498,400 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|---------------------|------------|----------|---------------|----------------------|
| 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 | |
| 藍澤證券 | 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 | |
| かんぽ生命保険 | 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 |

| | | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|----------------------|
| ショーン | | | | 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 | |
| コーチーアールレー | 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 |
| シーアールレー | 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 2 1 | 251,300 | 258.00 | 64,835,400 | 貸付有価証券 97,700株 (78,600株) |
| スタートコーポレーション | 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) |
| タカラレーべン | 87,600 | 358.00 | 31,360,800 | |
| A V A N T I A | 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 |
| ジェイエイ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 | |
| U T 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 | |
| 綜合警備保障 | 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 |
| サイネット | 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) |
| ツケイ | 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DY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・ブレークスルー | 7,700 | 387.00 | 2,979,900 | |
| エスプール | 47,700 | 758.00 | 36,156,600 | |
| W D B 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 | |
| C D G | 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 |
| J P ホールディングス | 58,300 | 280.00 | 16,324,000 | |
| E P S 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 | |
| T A C | 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 |
| ティー・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 | |
| インターネットクス | 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 |
| K e e P e r 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 | |
| G u n o s y | 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H R | 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 | |
| E R I ホールディングス | 5,200 | 650.00 | 3,380,000 | |

| | | | | |
|-----------------------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| アピスト | 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 MN | 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C O M 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) |
| ペイカレント・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) |
| M S - J a p a n | 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 |
| G a m e W i t h | 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 |
| M S & C o n s u l t i n g | 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 | |
| R P A 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 |
| a n d f a c t o r y | 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 |
| 燐ホールディングス | 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 |
| K N T - C T 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 組入時価比率：98.1% | | | 431,013,776,070 100.0% | |
| 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M S C I - K O K U S A I 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 | 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 |
| 負債の部 | |
| 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 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 232,675,647,335 |
| 剰余金 | |
| 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 |

(2020年 6月22日現在)

| | |
|---------|-----------------|
| 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 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券 原則として時価で評価おります。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | <p>受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 約定日基準で計上しております。</p> |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価には、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 (10,000口当たり純資産額) | 2,8231円 (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查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 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 |
| のむラップ・ファンド(保守型) | 1,037,611,878円 |
| のむラップ・ファンド(普通型) | 8,157,050,880円 |
| のむラップ・ファンド(積極型) | 5,881,612,482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 |
| のむラップ・ファンド(やや保守型) | 198,270,024円 |
| のむラップ・ファンド(やや積極型) | 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 |
| FREEPORT-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 |
| TRANSIGM 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 | |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA | 42,900 | 89.68 | 3,847,272.00 | |
| MCDONALD'S CORP | 117,300 | 186.56 | 21,883,488.00 | |
| | 34,000 | 16.44 | 558,960.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|----------|----------------|--|
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR | | | | |
| 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 | |
| KROGER CO | 126,900 | 32.24 | 4,091,256.00 | |
| SYSSCO CORP | 75,800 | 54.26 | 4,112,908.00 | |
| | 120,900 | 44.13 | 5,335,317.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | | | | |
| 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 | |
| MCKESSON CORP | 25,600 | 156.70 | 4,011,520.00 | |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 9,700 | 179.75 | 1,743,575.00 | |
| | 20,500 | 108.27 | 2,219,535.00 | |

| | | | | |
|-----------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| QUEST DIAGNOSTICS INC | | | | |
| 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 | |
| | 23,000 | 39.44 | 907,120.00 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| COMERICA INC | | | | |
| 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 | |
| | 45,400 | 31.55 | 1,432,370.00 | |

| | | | | |
|------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| FNF GROUP | | | | |
| 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 | |
| MASTERCARD INC | 140,900 | 296.50 | 41,776,850.00 | |
| 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 |
| ADOB E 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 |
| ENTERGY 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 |
| MOODY'S 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 |
| WORLDSLNE SA | 22,600 | 70.62 | 1,596,012.00 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 20,900 | 153.20 | 3,201,880.00 |
| NEMETSCHKE 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 | |
| ILIAID 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 | |
| | AROUNDOWN 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 | |
| | VONOVA 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% | |
| 英ポンド | 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 |
| ASHTON 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 | |
| | 組入時価比率：4.8% | | | (31,412,739,620) | |
| | | | | 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 | |
| | ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 110,640 | 343.30 | 37,982,712.00 | |
| | 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 | |
| | | 5,190 | 351.00 | 1,821,690.00 | |

| | | | | |
|----------------------------|----------------------------|----------|------------------|---------------|
| SWISS LIFE HOLDING AG | | | | |
| 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) | |
| | | | 3.7% | |
| スウェーデン 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 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) | |
| | | | 1.1% | |
| シンガポール 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% | |
| 新シェケル | 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 組入時価比率：2.1% | 2,129,510 | 129,242,347.20 (13,799,205,410) 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 | |
| | 銘柄数：5 | 74,500 | 3,467,247.50 | |
| 小計 | | | (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 | |
| | 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 | |
| | 銘柄数：8 | 3,136,000 | 13,772,840.00 | |
| | | | (1,003,489,122) | |
| 小計 | 組入時価比率：0.2% | | 6.1% | |
| 香港ドル | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | 470,000 | 3,872,800.00 | |
| | LINK REIT | 330,000 | 21,681,000.00 | |
| | 銘柄数：2 | 800,000 | 25,553,800.00 | |
| 小計 | | | (352,131,364) | |
| | 組入時価比率：0.1% | | 2.1% | |
| シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 440,800 | 1,375,296.00 | |

| | | | | |
|----|-----------------------------|-----------|------------------|------|
| 小計 | 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 | |
| | 銘柄数：6 | 2,360,772 | 4,922,347.56 | |
| | 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) | | | |
| | | うち1年超 | 時価(円) | 評価損益(円) |
| 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 |
| 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 |

(2020年 6月22日現在)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|----------------------------|-----------|
| 2020年 6月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 |
| 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。 |
| 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查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。 |

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 | |
|--|-----------------|
| 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・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 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-0 | 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 BRASILIERA DE DISTRIBUICAO | 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 ELETTRICAS 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 | |
| 組入時価比率：5.2% | | | (2,066,192,743) | |
| | | | 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 | |
| | 組入時価比率：0.3% | | | (110,624,302) | |
| 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 | |
| | 組入時価比率：0.1% | | | (37,725,735) | |
| | | | | 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 | |
| 英ポンド | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 15,000 | 15.30 | 229,500.00 | |
| | 小計 | 銘柄数：1 | | 229,500.00 | |
| | 組入時価比率：0.1% | | | (30,243,510) | |
| | | | | 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 BIRACILIK 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 | |
| ZOMLION 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 LTD | 39,200 | 19.20 | 752,640.00 | |
| 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 |
| HAIDLIAO 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 HUISHAN 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 VANGE 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% | |
| リソシア | 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 組入時価比率：1.7% | | | 27,050,549.75 (675,181,721) 1.8% | |
| バーツ | 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 | |
| BUMRUNG RAD HOSPITAL PU-NVDR | 32,200 | 117.50 | 3,783,500.00 | |
| BANGKOK BANK(F) | 28,600 | 116.50 | 3,331,900.00 | |
| KASIKORN BANK PCL-NVDR | 37,300 | 95.75 | 3,571,475.00 | |
| KASIKORN BANK 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 | |
| SRISAWAD CORP PCL-NVDR | 32,000 | 57.25 | 1,832,000.00 | |
| B GRIMM POWER PCL-NVDR | 80,000 | 25.50 | 2,040,000.00 | |
| ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR | 34,000 | 53.25 | 1,810,500.00 | |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 17,300 | 258.00 | 4,463,400.00 | |
| GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR | 95,000 | 40.75 | 3,871,250.00 | |
| GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR | 59,000 | 77.25 | 4,557,750.00 | |
| RATCH GROUP PCL-NVDR | 165,000 | 36.25 | 5,981,250.00 | |
| CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 43,000 | 64.50 | 2,773,500.00 | |
| LAND & HOUSES PUB - NVDR | 133,900 | 51.00 | 6,828,900.00 | |
| 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 |
| | JOLIBEE 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 |
| | 組入時価比率 : 0.8% | | | (326,690,202) |
| | | | | 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 TUNGKAL 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) | |
| | | | 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 |
| | HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR | 4,650 | 33,300.00 | 154,845,000.00 |
| | 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 |
| | | 6,050 | 75,300.00 | 455,565,000.00 |

| | | | | |
|--|--------|------------|----------------|--|
| LG CORP | | | | |
| 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 & TECHNNOLOGY 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 | |
| | 組入時価比率：11.7% | | | (4,662,986,902) | |
| | | | | 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 | |
| | 組入時価比率：7.6% | | | (3,030,218,753) | |
| | 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 |
| | 組入時価比率 : 0.1% | | | (47,149,487) |
| 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 | |
| 組入時価比率：3.6% | | | (1,428,233,067) | |
| | | | 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 組入時価比率：2.6% | | | 36,543,021.08 (1,041,476,100) 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 組入時価比率：3.7% | 483,900 | 13,999,227.00 (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 組入時価比率：0.0% | 208,100 | 3,972,629.00 (18,750,808) 1.2% | |
| | ランド | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | 191,000 | 2,809,610.00 | |
| | 小計 | 銘柄数：1 組入時価比率：0.0% | 191,000 | 2,809,610.00 (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 |
| 売建 | | | 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 |
| 米ドル | 32,061,060 | - | 33,060 |
| 売建 | 4,275,520 | - | 4,270,400 |
| 米ドル | 4,275,520 | - | 5,120 |
| 合計 | - | - | 4,270,400 |
| | | | 5,120 |
| | | | 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。

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 |
| 剩余金 | |
| 期末剩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 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 | <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つた場合、当該価額が異なることがあります。</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 (10,000口当たり純資産額) | 2.1202円 (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查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 | 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D C運用戦略ファンド | 120,762,941円 |
| 野村D C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(D C)安定コース | 5,387,038円 |
| 野村世界6資産分散投信(D C)インカムコース | 2,670,540円 |
| 野村世界6資産分散投信(D C)成長コース | 4,966,120円 |
| 野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2030 | 2,134,989円 |
| 野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2040 | 1,615,459円 |
| 野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)2050 | 861,643円 |
| 野村資産設計ファンド(D C・つみたてN I S A)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 | |

| | | | |
|----------------------------|--------|---------------|--|
| アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 1,969 | 758,065,000 | |
| G L P 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 | |
| O n e 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 | 1,216 | 738,112,000 | |

| 投資証券 | | | |
|------------------------------|---------|--------------------------|--|
| 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 | |
| スターツ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 賃建 | 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。

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 | <u>26,902,686,062</u> |
| 資産合計 | <u>26,902,686,062</u> |
| 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 | <u>66,687,962</u> |
| 負債合計 | <u>66,687,962</u> |
| 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() | <u>13,667,628,196</u> |
| 元本等合計 | <u>26,835,998,100</u> |
| 純資産合計 | <u>26,835,998,100</u> |
| 負債純資産合計 | <u>26,902,686,062</u> |

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 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。 |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 費用・収益の計上基準 | 受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 |

| | |
|------------------------|---|
| | 約定日基準で計上しております。 |
| | 派生商品取引等損益 |
| | 約定日基準で計上しております。 |
| | 為替差損益 |
| | 約定日基準で計上しております。 |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価等に関する事項の補足説明には、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つた場合、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 (10,000口当たり純資産額) | 2.0379円 (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 | |
|--------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用してあります。 |
| 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查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 |
| NEXPPOINT 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 | |
| | MORGARD 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 SOCIMI | 14,000 | 66,500.00 |
| | MERCIALYS | 5,200 | 39,832.00 |
| | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | 85,500 | 666,472.50 |
| | 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 |
| 小計 | 銘柄数：26 | 672,310 | 10,654,437.00 (1,271,820,144) |

| | | | |
|------|---------------------------------------|-----------|-----------------|
| | 組入時価比率 : 4.7% | | 4.8% |
| 英ポンド | 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 |
| | HAMMERSOM 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 |
| | SHAFESBURY 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 INDUSTRIAL 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 INV 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 |
| | OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | 610,216 | 244,086.40 |
| | | 91,000 | 311,220.00 |

| | | | |
|-------|-------------------------------|------------|------------------------------------|
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | | |
| | 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指數先物取引 | | | | |
| 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（D C・つみたてN I S A）2 0 5 0

2020年7月31日現在

| | |
|----------------|-------------|
| 資産総額 | 40,906,429円 |
| 負債総額 | 52,078円 |
| 純資産総額（ - ） | 40,854,351円 |
| 発行済口数 | 38,900,880口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0502円 |

（参考）国内債券N O M U R A - B P I 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M S C I - K O K U S A I 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 | 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け付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2020年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あります。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。

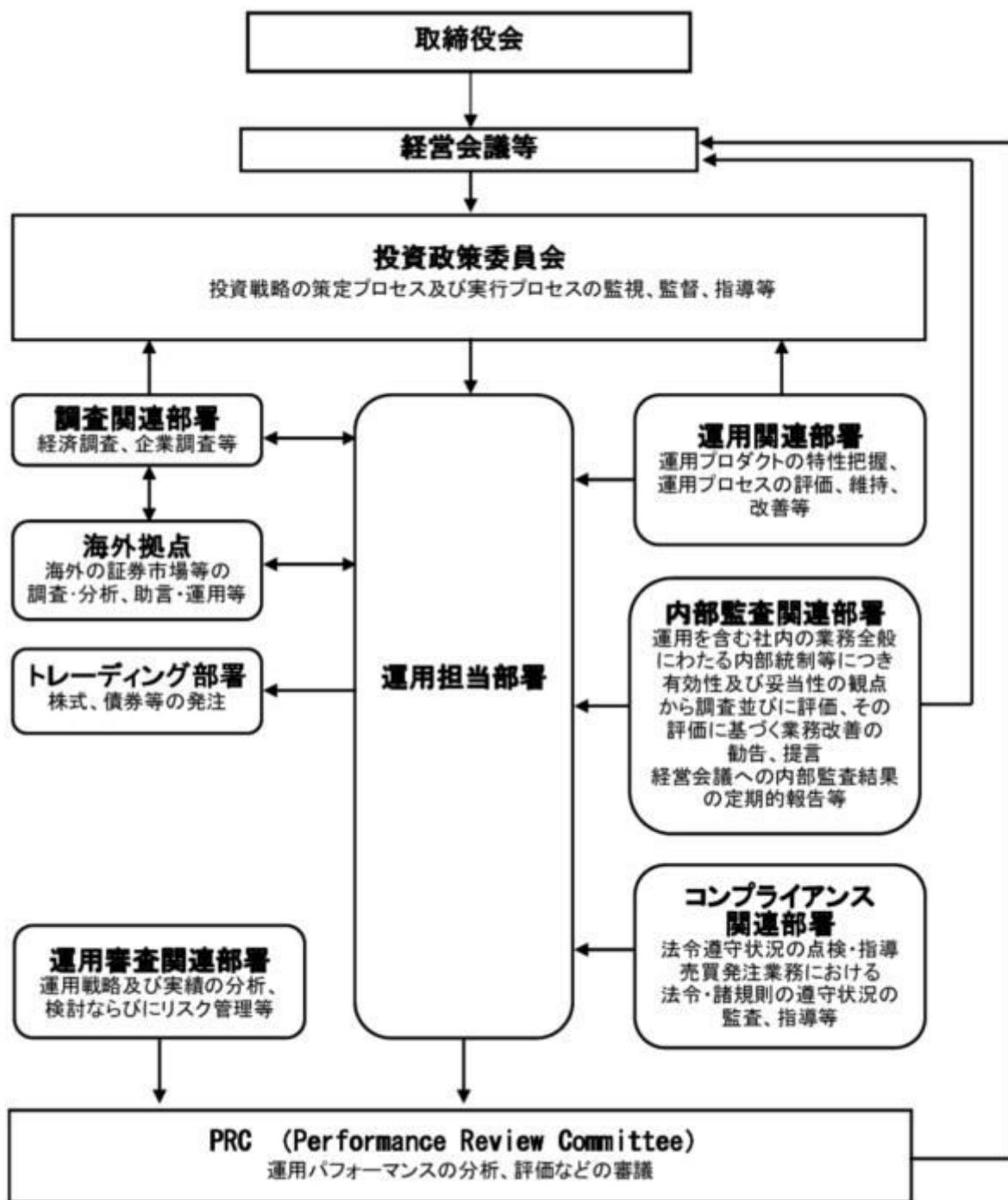
代表取締役・業務執行取締役

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

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

| 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 | | 86,924 | | 85,270 | |
| 資本剰余金 | | 17,180 | | 17,180 | |
| 資本準備金 | | 13,729 | | 13,729 | |
| 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 (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) |
|-----------|--------|--|--|
| | | 金額(百万円) | 金額(百万円) |
| 営業収益 | | | |
| 委託者報酬 | | 119,196 | 115,736 |
| 運用受託報酬 | | 21,440 | 17,170 |
| その他営業収益 | | 355 | 340 |
| 営業収益計 | | 140,992 | 133,247 |
| 営業費用 | | | |
| 支払手数料 | | 42,675 | 39,435 |
| 広告宣伝費 | | 1,210 | 1,006 |
| 公告費 | | 0 | - |
| 調査費 | | 30,082 | 26,833 |
| 調査費 | 5,998 | 5,696 | |
| 委託調査費 | 24,083 | 21,136 | |
| 委託計算費 | | 1,311 | 1,342 |
| 営業雑経費 | | 5,435 | 5,823 |
| 通信費 | 92 | 75 | |
| 印刷費 | 970 | 958 | |
| 協会費 | 86 | 92 | |
| 諸経費 | 4,286 | 4,696 | |
| 営業費用計 | | 80,715 | 74,440 |
| 一般管理費 | | | |
| 給料 | | 11,113 | 11,418 |
| 役員報酬 | | 379 | 109 |
| 給料・手当 | | 7,067 | 7,173 |
| 賞与 | | 3,666 | 4,134 |
| 交際費 | | 107 | 86 |
| 旅費交通費 | | 514 | 391 |
| 租税公課 | | 1,048 | 1,029 |
| 不動産賃借料 | | 1,223 | 1,227 |
| 退職給付費用 | | 1,474 | 1,486 |
| 固定資産減価償却費 | | 2,835 | 2,348 |
| 諸経費 | | 10,115 | 10,067 |
| 一般管理費計 | | 28,433 | 28,055 |
| 営業利益 | | 31,843 | 30,751 |

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

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

(3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

| 資本金 | 株主資本 | | | | | | | | | 株主資本合計 | |
|--------|--------|----------|---------|--------|----------|--------|-----------------------------------|--------|--------|--------|--|
| | 資本剰余金 | | | | 利益剰余金 | | | | | | |
| | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 | | 利 練 益 剩 余 金 合 計 | | | | |
| | | | | | 別途積立金 | 越利益 | | | | | |
| 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 | | | | | | | | | | | |
| 剩余金の配当 | | | | | | | 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 | | | |
| 剩余金の配当 | | | 24,826 |
| 当期純利益 | | | 25,672 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 21 | 21 | 21 |
| 当期変動額合計 | 21 | 21 | 868 |
| 当期末残高 | 33 | 33 | 86,958 |

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

| | 株主資本 | | | | | | | | | |
|---------------------|--------|--------------|-----------------------|---------------------|--------------|---------------------------------------|------------------------|--------|---------------------|-------------------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益剰余金 | | | | 利 益 剩 余 金 合 計 | 株 主 資 本 合 計 |
| | | 資 本 準 備 金 | そ の 他 資 本 剰 余 金 | 資 本 剰 余 金 合 計 | 利 益 準 備 金 | そ の 他 利 益 剰 余 金 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 | | | | | | | | | | |
| 剩余金の配当 | | | | | | | | 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 | | | |
| 剩余金の配当 | | | 25,650 |
| 当期純利益 | | | 23,996 |
| 株主資本以外の項目 の当期変動額（純額） | 23 | 23 | 23 |
| 当期変動額合計 | 23 | 23 | 1,676 |
| 当期末残高 | 10 | 10 | 85,281 |

[重要な会計方針]

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

(3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、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います。

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。

(4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。

5. 消費税等の会計処理方法**6. 連結納税制度の適用****連結納税制度を適用しております。**

なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」(実務対応報告第39号 2020年3月31日)第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日)第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

（1）概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

（2）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

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

（1）概要

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

（2）適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

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

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

損益計算書関係

| 前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日) | 当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日) |
|---|---|
| 1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 6,531百万円 支払利息 1 | 1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,931百万円 |
| 2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソ フ ト ウ エ 307 ア 合計 310 | 2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソ フ ト ウ エ 59 ア 合計 67 |
| 3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。 | |

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

| | |
|----------|-----------|
| 配当金の総額 | 25,650百万円 |
| 配当の原資 | 利益剰余金 |
| 1株当たり配当額 | 4,980円 |

| | |
|-------|------------|
| 基準日 | 2019年3月31日 |
| 効力発生日 | 2019年6月28日 |

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によってあります。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るず、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。

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用收益率の設定方法

年金資産の長期期待運用收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收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% |
| 長期期待運用收益率 | 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 | 繰延税金資産 |
| 賞与引当金 | 賞与引当金 |
| 退職給付引当金 | 退職給付引当金 |
| 関係会社株式評価減 | 関係会社株式評価減 |
| 投資有価証券評価減 | 投資有価証券評価減 |
| 未払事業税 | 未払事業税 |
| 時効後支払損引当金 | 時効後支払損引当金 |
| 減価償却超過額 | 減価償却超過額 |
| ゴルフ会員権評価減 | ゴルフ会員権評価減 |
| 関係会社株式売却損 | 関係会社株式売却損 |
| 未払社会保険料 | 未払社会保険料 |
| その他 | その他 |
| 繰延税金資産小計 | 繰延税金資産小計 |
| 評価性引当額 | 評価性引当額 |
| 繰延税金資産合計 | 繰延税金資産合計 |
| 繰延税金負債 | 繰延税金負債 |
| その他有価証券評価差額金 | その他有価証券評価差額金 |
| 前払年金費用 | 前払年金費用 |
| 繰延税金負債合計 | 繰延税金負債合計 |
| 繰延税金資産の純額 | 繰延税金資産の純額 |

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

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 | 野村證券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000(百万円) | 証券業 | - | 当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2) | 34,646 | 未払手数料 | 6,410 |

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

（ニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1 株当たり情報

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

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 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的取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

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

5 【その他】

(1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託者

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

* 2020年6月末現在

(2) 販売会社

| (a)名称 | (b)資本金の額 [*] | (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・連絡等を行ないます。

(2) 販売会社

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

3 【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

| 提出年月日 | 提出書類 |
|-------------|---------------|
| 2019年 9月 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 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 櫻井雄一郎
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 津村健二郎
業務執行社員

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

2020年8月7日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 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）2050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）2050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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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