

【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11月10日提出
【計算期間】	第15期(自 2020年2月18日至 2020年8月17日)
【ファンド名】	ネクストコア
【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）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、また為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興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」、「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」、「野村マネー マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

信託金の限度額

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

<商品分類>

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

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

（ネクストコア）

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
追加型	内外	その他資産 ()
		資産複合

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
--------	------	--------	------	-------

株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回	グローバル (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (適時ヘッジ)
不動産投信	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ファンズ	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))				
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

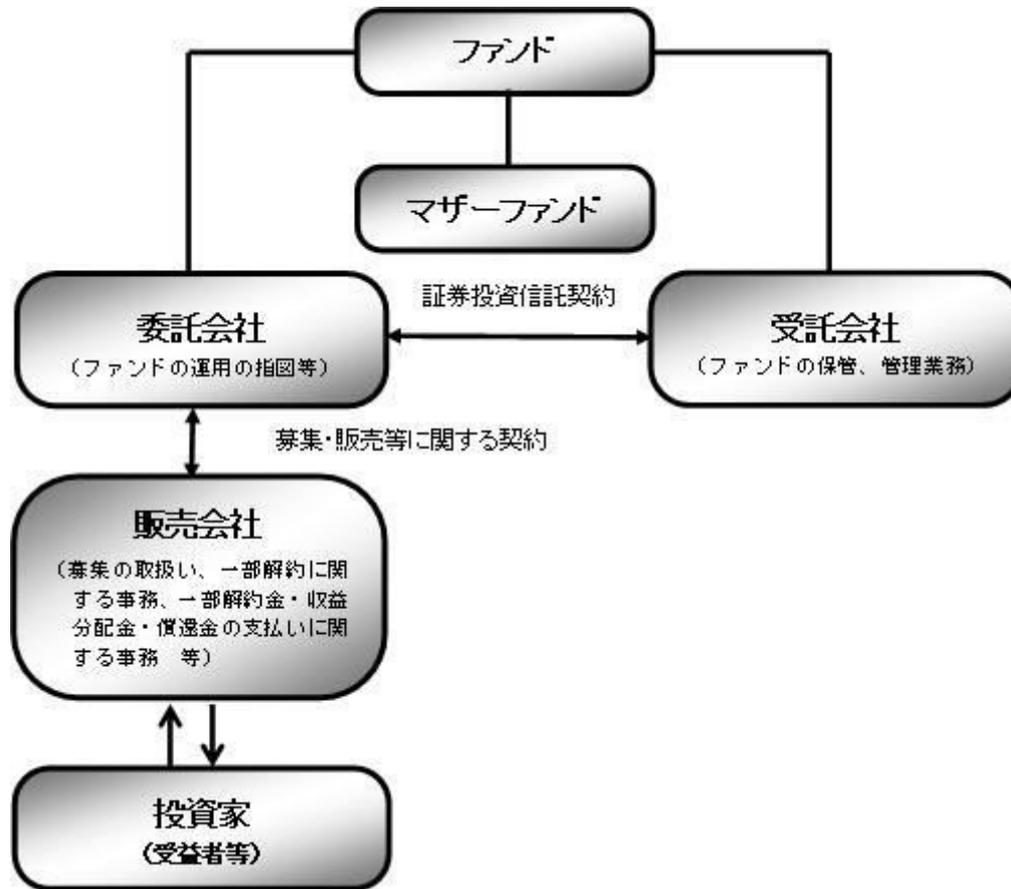
[特殊型]

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

(2) 【ファンドの沿革】

2013年1月31日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

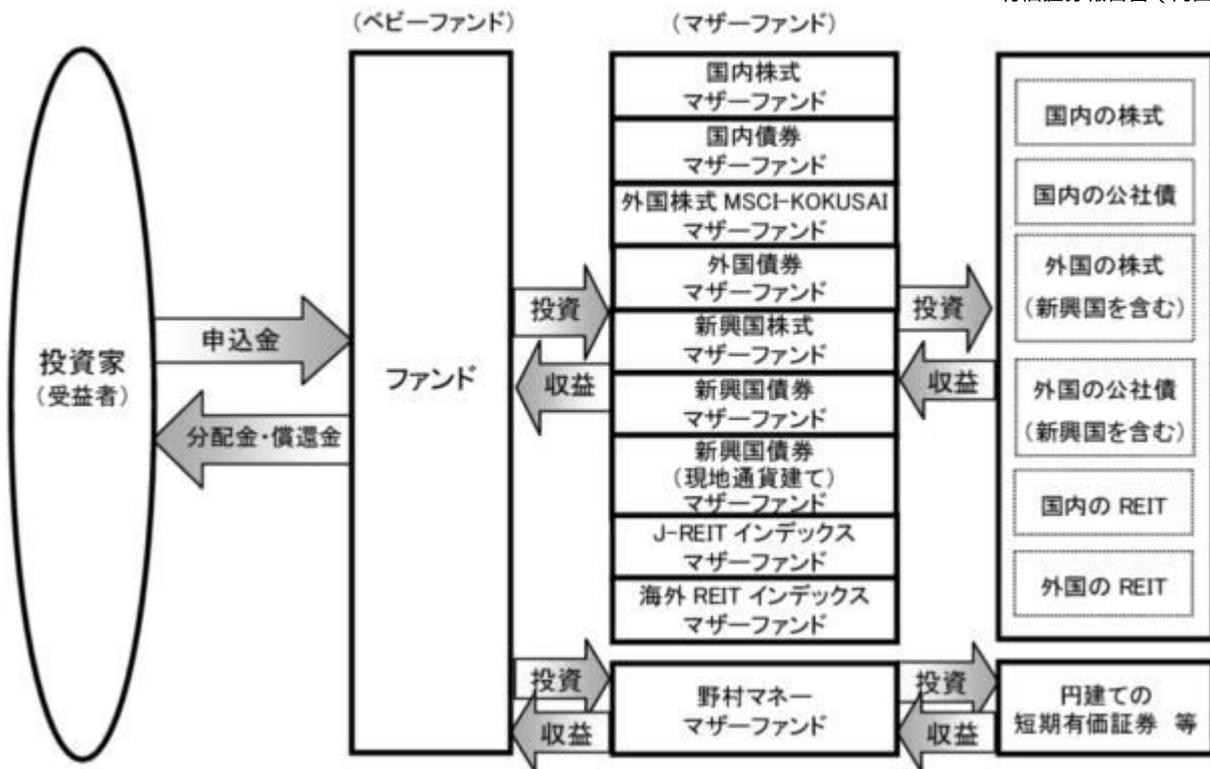
(3) 【ファンドの仕組み】



ファンド	ネクストコア
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド 国内債券マザーファンド 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 外国債券マザーファンド 新興国株式マザーファンド 新興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 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 野村マネー マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

《ファミリーファンド方式について》

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



ファンドは、各マザーファンドへの投資を行なうと共に、為替予約取引等を活用します。

委託会社の概況(2020年9月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋1-13-1	5,150,693株	100%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

[1] 運用にあたっては、世界の様々な指標の動きを計量的なアプローチを用いて分析し、リスク水準¹を一定範囲内程度に抑えつつ効率的に収益を獲得することを目指して、各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジション²を決定します。

1 リスク水準とは、推定されるポートフォリオの変動の大きさのことです。ファンドでは推定される基準価額の「振れ幅」（上下変動の程度）を表しています。なお、市場環境等によってはポートフォリオのリス

ク水準をより引き下げた運用を行なう場合があります。

- 2 マザーファンドを通じて実質的に投資を行なう内外の株式およびREITへの投資比率、ファンドが投資する外貨建資産と為替予約取引等を加味した実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、以下の範囲内となります。

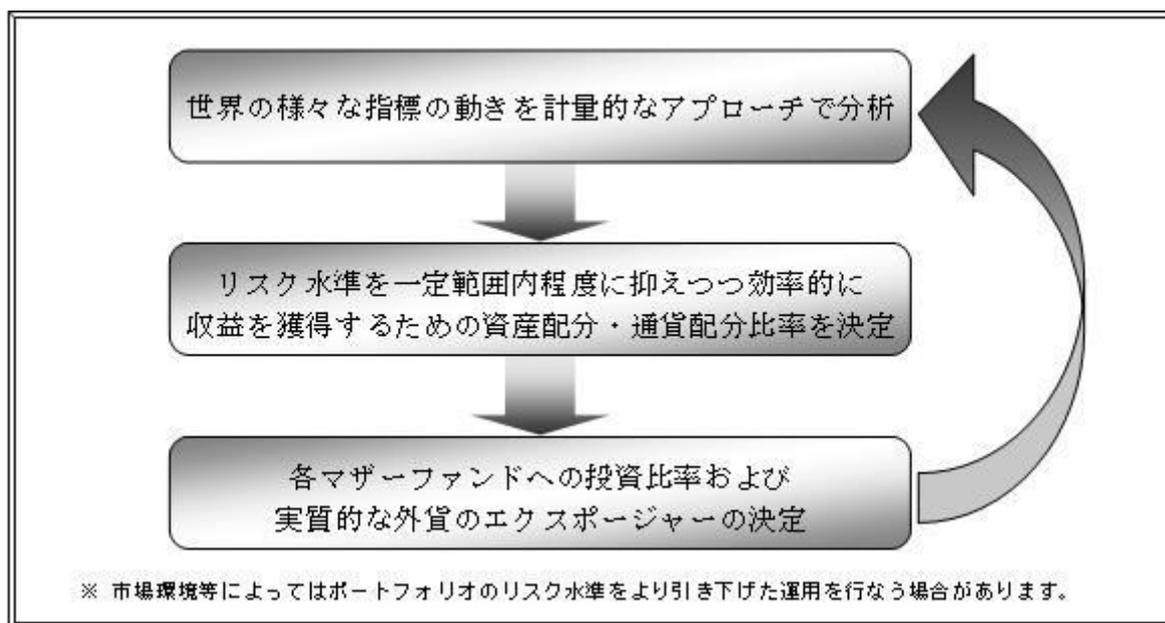
実質的な内外の株式 およびREITへの投資比率	実質的な外貨の エクスポージャー
純資産総額の50%以内	純資産総額の50%以内

各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジションは適宜見直しを行ないます。

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。

内外の株式およびREITをそれぞれ主な投資対象とする「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「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」への投資比率の合計は、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

運用プロセスについて



- [2] 為替予約取引等の利用については、外貨建資産の為替変動リスクを回避する目的（ヘッジ目的。代替ヘッジを含みます。）のほか、効率的に収益を獲得する目的（ヘッジ目的外）で活用します。

為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額は信託財産の純資産総額の100%以内とします。

実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内となるように調整を行ないます。

各マザーファンドの投資方針等について

[国内株式マザーファンド]

- ・わが国の株式を主要投資対象とし、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。
- ・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。

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

[国内債券 マザーファンド]

- ・わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

「NOMURA-BPI 国債指数」は、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

[外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド]

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

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

[外国債券マザーファンド]

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

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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。

[新興国株式マザーファンド]

- ・新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）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。

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

「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)」は、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。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[新興国債券マザーファンド]

- ・新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
- ・投資対象国における非常事態(金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等)を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース)は、JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース)をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus)は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建のプレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[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を主要投資対象とし、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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)は、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。

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は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数であり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[J-REITインデックス マザーファンド]

- ・J-REIT を主要投資対象とし、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。
- ・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。
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。

「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄に投資した場合の投資成果(市場における価格の変動と配当金の受け取りをあわせた投資成果)を表す指数です。東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均を、2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

[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 を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)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。
- ・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。

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

「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)をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。S&P先進国REIT指数は、S&Pの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数から、REIT及びREITと同様の制度に基づく銘柄を抽出して算出するインデックスで、先進国に上場する不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて毎日算出されます。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[野村マネー マザーファンド]

- ・本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
- ・残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

国内および外国(新興国を含む)の株式、国内および外国(新興国を含む)の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券(REIT)を実質的な主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興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」、「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」および「野村マネー マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、実質的に国内および外国(新興国を含む)の株式、国内および外国(新興国を含む)の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券(REIT)に投資を行ないます。

各マザーファンドの主要投資対象

国内株式マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式を主要投資対象とします。
外国債券マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
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を主要投資対象とします。
J-REITインデックス マザーファンド	J-REITを主要投資対象とします。
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を主要投資対象とします。
野村マネー マザーファンド	円建ての短期有価証券等を主要投資対象とします。

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、および」に定めるものに限り、）に係る権利

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみだす資産

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

有価証券の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内株式マザーファンド、国内債券マザーファンド、外国株式MSCI-

KOKUSAI マザーファンド、外国債券マザーファンド、新興国株式マザーファンド、新興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、J-REITインデックス マザーファンド、海外REITインデックス マザーファンドおよび野村マネー マザーファンド(以下「各マザーファンド」といいます。) 受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。) に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みません。)
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ブリファード 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. 外国貸付権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。)
19. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
20. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

び第16号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

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

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¹
4. 為替先渡取引²
5. 直物為替先渡取引³

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

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

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

(参考)各マザーファンドの概要

(国内株式マザーファンド) 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

(国内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、NOMURA-BPI国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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

主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI国債指数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

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)をいいます。

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

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

（外国債券マザーファンド） 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（新興国株式マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

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

（新興国債券マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

(J-REITインデックス マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

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

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

(2)投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

(海外REITインデックス マザーファンド) 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

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

2.運用方法

(1)投資対象

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

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

(2)投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

(野村マネー 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、本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

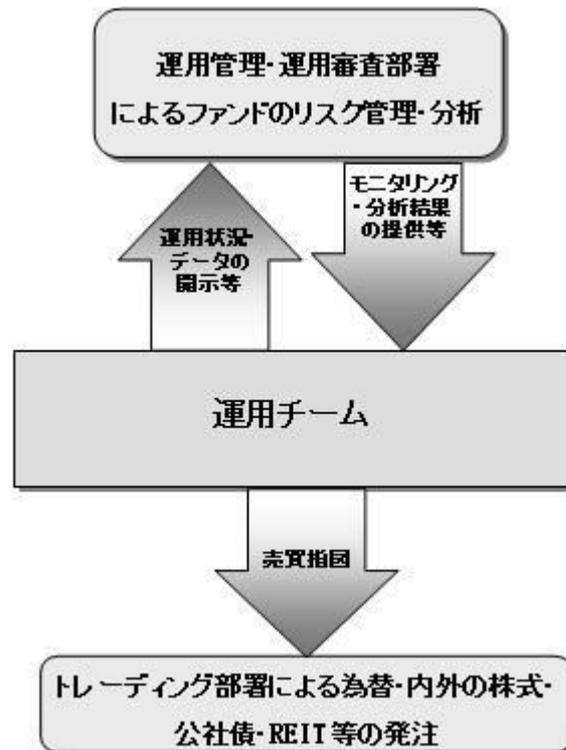
一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

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

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

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

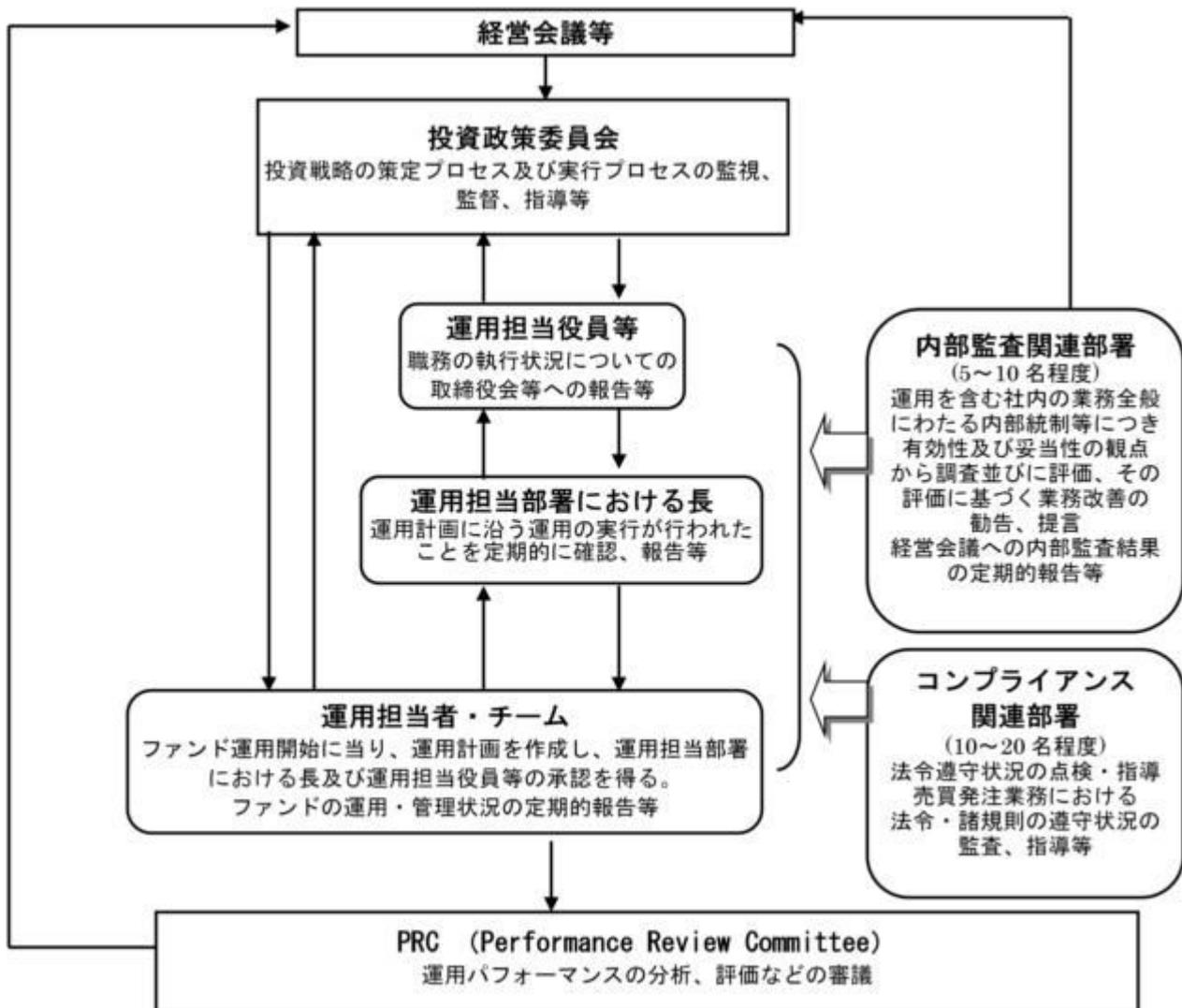


運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年2月および8月の各17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

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

- () 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻し

により行なうことの指図をすることができるものとします。

- () 上記()の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(信託約款)

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

スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

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

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

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

公社債の借入れ(信託約款)

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

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

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

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

す。

[REITの価格変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

ファンドは、為替変動リスクの低減を図る目的（ヘッジ目的）のほか、効率的に収益を追求する目的（ヘッジ目的外）で為替予約取引等を活用しますので、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。

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

ファンドは、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。

各マザーファンド（「野村マネー マザーファンド」を除く）が対象とするインデックスの著作権等について

国内株式マザーファンドについて

「東証株価指数(TOPIX)」

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

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

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

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

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

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

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

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

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

国内債券マザーファンドについて

「NOMURA-BPI国債指数」

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

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて

新興国株式マザーファンドについて

「MSCI-KOKUSAI指数」

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」

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

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

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

外国債券マザーファンドについて

「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」

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。

新興国債券マザーファンドについて

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドについて

「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス」

「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ものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

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

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

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

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com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もご覧ください。

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

J-REITインデックスマザーファンドについて

「東証REIT指数」

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

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

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

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

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

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

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

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

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

海外REITインデックスマザーファンドについて

「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（除く日本）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（除く日本）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（除く日本）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（除く日本）の決定、作成、および計算において、被許諾者あるいは本ファンドの所有者の要求を考慮に入れる義務を一切負いません。

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

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

S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）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（除く日本）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（除く日本）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。

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

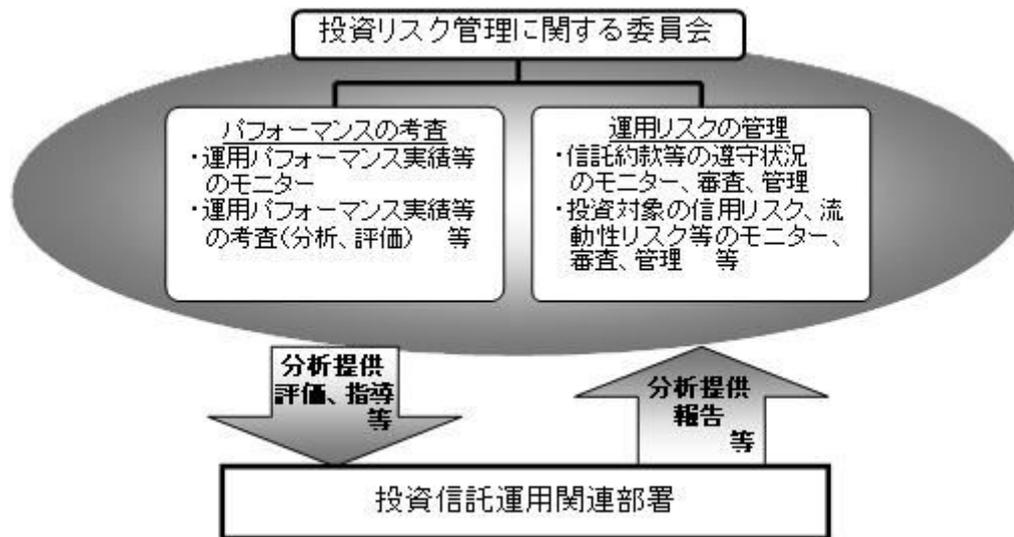
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



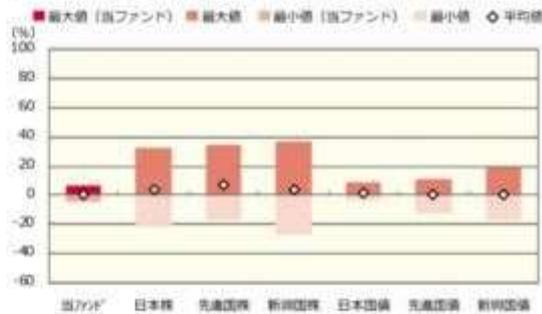
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較 (2015年10月末～2020年9月末：月次)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	6.7	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	▲5.0	▲22.0	▲17.5	▲27.4	▲4.0	▲12.3	▲17.4
平均値 (%)	0.6	4.2	6.6	3.5	1.6	0.7	0.5

* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2015年10月末を10,000として指数化しております。
* 年間騰落率は、2015年10月から2020年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2015年10月から2020年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
* 決算日に対応した数値とは異なります。
* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<代表的な資産クラスの指数>

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

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
 - MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
 - FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。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・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを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ており、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての種別、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMS LLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JP SI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年1.485%（税抜年1.35%）の率を乗じた額とします。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。

信託報酬の配分については次の通り（税抜）とします。

ファンドの純資産総額	300億円以下の部分	300億円超 500億円以下の部分	500億円超の部分
委託会社	年0.65%	年0.66%	年0.67%
販売会社	年0.65%	年0.65%	年0.65%
受託会社	年0.05%	年0.04%	年0.03%

支払先の役務の内容

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

（４）【その他の手数料等】

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

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等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。

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

ファンドに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。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

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

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

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

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

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額に

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

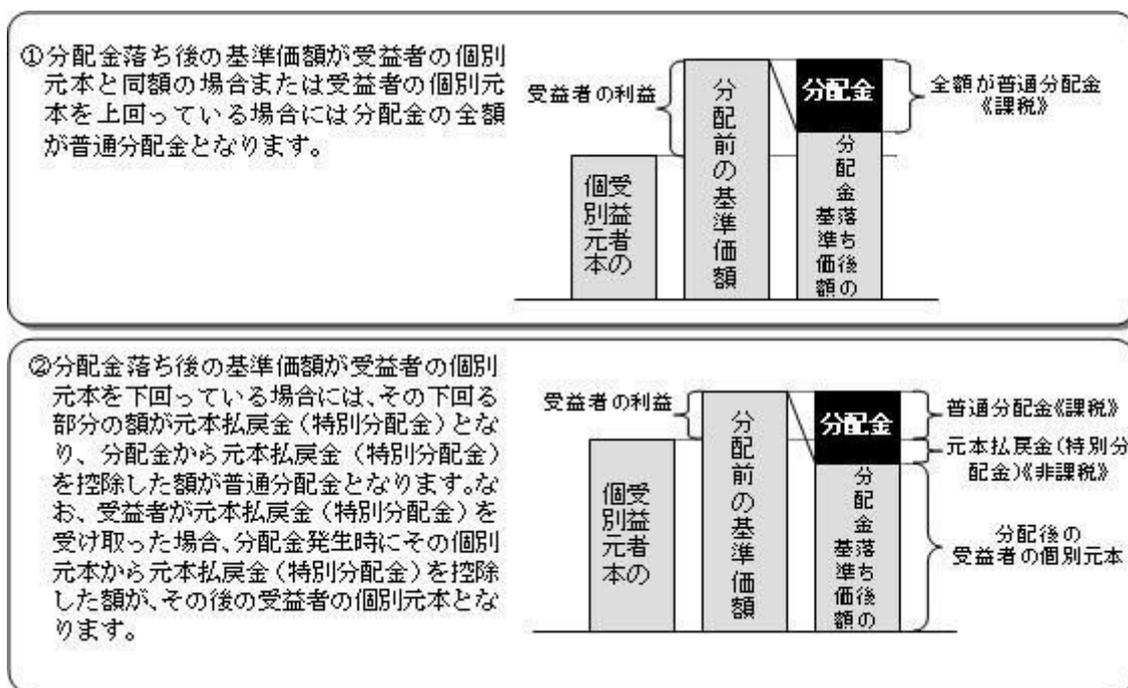
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

分配金の課税について

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



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

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

* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2020年9月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2020年9月30日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

ネクストコア

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	1,587,002,025	88.87
現金・預金・その他資産(負債控除後)		198,634,285	11.12
合計(純資産総額)		1,785,636,310	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	444,782,313,435	97.76
現金・預金・その他資産(負債控除後)		10,182,773,960	2.23
合計(純資産総額)		454,965,087,395	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	9,314,115,000	2.04

(参考)国内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	日本	29,605,809,460	99.22
現金・預金・その他資産(負債控除後)		230,820,708	0.77
合計(純資産総額)		29,836,630,168	100.00

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	481,518,064,234	69.17
	カナダ	23,072,584,687	3.31
	ドイツ	21,950,931,972	3.15
	イタリア	4,997,258,526	0.71
	フランス	23,778,239,419	3.41
	オランダ	10,205,907,230	1.46
	スペイン	5,115,096,283	0.73
	ベルギー	2,033,600,711	0.29
	オーストリア	356,237,769	0.05
	ルクセンブルグ	277,734,516	0.03
	フィンランド	2,411,790,542	0.34
	アイルランド	1,613,878,591	0.23
	ポルトガル	374,716,253	0.05
	イギリス	29,905,406,926	4.29
	スイス	23,762,567,814	3.41
	スウェーデン	7,648,646,469	1.09
	ノルウェー	1,279,814,821	0.18
	デンマーク	5,819,870,007	0.83
	オーストラリア	14,181,380,666	2.03
	ニュージーランド	703,738,980	0.10
香港	6,637,439,101	0.95	
シンガポール	1,981,784,315	0.28	
イスラエル	665,704,048	0.09	
	小計	670,292,393,880	96.29
投資証券	アメリカ	13,669,836,290	1.96
	カナダ	111,835,036	0.01
	フランス	309,741,444	0.04
	イギリス	379,662,248	0.05
	オーストラリア	1,077,424,985	0.15
	香港	332,915,310	0.04
	シンガポール	384,856,963	0.05
	小計	16,266,272,276	2.33
現金・預金・その他資産（負債控除後）		9,516,818,486	1.36
合計（純資産総額）		696,075,484,642	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	6,842,588,548	0.98
	買建	カナダ	321,237,980	0.04
	買建	ドイツ	1,010,199,931	0.14
	買建	イギリス	415,471,878	0.05
	買建	スイス	328,554,240	0.04
	買建	オーストラリア	212,815,743	0.03

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	259,209,773,470	43.50
	カナダ	11,248,664,816	1.88
	メキシコ	4,355,600,575	0.73
	ドイツ	41,274,373,560	6.92
	イタリア	57,784,834,251	9.69
	フランス	59,974,262,801	10.06
	オランダ	9,980,079,561	1.67
	スペイン	40,095,737,390	6.72
	ベルギー	14,639,499,547	2.45
	オーストリア	8,252,426,506	1.38
	フィンランド	2,684,102,097	0.45
	アイルランド	7,188,898,700	1.20
	イギリス	38,888,270,569	6.52
	スウェーデン	1,821,082,830	0.30
	ノルウェー	1,224,874,674	0.20
	デンマーク	3,173,444,296	0.53
	ポーランド	3,753,166,882	0.62
	オーストラリア	14,292,663,805	2.39
	シンガポール	2,644,207,825	0.44
	マレーシア	2,966,352,900	0.49
イスラエル	2,339,849,735	0.39	
	小計	587,792,166,790	98.65
現金・預金・その他資産（負債控除後）		8,017,702,197	1.34
合計（純資産総額）		595,809,868,987	100.00

（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	7,448,447,121	16.83

	メキシコ	663,192,371	1.49
	ブラジル	1,931,177,472	4.36
	チリ	103,350,214	0.23
	コロンビア	36,285,180	0.08
	ギリシャ	50,129,254	0.11
	イギリス	34,376,334	0.07
	トルコ	142,815,852	0.32
	チェコ	38,173,667	0.08
	ハンガリー	79,972,011	0.18
	ポーランド	277,434,733	0.62
	香港	9,583,992,035	21.66
	マレーシア	738,489,069	1.66
	タイ	775,629,730	1.75
	フィリピン	316,870,219	0.71
	インドネシア	543,946,215	1.22
	韓国	5,205,173,115	11.76
	台湾	5,443,225,525	12.30
	インド	3,547,563,567	8.01
	パキスタン	10,223,270	0.02
	カタール	339,872,293	0.76
	エジプト	46,993,704	0.10
	南アフリカ	1,490,773,658	3.36
	アラブ首長国連邦	239,042,515	0.54
	サウジアラビア	1,195,130,357	2.70
	小計	40,282,279,481	91.04
投資信託受益証券	アメリカ	1,820,322,538	4.11
投資証券	メキシコ	16,992,613	0.03
	南アフリカ	14,468,250	0.03
	小計	31,460,863	0.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）		2,110,435,313	4.76
合計（純資産総額）		44,244,498,195	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,773,495,247	4.00
	買建	シンガポール	301,787,094	0.68

（参考）新興国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	20,183,424,116	98.35
現金・預金・その他資産（負債控除後）		337,327,216	1.64
合計（純資産総額）		20,520,751,332	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	716,682,808	9.49
	ブラジル	636,434,813	8.43
	チリ	200,528,016	2.65
	コロンビア	403,216,220	5.34
	ペルー	242,890,317	3.21
	ウルグアイ	10,366,293	0.13
	ドミニカ共和国	14,806,234	0.19
	トルコ	163,830,235	2.17
	チェコ	325,489,122	4.31
	ハンガリー	267,985,426	3.55
	ポーランド	612,587,483	8.12
	ロシア	567,705,947	7.52
	ルーマニア	225,471,965	2.98
	マレーシア	549,171,210	7.27
	タイ	661,026,603	8.76
	フィリピン	27,572,858	0.36
	インドネシア	716,799,572	9.50
	南アフリカ	537,554,478	7.12
中国	486,687,867	6.45	
	小計	7,366,807,467	97.64
現金・預金・その他資産（負債控除後）		177,291,927	2.35
合計（純資産総額）		7,544,099,394	100.00

（参考）J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	36,530,266,310	96.81
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,200,347,317	3.18
合計（純資産総額）		37,730,613,627	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
REIT指数先物取引	買建	日本	1,168,580,000	3.09

(参考) 海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	20,355,634,659	73.51
	カナダ	520,508,729	1.87
	ドイツ	80,711,494	0.29
	イタリア	5,110,837	0.01
	フランス	498,544,983	1.80
	オランダ	45,837,976	0.16
	スペイン	126,992,446	0.45
	ベルギー	387,672,151	1.40
	アイルランド	36,481,146	0.13
	シンガポール	17,899,105	0.06
	イギリス	1,502,989,873	5.42
	オーストラリア	2,021,609,668	7.30
	ニュージーランド	133,851,985	0.48
	香港	504,154,218	1.82
	シンガポール	1,135,088,812	4.09
	韓国	20,554,942	0.07
	イスラエル	15,293,580	0.05
	小計	27,408,936,604	98.98
現金・預金・その他資産(負債控除後)		279,990,338	1.01
合計(純資産総額)		27,688,926,942	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	204,921,904	0.74

(参考) 野村マネー マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	------	---------	---------

地方債証券	日本	490,641,208	16.03
特殊債券	日本	380,898,725	12.44
社債券	日本	670,756,900	21.91
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,518,304,067	49.60
合計(純資産総額)		3,060,600,900	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ネクストコア

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	276,308,810	2.4842	686,421,197	2.4733	683,394,579	38.27
2	日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	368,904,884	1.3629	502,780,467	1.3668	504,219,195	28.23
3	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	63,696,091	1.6576	105,586,108	1.6796	106,983,954	5.99
4	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	32,373,274	3.0289	98,057,811	3.0075	97,362,621	5.45
5	日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックスマザーファンド	27,173,347	2.1579	58,639,820	2.2060	59,944,403	3.35
6	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	30,470,710	2.0006	60,960,720	1.9537	59,530,626	3.33
7	日本	親投資信託受益証券	海外REITインデックスマザーファンド	15,436,155	2.0665	31,899,743	2.0305	31,343,112	1.75
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	23,872,555	1.3265	31,669,330	1.2884	30,757,399	1.72
9	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	8,791,561	1.2511	11,000,000	1.2669	11,138,028	0.62
10	日本	親投資信託受益証券	野村マネーマザーファンド	2,282,012	1.0203	2,328,336	1.0202	2,328,108	0.13

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	88.87
合計	88.87

(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	2,179,000	6,656.43	14,504,367,219	6,932.00	15,104,828,000	3.31
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,520,500	4,700.96	7,147,822,422	6,469.00	9,836,114,500	2.16
3	日本	株式	ソニー	電気機器	1,223,400	7,067.70	8,646,630,464	8,032.00	9,826,348,800	2.15

4	日本	株式	キーエンス	電気機器	177,000	40,041.88	7,087,414,084	48,980.00	8,669,460,000	1.90
5	日本	株式	任天堂	その他製品	119,700	43,669.98	5,227,296,606	59,660.00	7,141,302,000	1.56
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,624,800	3,764.63	6,116,778,252	3,744.00	6,083,251,200	1.33
7	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,336,800	3,313.56	4,429,567,172	4,160.00	5,561,088,000	1.22
8	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	2,561,600	2,420.11	6,199,354,768	2,150.00	5,507,440,000	1.21
9	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	13,176,000	423.65	5,582,037,300	416.10	5,482,533,600	1.20
10	日本	株式	第一三共	医薬品	1,676,600	2,550.58	4,276,318,388	3,229.00	5,413,741,400	1.18
11	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	1,370,300	3,077.73	4,217,426,772	3,885.00	5,323,615,500	1.17
12	日本	株式	ダイキン工業	機械	248,800	14,090.55	3,505,728,840	19,300.00	4,801,840,000	1.05
13	日本	株式	日本電産	電気機器	470,000	6,260.47	2,942,423,933	9,805.00	4,608,350,000	1.01
14	日本	株式	H O Y A	精密機器	387,400	9,738.33	3,772,629,042	11,860.00	4,594,564,000	1.00
15	日本	株式	信越化学工業	化学	328,400	12,125.77	3,982,102,868	13,685.00	4,494,154,000	0.98
16	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,332,100	2,817.14	3,752,713,809	2,917.50	3,886,401,750	0.85
17	日本	株式	村田製作所	電気機器	573,700	6,056.33	3,474,521,484	6,773.00	3,885,670,100	0.85
18	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,537,600	2,614.29	4,019,734,794	2,473.50	3,803,253,600	0.83
19	日本	株式	K D D I	情報・通信業	1,397,100	3,158.92	4,413,340,100	2,656.00	3,710,697,600	0.81
20	日本	株式	ファナック	電気機器	183,600	17,845.38	3,276,411,768	20,120.00	3,694,032,000	0.81
21	日本	株式	花王	化学	467,600	8,446.53	3,949,600,275	7,887.00	3,687,961,200	0.81
22	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,345,300	2,236.00	3,008,097,943	2,685.00	3,612,130,500	0.79
23	日本	株式	S M C	機械	61,300	51,160.27	3,136,124,551	58,460.00	3,583,598,000	0.78
24	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,617,310	1,233.91	3,229,550,049	1,310.50	3,429,984,755	0.75
25	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	123,900	22,770.24	2,821,232,736	27,330.00	3,386,187,000	0.74
26	日本	株式	日立製作所	電気機器	938,400	3,267.96	3,066,659,616	3,543.00	3,324,751,200	0.73
27	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,261,100	2,415.13	3,045,725,220	2,512.50	3,168,513,750	0.69
28	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	681,000	4,507.66	3,069,719,567	4,600.00	3,132,600,000	0.68
29	日本	株式	三井物産	卸売業	1,665,400	1,638.72	2,729,127,218	1,803.00	3,002,716,200	0.65
30	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	198,500	14,272.69	2,833,130,272	14,740.00	2,925,890,000	0.64

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	0.09
		鉱業	0.14
		建設業	2.40
		食料品	3.68
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.13
		医薬品	6.35
		石油・石炭製品	0.38
		ゴム製品	0.53

ガラス・土石製品	0.76
鉄鋼	0.54
非鉄金属	0.63
金属製品	0.55
機械	5.35
電気機器	15.15
輸送用機器	6.89
精密機器	2.68
その他製品	2.73
電気・ガス業	1.39
陸運業	3.65
海運業	0.14
空運業	0.32
倉庫・運輸関連業	0.18
情報・通信業	9.92
卸売業	4.60
小売業	4.94
銀行業	4.62
証券、商品先物取引業	0.76
保険業	1.81
その他金融業	1.11
不動産業	1.89
サービス業	5.60
合 計	97.76

(参考) 国内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	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 9回	600,000,000	100.98	605,880,000	100.81	604,908,000	0.1	2024/3/20	2.02
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	560,000,000	101.43	568,013,600	101.31	567,364,000	0.1	2026/12/20	1.90
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	550,000,000	101.42	557,838,500	101.29	557,106,000	0.1	2026/9/20	1.86
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	520,000,000	101.29	526,744,400	101.18	526,146,400	0.1	2026/3/20	1.76
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	500,000,000	101.50	507,515,000	101.46	507,330,000	0.1	2028/3/20	1.70
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 4回	470,000,000	100.73	473,445,100	100.53	472,509,800	0.1	2022/12/20	1.58
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	420,000,000	101.42	425,964,000	101.40	425,892,600	0.1	2028/9/20	1.42

8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	400,000,000	102.58	410,356,000	102.38	409,520,000	0.4	2025/3/20	1.37
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 49回	400,000,000	101.53	406,132,000	101.45	405,816,000	0.1	2027/12/20	1.36
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 0回	390,000,000	100.92	393,612,700	100.87	393,424,200	0.1	2024/6/20	1.31
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	380,000,000	100.66	382,519,400	100.47	381,801,200	0.1	2022/9/20	1.27
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 52回	330,000,000	113.78	375,495,300	113.81	375,599,400	1.2	2035/3/20	1.25
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 2回	360,000,000	100.59	362,124,000	100.42	361,515,600	0.1	2022/6/20	1.21
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	360,000,000	100.44	361,584,000	100.29	361,054,800	0.1	2021/12/20	1.21
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	350,000,000	103.01	360,545,500	102.55	358,925,000	0.8	2023/6/20	1.20
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	350,000,000	102.75	359,653,000	102.35	358,256,500	0.6	2023/12/20	1.20
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	350,000,000	101.45	355,075,000	101.36	354,784,500	0.1	2027/3/20	1.18
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	350,000,000	100.94	353,300,500	100.75	352,656,500	0.1	2023/12/20	1.18
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	340,000,000	103.09	350,536,600	102.72	349,271,800	0.6	2024/6/20	1.17
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 53回	340,000,000	101.38	344,705,600	101.36	344,634,200	0.1	2028/12/20	1.15
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	330,000,000	102.83	339,344,000	102.57	338,494,200	0.4	2025/9/20	1.13
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	330,000,000	102.32	337,659,300	101.85	336,124,800	0.8	2022/9/20	1.12
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	330,000,000	101.46	334,844,400	101.43	334,742,100	0.1	2028/6/20	1.12
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	300,000,000	102.37	307,113,500	102.17	306,537,000	0.3	2025/12/20	1.02
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 3回	270,000,000	100.93	272,523,800	101.03	272,789,100	0.1	2025/3/20	0.91
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	250,000,000	102.92	257,317,500	102.54	256,352,500	0.6	2024/3/20	0.85
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	250,000,000	101.23	253,075,000	101.23	253,092,500	0.1	2026/6/20	0.84
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 26回	240,000,000	102.29	245,500,800	101.85	244,459,200	0.7	2022/12/20	0.81
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 27回	230,000,000	102.55	235,874,200	102.08	234,786,300	0.8	2022/12/20	0.78
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	230,000,000	102.22	235,112,900	101.81	234,181,400	0.6	2023/3/20	0.78

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.22
合計	99.22

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	2,726,220	6,800.77	18,540,404,590	12,070.72	32,907,443,731	4.72
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,132,800	17,015.08	19,274,684,752	21,928.10	24,840,160,742	3.56
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	66,667	209,720.94	13,981,466,007	332,728.30	22,181,997,843	3.18
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	378,100	17,682.47	6,685,745,051	27,697.38	10,472,380,134	1.50
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	47,570	121,802.16	5,794,129,203	155,455.11	7,394,999,773	1.06
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	47,180	121,776.17	5,745,399,946	155,104.91	7,317,849,937	1.05
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	414,300	14,104.98	5,843,696,956	15,558.94	6,446,072,156	0.92
8	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	468,300	11,498.16	5,384,590,493	12,619.88	5,909,893,550	0.84
9	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	389,300	12,197.14	4,748,346,716	14,522.10	5,653,456,644	0.81
10	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	265,300	17,560.24	4,658,733,516	21,100.75	5,598,029,506	0.80

11	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	96,830	29,018.59	2,809,870,168	55,971.37	5,419,708,145	0.77
12	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	116,810	11,713.36	1,368,238,002	44,337.60	5,179,075,757	0.74
13	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	140,730	26,910.53	3,787,119,055	35,573.13	5,006,207,148	0.71
14	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	169,400	20,852.56	3,532,424,168	28,789.23	4,876,896,917	0.70
15	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	219,000	19,437.62	4,256,840,432	22,264.55	4,875,936,888	0.70
16	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	479,800	9,890.48	4,745,454,957	10,088.03	4,840,236,794	0.69
17	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	149,300	26,676.19	3,982,755,303	32,179.07	4,804,335,151	0.69
18	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	651,800	5,801.05	3,781,130,265	6,267.59	4,085,216,466	0.58
19	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	110,660	35,557.98	3,934,846,818	36,835.80	4,076,250,513	0.58
20	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフト ウェア	75,890	33,944.24	2,576,028,969	51,771.11	3,928,909,842	0.56
21	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	284,500	10,608.48	3,018,113,345	13,267.32	3,774,552,540	0.54
22	アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフト ウェア	141,700	16,820.18	2,383,419,541	26,180.21	3,709,735,757	0.53
23	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	69,290	39,407.12	2,730,519,583	52,210.18	3,617,643,649	0.51
24	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術 サービス	175,700	10,413.35	1,829,625,902	20,578.10	3,615,572,170	0.51
25	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	667,000	5,866.81	3,913,167,138	5,415.90	3,612,406,634	0.51
26	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	717,600	3,766.06	2,702,528,598	4,887.96	3,507,600,096	0.50
27	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	397,700	8,152.72	3,242,339,656	8,665.02	3,446,078,454	0.49
28	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	1,123,000	3,194.35	3,587,258,831	2,994.14	3,362,419,220	0.48
29	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	875,300	3,462.74	3,030,936,661	3,826.78	3,349,585,786	0.48
30	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	642,900	4,768.54	3,065,697,825	5,175.73	3,327,480,674	0.47

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.98
		メディア	1.12
		娯楽	1.51
		不動産管理・開発	0.41
		エネルギー設備・サービス	0.10
		石油・ガス・消耗燃料	2.50
		化学	2.22
		建設資材	0.24
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.52
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.41
		建設関連製品	0.56
		建設・土木	0.25
		電気設備	0.80
		コングロマリット	1.08
		機械	1.70
		商社・流通業	0.29
		商業サービス・用品	0.45
		航空貨物・物流サービス	0.71
		旅客航空輸送業	0.05
		海運業	0.06
		陸運・鉄道	1.11
		運送インフラ	0.16
		自動車部品	0.23
		自動車	1.30
		家庭用耐久財	0.36
		レジャー用品	0.07
		繊維・アパレル・贅沢品	1.47
		ホテル・レストラン・レジャー	1.51
		販売	0.05
		インターネット販売・通信販売	3.87
複合小売り	0.51		
専門小売り	1.75		

	食品・生活必需品小売り	1.52
	飲料	1.74
	食品	1.92
	タバコ	0.71
	家庭用品	1.47
	パーソナル用品	0.72
	ヘルスケア機器・用品	3.17
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.89
	バイオテクノロジー	2.06
	医薬品	5.34
	銀行	4.83
	各種金融サービス	0.93
	保険	2.96
	情報技術サービス	4.82
	ソフトウェア	7.54
	通信機器	0.65
	コンピュータ・周辺機器	4.96
	電子装置・機器・部品	0.53
	半導体・半導体製造装置	4.03
	各種電気通信サービス	1.71
	無線通信サービス	0.28
	電力	2.01
	ガス	0.16
	総合公益事業	0.97
	水道	0.11
	消費者金融	0.33
	資本市場	2.85
	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	0.17
	ライフサイエンス・ツール/サービス	1.01
	専門サービス	0.76
投資証券		2.33
合 計		98.63

(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	13,960.64	10,079,582,150	13,798.63	9,962,613,637	6	2026/2/15	1.67
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,800,000	10,994.02	8,883,172,247	10,904.42	8,810,775,497	2.5	2022/1/15	1.47
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	48,000,000	14,673.40	7,043,232,960	14,596.26	7,006,207,869	5.25	2028/11/15	1.17
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	13,140.27	6,767,242,355	13,202.68	6,799,381,512	2.5	2046/2/15	1.14
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	14,780.59	6,828,632,624	14,699.58	6,791,209,425	5.5	2028/8/15	1.13
6	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	31,800,000	19,369.17	6,159,398,711	20,281.92	6,449,653,040	5.75	2032/7/30	1.08
7	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000	20,041.03	5,721,716,349	21,331.16	6,090,047,408	3.25	2045/5/25	1.02
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,600,000	11,642.10	5,890,905,431	11,643.78	5,891,755,282	2.25	2025/11/15	0.98
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	50,500,000	11,837.60	5,977,991,856	11,516.08	5,815,621,092	8	2021/11/15	0.97
10	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	27,450,000	21,672.33	5,949,055,272	21,083.06	5,787,300,739	3.25	2044/1/22	0.97
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,100,000	14,186.10	5,263,043,950	14,276.38	5,296,539,763	3	2044/11/15	0.88
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	11,025.51	5,281,222,353	10,979.22	5,259,050,640	1.75	2023/1/31	0.88
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	13,069.87	5,214,878,281	13,163.00	5,252,040,012	2.5	2045/2/15	0.88
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,277.25	5,209,544,279	15,292.77	5,214,837,025	3.5	2026/4/25	0.87
15	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	16,145.76	4,827,582,459	17,376.34	5,195,528,591	5.25	2029/11/1	0.87
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,511.53	5,191,702,350	11,472.68	5,174,182,063	2.375	2024/8/15	0.86
17	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,692.77	5,047,049,333	18,831.84	5,084,597,670	5.5	2029/4/25	0.85
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	31,700,000	15,749.80	4,992,686,674	15,649.30	4,960,830,492	5.375	2031/2/15	0.83
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,507.40	4,902,153,506	11,436.31	4,871,871,788	2.75	2023/11/15	0.81
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,421.44	4,876,954,921	11,394.99	4,865,660,771	2.125	2024/9/30	0.81
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,346.22	4,878,875,737	11,299.93	4,858,972,112	2.25	2023/12/31	0.81
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,662.93	4,913,219,750	12,439.76	4,826,628,857	6.25	2023/8/15	0.81
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,437.14	4,700,666,614	11,362.75	4,670,091,850	2.75	2023/7/31	0.78
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	11,932.25	4,534,257,375	11,952.92	4,542,109,618	2.375	2027/5/15	0.76
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	12,578.37	4,339,539,664	12,637.31	4,359,873,260	2.25	2046/8/15	0.73
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,400,000	13,861.41	4,352,483,949	13,882.20	4,359,012,684	5.5	2022/11/1	0.73
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	21,080.61	4,237,203,429	21,503.74	4,322,253,385	5.75	2032/10/25	0.72

28	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	28,200,000	14,780.25	4,168,033,082	14,696.28	4,144,351,313	5.25	2029/2/15	0.69
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	11,900.16	4,105,556,621	11,858.69	4,091,248,531	2.875	2025/4/30	0.68
30	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	22,789.76	4,202,433,125	22,115.98	4,078,187,800	3.5	2045/1/22	0.68

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.65
合計	98.65

(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	119,740	21,520.76	2,576,896,477	29,299.19	3,508,285,490	7.92
2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	364,900	5,758.05	2,101,113,190	6,900.07	2,517,837,367	5.69
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,568,000	1,088.06	1,706,088,337	1,568.84	2,459,941,120	5.55
4	アメリカ	投資信託受 益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		500,300	2,980.75	1,491,269,726	3,638.46	1,820,322,538	4.11
5	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	303,960	4,442.07	1,350,213,049	5,284.56	1,606,294,858	3.63
6	香港	株式	MEITUAN DIANPING B	インター ネット販 売・通信販 売	227,100	1,802.00	409,235,073	3,202.29	727,240,059	1.64
7	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	182,600	2,258.27	412,361,619	3,255.32	594,421,889	1.34
8	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インター ネット販 売・通信販 売	27,940	18,715.75	522,918,055	18,502.93	516,972,074	1.16

9	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	5,212.66	284,194,734	7,951.92	433,539,115	0.97
10	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,146,000	84.25	517,840,476	68.38	420,303,429	0.94
11	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	378,000	1,074.70	406,237,983	1,084.49	409,938,165	0.92
12	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	219,700	985.85	216,593,219	1,463.05	321,432,085	0.72
13	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	35,170	7,709.98	271,160,207	7,627.20	268,248,624	0.60
14	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信 サービス	395,000	805.26	318,078,743	668.16	263,926,163	0.59
15	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵 当・不動産 金融	105,800	2,464.30	260,722,979	2,483.99	262,806,671	0.59
16	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	238,121	928.19	221,022,331	1,095.22	260,797,144	0.58
17	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	娯楽	5,260	39,539.04	207,975,365	47,690.40	250,851,546	0.56
18	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュー タ・周辺機 器	53,150	3,806.18	202,298,702	4,585.40	243,714,010	0.55
19	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	17,700	10,752.20	190,313,992	12,968.96	229,550,663	0.51
20	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	803,649	279.41	224,549,496	280.28	225,246,742	0.50
21	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,910,000	69.75	272,733,448	54.46	212,952,285	0.48
22	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	95,538	1,496.67	142,989,701	2,220.39	212,132,575	0.47
23	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	58,400	2,774.62	162,038,347	3,608.18	210,717,712	0.47
24	韓国	株式	NAVER CORP	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	7,780	19,431.20	151,174,736	26,922.20	209,454,716	0.47
25	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	673,300	282.45	190,180,014	301.80	203,203,223	0.45
26	アメリカ	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	各種消費者 サービス	24,830	5,933.10	147,318,882	7,906.43	196,316,756	0.44

27	香港	株式	XIAOMI CORPORATION	コンピュー タ・周辺機 器	680,000	159.04	108,153,238	273.68	186,104,100	0.42
28	韓国	株式	LG CHEMICALS LTD	化学	3,000	33,359.65	100,078,976	59,383.20	178,149,600	0.40
29	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	382,000	535.49	204,560,473	450.49	172,089,625	0.38
30	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	5,139,000	39.68	203,943,760	32.62	167,652,167	0.37

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	7.55
		メディア	0.23
		娯楽	1.16
		不動産管理・開発	2.01
		エネルギー設備・サービス	0.06
		石油・ガス・消耗燃料	5.10
		化学	2.16
		建設資材	0.86
		容器・包装	0.04
		金属・鉱業	3.09
		紙製品・林産品	0.17
		航空宇宙・防衛	0.07
		建設関連製品	0.03
		建設・土木	0.44
		電気設備	0.23
		コングロマリット	0.94
		機械	0.33
		商社・流通業	0.02
		商業サービス・用品	0.25
		航空貨物・物流サービス	0.21
旅客航空輸送業	0.10		
海運業	0.09		
陸運・鉄道	0.22		
運送インフラ	0.56		
自動車部品	0.38		

自動車	2.05
家庭用耐久財	0.26
レジャー用品	0.09
繊維・アパレル・贅沢品	0.81
ホテル・レストラン・レジャー	0.67
インターネット販売・通信販売	12.43
複合小売り	0.42
専門小売り	0.46
食品・生活必需品小売り	1.32
飲料	0.70
食品	1.69
タバコ	0.28
家庭用品	0.47
パーソナル用品	0.62
ヘルスケア機器・用品	0.43
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.46
バイオテクノロジー	0.66
医薬品	1.27
銀行	10.40
各種金融サービス	0.47
保険	2.82
情報技術サービス	1.73
ソフトウェア	0.28
通信機器	0.13
コンピュータ・周辺機器	5.38
電子装置・機器・部品	1.94
半導体・半導体製造装置	7.65
各種電気通信サービス	1.18
無線通信サービス	1.97
電力	0.73
ガス	0.46
総合公益事業	0.04
水道	0.16
貯蓄・抵当・不動産金融	0.61
消費者金融	0.17
資本市場	0.93

		各種消費者サービス	0.97
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.37
		ヘルスケア・テクノロジー	0.20
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.66
		専門サービス	0.04
		その他の業種	0.00
投資信託受益証券			4.11
投資証券			0.07
合 計			95.23

(参考) 新興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	RUSSIAN FEDERATION	3,600,000	13,136.12	472,900,608	14,021.67	504,780,264	5.25	2047/6/23	2.45
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	11,937,686	2,886.61	344,594,893	3,938.40	470,154,420	0.125	2035/7/9	2.29
3	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	8,365,309	3,426.01	286,597,115	4,332.50	362,427,846	0.125	2030/7/9	1.76
4	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,700,000	10,261.42	277,058,460	10,830.85	292,432,999	7.625	2029/4/26	1.42
5	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,200,000	12,513.27	275,292,023	12,973.72	285,421,950	5.1	2035/3/28	1.39
6	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	6,086,159	4,768.27	290,204,798	4,472.69	272,215,328	0.125	2038/1/9	1.32
7	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000	11,142.32	256,273,521	11,416.50	262,579,677	4.25	2025/1/7	1.27
8	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	2,400,000	10,601.37	254,432,918	10,910.30	261,847,382	7.375	2025/2/5	1.27
9	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,200,000	11,123.90	244,725,980	11,800.77	259,617,013	4.5	2029/4/22	1.26
10	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,200,000	10,576.82	232,690,172	11,429.62	251,451,792	5.625	2047/2/21	1.22
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,000,000	11,087.84	221,756,800	12,349.61	246,992,216	5	2045/6/15	1.20
12	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000	12,235.18	244,703,762	12,287.07	245,741,575	3.7	2042/2/2	1.19
13	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,810,000	12,070.72	218,480,068	13,283.87	240,438,186	6.05	2040/1/11	1.17
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000	9,552.84	219,715,336	10,126.32	232,905,581	6	2027/3/25	1.13
15	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	13,627.83	218,045,336	14,146.84	226,349,536	5.625	2042/4/4	1.10
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,300,000	16,064.67	208,840,736	16,894.09	219,623,184	5.625	2050/11/18	1.07
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	5,300,000	4,138.03	219,315,993	4,138.10	219,319,432	0.125	2041/7/9	1.06
18	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,250,000	17,016.51	212,706,430	17,435.67	217,945,990	9.5	2030/2/2	1.06
19	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	11,445.02	194,565,354	12,762.23	216,957,924	5.55	2045/1/21	1.05

20	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	10,639.77	202,155,763	11,225.53	213,285,235	4.5	2029/5/30	1.03
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,545.53	196,274,023	11,996.18	203,935,160	3.875	2028/3/17	0.99
22	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,750,000	11,179.76	195,645,889	11,501.57	201,277,491	4	2023/10/2	0.98
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,500,000	11,876.05	178,140,750	13,140.36	197,105,400	5.625	2044/2/26	0.96
24	アメリカ	国債証券	INDONESIA GLOBAL	1,600,000	11,764.84	188,237,457	12,200.90	195,214,543	5.875	2024/1/15	0.95
25	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	11,768.24	188,291,922	12,147.44	194,359,171	4.375	2029/3/21	0.94
26	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	10,172.03	172,924,599	11,394.07	193,699,328	4.6	2046/1/23	0.94
27	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	8,654.66	181,747,895	9,169.68	192,563,406	6.625	2045/2/17	0.93
28	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	11,538.01	184,608,304	11,918.63	190,698,152	4.25	2027/6/23	0.92
29	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	10,130.35	172,215,950	11,165.02	189,805,359	4.6	2048/2/10	0.92
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,150,000	15,048.62	173,059,149	16,393.27	188,522,652	7.75	2038/1/17	0.91

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.35
合計	98.35

(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	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000	2,995.47	182,724,078	3,013.72	183,837,286	2.5	2027/7/25	2.43
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,678.16	167,816,277	1,650.25	165,025,662	3.6	2030/5/21	2.18
3	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000	1,673.87	167,387,775	1,621.34	162,134,706	3.48	2027/6/29	2.14
4	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,510,000,000	3.45	156,001,982	3.50	158,066,552	9.85	2027/6/28	2.09
5	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,130.95	129,993,722	2,127.27	129,763,904	10	2023/1/1	1.72
6	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,500,000	1,590.71	119,303,568	1,580.25	118,519,369	3.03	2024/6/24	1.57
7	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000	2,945.41	117,816,712	2,956.81	118,272,615	2.5	2024/4/25	1.56
8	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000	3,081.62	117,101,572	3,090.72	117,447,360	3.25	2025/7/25	1.55
9	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	23,600,000	444.03	104,792,799	469.06	110,699,293	1	2026/6/26	1.46
10	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,000,000	584.65	111,084,662	569.42	108,190,881	8	2030/1/31	1.43
11	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000	708.31	105,539,509	725.73	108,134,031	10.5	2026/12/21	1.43
12	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000	2,841.43	105,132,978	2,837.07	104,971,923	2.25	2022/4/25	1.39

13	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	12,230,000,000	0.82	100,893,837	0.81	99,503,280	9	2029/3/15	1.31
14	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	17,800,000	508.47	90,508,234	518.28	92,254,609	8	2023/12/7	1.22
15	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000	2,215.23	91,046,915	2,161.74	88,847,836	10	2025/1/1	1.17
16	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,100,000	542.57	81,929,187	559.45	84,477,988	8.5	2029/5/31	1.11
17	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,900,000	1,665.11	81,590,850	1,696.74	83,140,643		2022/7/1	1.10
18	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000	343.45	82,085,915	343.26	82,039,686	1.45	2024/12/17	1.08
19	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000	2,701.57	78,345,639	2,749.19	79,726,729	3.733	2028/6/15	1.05
20	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,000,000	1,599.45	79,972,608	1,541.31	77,065,714		2024/1/1	1.02
21	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,850,000	495.21	68,587,342	526.04	72,857,748	7.5	2027/6/3	0.96
22	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000	148.32	70,753,354	148.72	70,941,630	7.95	2026/10/7	0.94
23	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,697.55	70,136,342	2,723.37	70,807,782	4.181	2024/7/15	0.93
24	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000	2,285.62	73,145,464	2,169.93	69,438,026	10	2027/1/1	0.92
25	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000	0.74	65,599,560	0.78	68,732,928	8.125	2024/5/15	0.91
26	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	14,000,000	449.41	62,918,023	459.83	64,376,676	0.45	2023/10/25	0.85
27	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000	2,840.66	62,494,543	2,894.69	63,683,259	2.5	2023/1/25	0.84
28	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,700,000	357.66	63,305,925	356.78	63,151,385	2.125	2026/12/17	0.83
29	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,900,000	1,615.95	63,022,360	1,595.71	62,232,869		2023/7/1	0.82
30	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000	548.94	59,835,541	562.07	61,266,336	10	2024/12/5	0.81

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.64
合計	97.64

(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	3,898	687,870	2,681,318,351	596,000	2,323,208,000	6.15
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,025	593,397	2,388,423,488	538,000	2,165,450,000	5.73
3	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,090	297,712	1,813,069,307	355,500	2,164,995,000	5.73
4	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	11,573	144,333	1,670,370,206	162,800	1,884,084,400	4.99
5	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	13,016	146,222	1,903,232,060	132,000	1,718,112,000	4.55
6	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,743	258,246	1,483,106,835	269,000	1,544,867,000	4.09

7	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,020	162,530	1,303,492,845	161,300	1,293,626,000	3.42
8	日本	投資証券	日本リートファンド投資法人 投資証券	7,562	162,549	1,229,198,865	162,400	1,228,068,800	3.25
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,823	311,454	1,190,691,738	311,000	1,188,953,000	3.15
10	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,689	165,746	942,931,383	180,300	1,025,726,700	2.71
11	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,608	135,321	1,164,844,717	116,700	1,004,553,600	2.66
12	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,839	72,482	858,121,264	77,600	918,706,400	2.43
13	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	2,506	360,569	903,588,244	326,500	818,209,000	2.16
14	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	1,337	625,730	836,601,183	607,000	811,559,000	2.15
15	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,017	418,839	844,798,363	399,500	805,791,500	2.13
16	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	2,630	279,117	734,079,577	301,500	792,945,000	2.10
17	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,485	160,193	718,466,950	176,200	790,257,000	2.09
18	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,245	641,080	798,145,247	629,000	783,105,000	2.07
19	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,966	51,028	661,633,715	51,700	670,342,200	1.77
20	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,728	143,403	678,012,788	136,900	647,263,200	1.71
21	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	1,288	452,507	582,829,041	502,000	646,576,000	1.71
22	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,078	98,947	502,454,947	108,800	552,486,400	1.46
23	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	1,756	312,421	548,612,294	307,000	539,092,000	1.42
24	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,830	34,030	572,736,849	31,200	525,096,000	1.39
25	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	858	634,659	544,537,773	604,000	518,232,000	1.37
26	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,082	118,880	485,268,568	121,100	494,330,200	1.31
27	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	2,626	182,002	477,938,223	185,900	488,173,400	1.29
28	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,336	379,342	506,801,700	358,000	478,288,000	1.26
29	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,307	383,918	501,781,453	356,500	465,945,500	1.23
30	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,735	136,057	508,176,405	122,900	459,031,500	1.21

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.81
合計	96.81

(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	173,910	10,304.44	1,792,046,769	10,538.73	1,832,791,925	6.61
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	20,850	73,469.93	1,531,848,195	80,774.06	1,684,139,318	6.08
3	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	63,210	15,007.75	948,639,935	15,607.61	986,557,407	3.56
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	35,740	22,314.36	797,515,470	23,372.27	835,325,216	3.01
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	98,100	6,260.93	614,198,201	5,766.10	565,654,410	2.04
6	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	391,300	1,137.52	445,112,584	1,372.40	537,023,329	1.93
7	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	81,200	6,632.49	538,558,713	6,464.38	524,907,656	1.89
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	33,100	18,302.20	605,802,992	15,607.61	516,612,090	1.86
9	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	72,000	9,019.50	649,404,632	6,770.14	487,450,224	1.76
10	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,590	16,979.07	468,452,543	16,920.59	466,839,188	1.68
11	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	80,600	6,852.97	552,349,848	5,405.32	435,668,953	1.57
12	香港	投資証券	LINK REIT	485,500	931.62	452,304,761	849.71	412,535,418	1.48
13	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	87,800	4,576.25	401,795,284	4,504.96	395,535,839	1.42
14	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	131,900	3,009.81	396,994,081	2,962.40	390,740,560	1.41
15	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	126,700	3,062.69	388,043,401	2,861.89	362,601,463	1.30
16	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	280,400	1,177.85	330,269,187	1,267.27	355,342,530	1.28
17	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	30,390	10,880.72	330,665,299	11,345.99	344,804,697	1.24
18	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	23,140	15,294.53	353,915,499	14,842.68	343,459,661	1.24
19	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	87,300	3,906.87	341,070,210	3,910.36	341,375,126	1.23
20	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,930	13,124.66	353,447,256	12,202.97	328,626,036	1.18
21	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	15,360	28,062.13	431,034,342	21,117.68	324,367,565	1.17
22	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	125,700	2,356.87	296,259,678	2,474.66	311,065,013	1.12
23	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	33,370	10,936.36	364,946,372	8,493.62	283,432,233	1.02
24	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	41,000	7,490.91	307,127,561	6,890.75	282,520,914	1.02
25	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	39,900	7,020.55	280,119,995	6,522.57	260,250,543	0.93
26	アメリカ	投資証券	UDR INC	69,600	4,372.38	304,317,936	3,419.45	237,994,138	0.85
27	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	124,700	2,156.49	268,915,139	1,861.02	232,069,443	0.83
28	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	23,030	10,511.17	242,072,304	9,460.63	217,878,447	0.78
29	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,225,000	203.99	249,888,442	172.11	210,843,570	0.76
30	アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	27,600	8,049.47	222,165,432	7,561.52	208,698,118	0.75

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.98
合計	98.98

(参考)野村マネー 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	社債券	九州電力 第433回	200,000,000	100.05	200,115,768	100.05	200,115,768	0.375	2020/11/25	6.53
2	日本	地方債証券	神奈川県 公募(5年)第66回	200,000,000	100.02	200,046,200	100.02	200,046,200	0.101	2020/12/18	6.53

3	日本	地方債証券	共同発行市場地方債 公募第9 2回	190,000,000	100.16	190,309,861	100.16	190,309,861	1.03	2020/11/25	6.21
4	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第3 13回	190,000,000	100.05	190,104,300	100.05	190,104,300	0.225	2020/12/25	6.21
5	日本	社債券	東北電力 第4 56回	170,000,000	100.17	170,304,894	100.17	170,304,894	1.176	2020/11/25	5.56
6	日本	地方債証券	千葉県 公募平 成22年度第9 回	100,000,000	100.28	100,285,147	100.28	100,285,147	1.22	2020/12/25	3.27
7	日本	社債券	関西電力 第4 85回	100,000,000	100.27	100,273,346	100.27	100,273,346	1.285	2020/12/18	3.27
8	日本	社債券	関西電力 第4 84回	100,000,000	100.05	100,059,892	100.05	100,059,892	0.976	2020/10/23	3.26
9	日本	社債券	東海旅客鉄道 第81回社債間 限定同順位特約 付	100,000,000	100.00	100,003,000	100.00	100,003,000	0.02	2020/11/27	3.26
10	日本	特殊債券	日本高速道路保 有・債務返済機 構債券 政府保 証債第126回	70,000,000	100.40	70,284,516	100.40	70,284,516	1.2	2021/1/29	2.29
11	日本	特殊債券	関西国際空港社 債 財投機関債 第29回	70,000,000	100.31	70,218,655	100.31	70,218,655	1.538	2020/12/18	2.29
12	日本	特殊債券	都市再生債券 財投機関債第4 9回	50,000,000	100.58	50,291,254	100.58	50,291,254	1.46	2021/2/26	1.64

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	16.03
特殊債券	12.44
社債券	21.91
合計	50.39

【投資不動産物件】

ネクストコア

該当事項はありません。

(参考) 国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSA I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）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）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）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。

（参考）野村マネー 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】

ネクストコア

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12月限)	買建	573	日本円	9,310,354,835	9,314,115,000	2.04

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式M S C I - K O K U S A Iマザーファンド

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
----	----------	-----	----	-----------	----	----	------	-------------	-----	------------	-----------------

株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2020年12月限)	買建	388	米ドル	65,311,505	6,909,957,228	64,674,750	6,842,588,548	0.98
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2020年12月限)	買建	21	カナダドル	4,079,790	322,425,802	4,064,760	321,237,980	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12月限)	買建	254	ユーロ	8,342,255	1,035,857,804	8,135,620	1,010,199,931	0.14
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2020年12月限)	買建	19	豪ドル	2,811,150	212,213,712	2,819,125	212,815,743	0.03
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2020年12月限)	買建	52	英ポンド	3,124,725	425,243,824	3,052,920	415,471,878	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12月限)	買建	28	スイスフラン	2,921,480	336,087,063	2,856,000	328,554,240	0.04

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国株式マザーファンド

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額(円)	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマーゼンゲマーケット株価指数先物(2020年12月限)	買建	313	米ドル	17,202,715	1,820,047,247	16,762,715	1,773,495,247	4.00
	シンガポール	シンガポール取引所	SGX FTSE China A50 指数先物(2020年10月限)	買建	188	米ドル	2,842,090	300,693,122	2,852,430	301,787,094	0.68

(参考) 新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 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) J-REITインデックス マザーファンド

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

種類	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12月限)	買建	680	日本円	1,160,970,800	1,168,580,000	3.09

(参考) 海外REITインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
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12月限)	買建	62	米ドル	2,007,730	212,417,834	1,936,880	204,921,904	0.74

(参考) 野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

ネクストコア

2020年9月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2013年 8月19日)	1,335	1,335	0.9583	0.9583
第2計算期間	(2014年 2月17日)	1,850	1,850	0.9721	0.9721
第3計算期間	(2014年 8月18日)	1,925	1,925	1.0181	1.0181
第4計算期間	(2015年 2月17日)	2,341	2,341	1.0461	1.0461
第5計算期間	(2015年 8月17日)	2,712	2,712	1.0175	1.0175
第6計算期間	(2016年 2月17日)	3,004	3,004	0.9984	0.9984
第7計算期間	(2016年 8月17日)	3,714	3,714	1.0329	1.0329
第8計算期間	(2017年 2月17日)	4,295	4,295	1.0153	1.0153
第9計算期間	(2017年 8月17日)	3,911	3,911	1.0230	1.0230
第10計算期間	(2018年 2月19日)	3,134	3,134	1.0190	1.0190
第11計算期間	(2018年 8月17日)	2,822	2,822	1.0165	1.0165

第12計算期間	(2019年 2月18日)	2,882	2,882	1.0211	1.0211
第13計算期間	(2019年 8月19日)	2,545	2,545	1.0574	1.0574
第14計算期間	(2020年 2月17日)	1,926	1,926	1.0840	1.0840
第15計算期間	(2020年 8月17日)	1,767	1,767	1.0471	1.0471
	2019年 9月末日	2,417		1.0682	
	10月末日	2,067		1.0750	
	11月末日	1,965		1.0727	
	12月末日	1,862		1.0717	
	2020年 1月末日	1,938		1.0803	
	2月末日	1,889		1.0654	
	3月末日	1,804		1.0397	
	4月末日	1,796		1.0417	
	5月末日	1,799		1.0446	
	6月末日	1,788		1.0454	
	7月末日	1,777		1.0495	
	8月末日	1,775		1.0469	
	9月末日	1,785		1.0489	

【分配の推移】

ネクストコア

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2013年 1月31日～2013年 8月19日	0.0000円
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	0.0000円
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	0.0000円
第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	0.0000円
第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	0.0000円
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	0.0000円
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	0.0000円
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	0.0000円
第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	0.0000円
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	0.0000円
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	0.0000円
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	0.0000円
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	0.0000円
第14計算期間	2019年 8月20日～2020年 2月17日	0.0000円
第15計算期間	2020年 2月18日～2020年 8月17日	0.0000円

【収益率の推移】

ネクストコア

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 1月31日～2013年 8月19日	4.2%
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	1.4%
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	4.7%
第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	2.8%
第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	2.7%
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	1.9%
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	3.5%
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	1.7%
第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	0.8%
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	0.4%
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	0.2%
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	0.5%
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	3.6%
第14計算期間	2019年 8月20日～2020年 2月17日	2.5%
第15計算期間	2020年 2月18日～2020年 8月17日	3.4%

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

（４）【設定及び解約の実績】

ネクストコア

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2013年 1月31日～2013年 8月19日	1,445,052,123	51,972,335	1,393,079,788
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	670,704,216	160,711,546	1,903,072,458
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	582,888,344	594,495,481	1,891,465,321
第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	858,557,285	512,113,562	2,237,909,044
第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	774,652,374	346,882,589	2,665,678,829
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	547,418,537	203,743,660	3,009,353,706
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	954,092,064	366,986,976	3,596,458,794
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	939,380,069	304,883,559	4,230,955,304
第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	332,500,890	739,734,400	3,823,721,794
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	110,489,900	857,902,021	3,076,309,673
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	172,843,131	472,676,803	2,776,476,001
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	414,396,154	367,449,793	2,823,422,362
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	145,606,121	562,058,695	2,406,969,788
第14計算期間	2019年 8月20日～2020年 2月17日	177,689,783	807,437,000	1,777,222,571

第15計算期間	2020年 2月18日 ~ 2020年 8月17日	71,260,857	160,465,274	1,688,018,154
---------	---------------------------	------------	-------------	---------------

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9月30日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2020年8月	0 円
2020年2月	0 円
2019年8月	0 円
2019年2月	0 円
2018年8月	0 円
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

銘柄	投資比率 (%)
国内株式マザーファンド	6.0
国内債券マザーファンド	28.2
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	5.5
外国債券マザーファンド	38.3
新興国株式マザーファンド	0.6
新興国債券マザーファンド	3.3
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1.7
J-REITインデックス マザーファンド	3.4
海外REITインデックス マザーファンド	1.8
野村マネー マザーファンド	0.1

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.2
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1
3	ソニー	電気機器	0.1
4	キーエンス	電気機器	0.1
5	任天堂	その他製品	0.1

・「国内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	国庫債券 利付（5年）第139回	国債証券	0.6
2	国庫債券 利付（10年）第345回	国債証券	0.5
3	国庫債券 利付（10年）第344回	国債証券	0.5
4	国庫債券 利付（10年）第342回	国債証券	0.5
5	国庫債券 利付（10年）第350回	国債証券	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	0.3
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.2
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1

・「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	0.6
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.6
3	US TREASURY BOND	国債証券	0.4
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.4
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.4

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.0
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.0
4	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	0.0
5	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.0

・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.1
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.1
3	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.1
4	REPUBLIC OF TURKEY	国債証券	0.0
5	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.0

・「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	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
3	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
4	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.0
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0

・「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	0.2
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.2
3	日本プロロシスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.2
4	G L P 投資法人 投資証券	投資証券	0.2
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

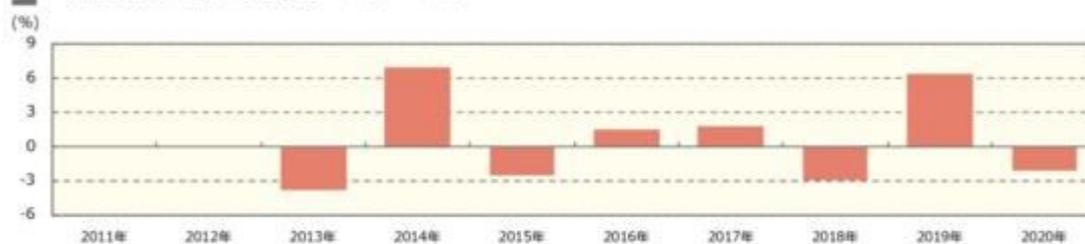
・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.1
2	EQUINIX INC	投資証券	0.1
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.1
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.1
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.0

・「野村マネー 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	九州電力 第433回	社債券	0.0
2	神奈川県 公債（5年）第66回	地方債証券	0.0
3	共同発行市場地方債 公募第92回	地方債証券	0.0
4	しんきん中金債券 利付第313回	特殊債券	0.0
5	東北電力 第456回	社債券	0.0

■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2013年は設定日（2013年1月31日）から年末までの収益率。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・ 申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・ 取得申込みの受付については、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。
- ・ 販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。
詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1万口以上1万口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。
- ・ 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。
- ・ 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号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、委託者に1万口単位、1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。
- ・ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ・ 一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・ 換金価額は、解約申込みの受付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/>

- ・なお、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6営業日目から申込みの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（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約金の支払いを延期する場合があります。
- ・金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

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

なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額

REIT (不動産投資信託)	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

2028年2月17日までとします(2013年1月31日設定)。

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年2月18日から8月17日までおよび8月18日から翌年2月17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、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b) 信託期間の終了

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

- ()上記()の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知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、その投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(c)運用報告書

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

(d)信託約款の変更等

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

(e)公告

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

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

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

(f)受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

(g)反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h)他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i)関係法人との契約の更新に関する手続

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

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

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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15期計算期間(2020年2月18日から2020年8月17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】

【ネクストコア】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第14期 (2020年 2月17日現在)	第15期 (2020年 8月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	171,384,644	350,668,093
親投資信託受益証券	1,775,367,259	1,441,888,545
派生商品評価勘定	2,693,144	1,283,244
流動資産合計	1,949,445,047	1,793,839,882
資産合計	1,949,445,047	1,793,839,882
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,481,346	10,146,859
未払解約金	4,046,418	2,860,809
未払受託者報酬	572,644	493,665
未払委託者報酬	14,888,771	12,835,242
未払利息	124	429
その他未払費用	34,294	29,566
流動負債合計	23,023,597	26,366,570
負債合計	23,023,597	26,366,570
純資産の部		
元本等		
元本	1,777,222,571	1,688,018,154
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	149,198,879	79,455,158
(分配準備積立金)	112,038,052	102,103,120
元本等合計	1,926,421,450	1,767,473,312
純資産合計	1,926,421,450	1,767,473,312
負債純資産合計	1,949,445,047	1,793,839,882

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第14期		第15期	
	自	2019年 8月20日	自	2020年 2月18日
	至	2020年 2月17日	至	2020年 8月17日
営業収益				
有価証券売買等損益		98,698,238		48,908,714
為替差損益		28,894,984		3,044,599
営業収益合計		69,803,254		51,953,313
営業費用				
支払利息		35,391		125,705
受託者報酬		572,644		493,665
委託者報酬		14,888,771		12,835,242
その他費用		45,094		29,566
営業費用合計		15,541,900		13,484,178
営業利益又は営業損失()		54,261,354		65,437,491
経常利益又は経常損失()		54,261,354		65,437,491
当期純利益又は当期純損失()		54,261,354		65,437,491
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()		9,416,840		5,739,879
期首剰余金又は期首欠損金()		138,051,889		149,198,879
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,745,536		3,325,342
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,745,536		3,325,342
剰余金減少額又は欠損金増加額		46,443,060		13,371,451
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		46,443,060		13,371,451
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		149,198,879		79,455,158

(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。 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.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。
3.金融商品の時価等に関する事項の補 足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
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、2020年 2月18日から2020年 8月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第14期 2020年 2月17日現在	第15期 2020年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,777,222,571口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,688,018,154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 1.0840円 (10,000口当たり純資産額) (10,840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 1.0471円 (10,000口当たり純資産額) (10,471円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2019年 8月20日 至 2020年 2月17日	第15期 自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日																																										
1.分配金の計算過程	1.分配金の計算過程																																										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>15,861,400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>20,625,002円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>142,347,355円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>75,551,650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>254,385,407円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,777,222,571口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	15,861,400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	20,625,002円	収益調整金額	C	142,347,355円	分配準備積立金額	D	75,551,650円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	254,385,407円	当ファンドの期末残存口数	F	1,777,222,571口	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>0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>139,582,685円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>102,103,120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>241,685,805円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,688,018,154口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	0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	139,582,685円	分配準備積立金額	D	102,103,120円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	241,685,805円	当ファンドの期末残存口数	F	1,688,018,154口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	15,861,400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	20,625,002円																																									
収益調整金額	C	142,347,355円																																									
分配準備積立金額	D	75,551,650円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	254,385,407円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	1,777,222,571口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	0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	139,582,685円																																									
分配準備積立金額	D	102,103,120円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	241,685,805円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	1,688,018,154口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,431円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,431円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第14期 自 2019年 8月20日 至 2020年 2月17日	第15期 自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>当ファンドは、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が、主要投資対象である親投資信託受益証券の保有状況によっては、市場リスクの内容は変動する場合があります。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第14期 2020年 2月17日現在	第15期 2020年 8月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 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。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第14期 自 2019年 8月20日 至 2020年 2月17日	第15期 自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第14期 自 2019年 8月20日 至 2020年 2月17日	第15期 自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
期首元本額 2,406,969,788円	期首元本額 1,777,222,571円
期中追加設定元本額 177,689,783円	期中追加設定元本額 71,260,857円
期中一部解約元本額 807,437,000円	期中一部解約元本額 160,465,274円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第14期 自 2019年 8月20日 至 2020年 2月17日	第15期 自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17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	67,145,317	10,239,017

合計	67,145,317	10,239,017
----	------------	------------

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第14期(2020年 2月17日現在)				第15期(2020年 8月17日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年 超				うち1年 超			
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	659,440,098	-	660,228,300	788,202	710,751,385	-	719,615,000	8,863,615
米ドル	443,615,174	-	447,096,400	3,481,226	361,096,010	-	359,945,900	1,150,110
カナダドル	12,421,380	-	12,421,500	120	14,957,551	-	15,262,700	305,149
ユーロ	147,014,460	-	145,151,400	1,863,060	269,001,471	-	276,432,900	7,431,429
英ポンド	40,637,906	-	40,082,000	555,906	47,114,966	-	48,835,500	1,720,534
豪ドル	15,751,178	-	15,477,000	274,178	18,581,387	-	19,138,000	556,613
合計	659,440,098	-	660,228,300	788,202	710,751,385	-	719,615,000	8,863,615

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年8月17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8月17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	33,098,538	54,586,108	
		国内債券マザーファンド	380,604,212	518,725,480	
		外国債券マザーファンド	273,452,949	679,421,197	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	21,574,829	66,057,811	
		野村マネー マザーファンド	2,282,012	2,328,336	
		J-REITインデックス マザーファンド	14,316,335	30,639,820	
		海外REITインデックス マザーファンド	11,369,461	23,899,743	
		新興国債券マザーファンド	21,737,982	43,960,720	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	16,786,771	22,269,330	
	小計	銘柄数：9 組入時価比率：81.6%	775,223,089	1,441,888,545 100.0%	
合計			1,441,888,545		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

（参考）

当ファンドは、当該計算期間末現在、主要投資対象である親投資信託受益証券のうち、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興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」、「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」および「野村マネー マザーファンド」受益証券に投資しており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2020年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	19,859,916,048
株式	442,417,529,610
派生商品評価勘定	218,397,408
未収配当金	522,665,614
未収利息	641,334
その他未収収益	33,837,779
流動資産合計	463,052,987,793

(2020年 8月17日現在)

資産合計	463,052,987,793
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,729,520
前受金	40,946,793
未払解約金	833,835,127
未払利息	24,305
有価証券貸借取引受入金	12,684,180,664
流動負債合計	13,560,716,409
負債合計	13,560,716,409
純資産の部	
元本等	
元本	272,549,797,985
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	176,942,473,399
元本等合計	449,492,271,384
純資産合計	449,492,271,384
負債純資産合計	463,052,987,793

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17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	1.6492円
(10,000口当たり純資産額)	(16,492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	11,968,673,740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 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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>株式</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 8月17日現在		2020年 2月18日
期首		2020年 2月18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		267,289,637,751円
同期中における追加設定元本額		33,312,344,337円
同期中における一部解約元本額		28,052,184,103円
期末元本額		272,549,797,985円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		169,465,745円
バランスセレクト50		376,081,969円
バランスセレクト70		479,437,831円
野村世界6資産分散投信(安定コース)		2,830,783,871円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		3,711,212,186円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		8,145,997,034円
野村資産設計ファンド2015		49,799,254円
野村資産設計ファンド2020		50,603,072円
野村資産設計ファンド2025		89,067,756円
野村資産設計ファンド2030		115,193,410円
野村資産設計ファンド2035		89,189,694円
野村資産設計ファンド2040		182,609,760円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)		89,170,095,596円
のむらっぴ・ファンド(保守型)		2,785,135,310円
のむらっぴ・ファンド(普通型)		9,146,243,852円
のむらっぴ・ファンド(積極型)		2,561,695,748円
野村資産設計ファンド2045		28,286,578円
野村インデックスファンド・TOPIX		1,759,288,541円
マイ・ロード		3,758,763,178円
ネクストコア		33,098,538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		1,579,856,509円
野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)		3,186,560,803円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)		1,221,365,592円
野村資産設計ファンド2050		46,460,911円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		15,529,021円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		7,563,647円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		5,895,307円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		3,826,553円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)		335,941,373円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)		343,394,950円
インデックス・ブレンド(タイプ)		4,423,831円
インデックス・ブレンド(タイプ)		4,673,838円
インデックス・ブレンド(タイプ)		20,261,266円
インデックス・ブレンド(タイプ)		6,105,087円
インデックス・ブレンド(タイプ)		22,759,975円
野村6資産均等バランス		1,494,750,732円
世界6資産分散ファンド		119,944,886円
野村資産設計ファンド2060		16,554,969円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式		470,578,701円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)		438,662,995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)	295,824,727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)	683,359,869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)	787,275,172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)	4,613,480円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	9,979,017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)	905,872円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,961,591,666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)	12,027,807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)	110,805,960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)	87,979,200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)	34,370,804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)	108,732,545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)	275,889,847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)	4,728,900,719円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	80,206,832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)	171,776,682円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	2,076,721,358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)	316,153,223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)	901,863,715円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	1,240,720円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,798,287円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	30,341,433円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	37,927,948円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	128,488,975円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,238,480,531円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	26,100,252,465円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	27,963,685,503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)	31,880,359,826円
マイバランスDC30	3,418,099,159円
マイバランスDC50	5,377,971,631円
マイバランスDC70	5,046,512,485円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,921,742,264円
野村DC運用戦略ファンド	523,718,310円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	42,663,097円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	993,815,580円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	771,943,100円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	627,600,138円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	8,038,862円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,891,799円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	50,587,931円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	13,232,887円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	9,480,333円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	8,913,680円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	306,472,044円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	240,430,564円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	123,151,443円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	142,548,895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8月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	9,300	2,685.00	24,970,500	
		日本水産	266,300	483.00	128,622,900	貸付有価証券 1,500株
		マルハニチロ	38,500	2,308.00	88,858,000	
		カネコ種苗	8,100	1,487.00	12,044,700	
		サカタのタネ	31,800	3,515.00	111,777,000	
		ホクト	20,300	2,150.00	43,645,000	貸付有価証券 1,500株(600株)
		ホクリヨウ	4,100	649.00	2,660,900	
		住石ホールディングス	53,800	117.00	6,294,600	貸付有価証券 200株
		日鉄鉱業	6,100	4,375.00	26,687,500	
		三井松島ホールディングス	10,300	756.00	7,786,800	
		国際石油開発帝石	979,500	678.10	664,198,950	貸付有価証券 455,800株
		石油資源開発	34,800	1,847.00	64,275,600	
		K&Oエナジーグループ	12,900	1,564.00	20,175,600	貸付有価証券 100株
		ヒノキヤグループ	6,600	1,772.00	11,695,200	
		ショーボンドホールディングス	41,500	5,000.00	207,500,000	貸付有価証券 1,300株
		ミライト・ホールディングス	79,200	1,515.00	119,988,000	
		タマホーム	14,300	1,253.00	17,917,900	貸付有価証券 6,700株(500株)
サンヨーホームズ	2,300	611.00	1,405,300			

日本アクア	10,600	618.00	6,550,800	貸付有価証券 2,200株
ファーストコーポレーション	8,100	604.00	4,892,400	
ベステラ	4,600	1,001.00	4,604,600	貸付有価証券 2,100株（1,200株）
TATERU	49,400	162.00	8,002,800	貸付有価証券 200株
キャンディル	4,400	656.00	2,886,400	貸付有価証券 400株（400株）
スペースバリューホールディングス	32,500	351.00	11,407,500	
ダイセキ環境ソリューション	5,100	709.00	3,615,900	
第一カッター興業	3,300	2,307.00	7,613,100	
明豊ファシリティワークス	8,600	571.00	4,910,600	
安藤・間	158,600	655.00	103,883,000	
東急建設	78,000	491.00	38,298,000	
コムシスホールディングス	94,400	3,135.00	295,944,000	貸付有価証券 1,100株
ビーアールホールディングス	29,000	656.00	19,024,000	貸付有価証券 200株
高松コンストラクショングループ	16,600	2,277.00	37,798,200	
東建コーポレーション	8,200	6,680.00	54,776,000	
ソネック	2,700	819.00	2,211,300	貸付有価証券 1,200株
ヤマウラ	11,600	826.00	9,581,600	
大成建設	205,100	3,515.00	720,926,500	
大林組	615,100	1,012.00	622,481,200	貸付有価証券 200株
清水建設	624,200	796.00	496,863,200	貸付有価証券 800株
飛鳥建設	17,600	1,093.00	19,236,800	
長谷工コーポレーション	238,100	1,372.00	326,673,200	
松井建設	24,200	716.00	17,327,200	
銭高組	2,700	3,845.00	10,381,500	
鹿島建設	482,900	1,311.00	633,081,900	貸付有価証券 100株
不動テトラ	16,100	1,400.00	22,540,000	

大末建設	7,100	850.00	6,035,000	
鉄建建設	13,400	2,046.00	27,416,400	
西松建設	47,400	1,986.00	94,136,400	
三井住友建設	148,600	437.00	64,938,200	
大豊建設	13,800	2,521.00	34,789,800	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
前田建設工業	154,100	756.00	116,499,600	貸付有価証券 100株
佐田建設	13,200	411.00	5,425,200	
ナカノフドー建設	16,800	373.00	6,266,400	
奥村組	29,000	2,500.00	72,500,000	
東鉄工業	26,400	2,604.00	68,745,600	
イチケン	4,400	1,577.00	6,938,800	
富士ピー・エス	9,100	581.00	5,287,100	貸付有価証券 1,100株
浅沼組	6,900	4,015.00	27,703,500	
戸田建設	255,400	683.00	174,438,200	貸付有価証券 7,900株
熊谷組	28,500	2,632.00	75,012,000	
北野建設	3,700	2,519.00	9,320,300	
植木組	2,700	2,546.00	6,874,200	
矢作建設工業	27,200	878.00	23,881,600	
ピーエス三菱	20,200	554.00	11,190,800	貸付有価証券 200株
日本ハウスホールディングス	42,000	259.00	10,878,000	
大東建託	67,100	8,514.00	571,289,400	
新日本建設	26,200	826.00	21,641,200	
N I P P O	50,900	2,827.00	143,894,300	
東亜道路工業	3,800	3,365.00	12,787,000	
前田道路	54,300	1,940.00	105,342,000	
日本道路	5,900	7,560.00	44,604,000	
東亜建設工業	19,200	1,559.00	29,932,800	貸付有価証券 7,500株（2,700株）
日本国土開発	59,800	574.00	34,325,200	
若築建設	11,100	1,170.00	12,987,000	
東洋建設	69,000	394.00	27,186,000	
五洋建設	243,800	640.00	156,032,000	貸付有価証券

				5,400株
世紀東急工業	29,500	775.00	22,862,500	
福田組	7,100	4,925.00	34,967,500	
住友林業	155,800	1,524.00	237,439,200	貸付有価証券 4,500株
日本基礎技術	20,700	401.00	8,300,700	
巴コーポレーション	27,300	355.00	9,691,500	
大和ハウス工業	608,500	2,645.50	1,609,786,750	貸付有価証券 200株
ライト工業	35,200	1,540.00	54,208,000	貸付有価証券 100株
積水ハウス	667,100	2,097.00	1,398,908,700	貸付有価証券 56,800株
日特建設	16,000	775.00	12,400,000	
北陸電気工事	10,600	987.00	10,462,200	
ユアテック	35,200	625.00	22,000,000	
日本リーテック	12,900	2,963.00	38,222,700	貸付有価証券 200株(200株)
四電工	3,300	2,339.00	7,718,700	
中電工	24,800	2,284.00	56,643,200	
関電工	87,500	876.00	76,650,000	貸付有価証券 100株
きんでん	146,100	1,718.00	250,999,800	
東京エネシス	20,400	766.00	15,626,400	
トーエネック	6,200	3,680.00	22,816,000	
住友電設	17,400	2,346.00	40,820,400	
日本電設工業	33,700	2,130.00	71,781,000	
協和エクシオ	93,300	2,723.00	254,055,900	貸付有価証券 1,000株
新日本空調	16,300	2,097.00	34,181,100	
九電工	43,200	3,005.00	129,816,000	
三機工業	44,300	1,168.00	51,742,400	
日揮ホールディングス	189,300	1,220.00	230,946,000	貸付有価証券 3,700株
中外炉工業	6,600	1,462.00	9,649,200	
ヤマト	19,700	639.00	12,588,300	
太平電業	14,900	2,216.00	33,018,400	
高砂熱学工業	51,800	1,443.00	74,747,400	
三晃金属工業	2,700	2,081.00	5,618,700	

朝日工業社	4,100	2,925.00	11,992,500	
明星工業	39,800	817.00	32,516,600	
大気社	29,900	3,005.00	89,849,500	
ダイダン	14,700	2,655.00	39,028,500	
日比谷総合設備	19,800	1,796.00	35,560,800	
フィル・カンパニー	3,500	1,723.00	6,030,500	貸付有価証券 1,000株（800株）
OSJBホールディングス	97,000	228.00	22,116,000	貸付有価証券 13,600株
レイズネクスト	33,000	1,274.00	42,042,000	貸付有価証券 3,300株
日本製粉	57,600	1,673.00	96,364,800	
日清製粉グループ本社	222,400	1,751.00	389,422,400	貸付有価証券 100株
日東富士製粉	1,400	6,130.00	8,582,000	
昭和産業	18,100	3,485.00	63,078,500	貸付有価証券 6,400株（2,100株）
鳥越製粉	17,400	927.00	16,129,800	
中部飼料	24,000	1,597.00	38,328,000	
フィード・ワン	132,200	200.00	26,440,000	
東洋精糖	3,300	1,220.00	4,026,000	
日本甜菜製糖	10,300	1,780.00	18,334,000	
三井製糖	17,300	1,972.00	34,115,600	
塩水港精糖	21,300	236.00	5,026,800	貸付有価証券 9,500株
日新製糖	9,300	1,800.00	16,740,000	
森永製菓	46,200	4,030.00	186,186,000	
中村屋	5,100	4,180.00	21,318,000	
江崎グリコ	54,200	4,795.00	259,889,000	貸付有価証券 800株
名糖産業	9,500	1,451.00	13,784,500	
井村屋グループ	11,200	2,438.00	27,305,600	
不二家	12,600	2,171.00	27,354,600	
山崎製パン	147,500	1,730.00	255,175,000	貸付有価証券 5,900株
第一屋製パン	3,800	985.00	3,743,000	
モロゾフ	3,400	5,390.00	18,326,000	
亀田製菓	11,200	5,400.00	60,480,000	

寿スピリッツ	19,000	4,125.00	78,375,000	貸付有価証券 1,100株
カルビー	89,700	3,330.00	298,701,000	
森永乳業	36,400	4,995.00	181,818,000	貸付有価証券 400株
六甲バター	13,100	1,690.00	22,139,000	
ヤクルト本社	135,400	6,000.00	812,400,000	貸付有価証券 400株
明治ホールディングス	130,200	8,520.00	1,109,304,000	貸付有価証券 13,400株
雪印メグミルク	47,400	2,400.00	113,760,000	
プリマハム	30,800	3,020.00	93,016,000	
日本ハム	75,200	4,805.00	361,336,000	
林兼産業	6,500	561.00	3,646,500	
丸大食品	21,000	1,820.00	38,220,000	
S Foods	15,700	3,005.00	47,178,500	貸付有価証券 100株
柿安本店	6,800	2,480.00	16,864,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	126,700	670.00	84,889,000	
サッポロホールディングス	67,200	1,892.00	127,142,400	貸付有価証券 1,100株
アサヒグループホールディングス	412,200	3,658.00	1,507,827,600	貸付有価証券 18,200株（8,500株）
キリンホールディングス	834,800	2,102.00	1,754,749,600	貸付有価証券 40,700株
宝ホールディングス	145,900	1,012.00	147,650,800	貸付有価証券 200株
オエノンホールディングス	55,900	425.00	23,757,500	
養命酒製造	6,000	1,802.00	10,812,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	150,700	1,708.00	257,395,600	
サントリー食品インターナショナル	131,700	3,895.00	512,971,500	貸付有価証券 13,400株
ダイトーグループホールディングス	10,100	4,735.00	47,823,500	貸付有価証券 4,300株（3,800株）
伊藤園	59,800	6,120.00	365,976,000	貸付有価証券 8,800株（2,500株）
キーコーヒー	19,300	2,114.00	40,800,200	
ユニカフェ	5,900	945.00	5,575,500	

ジャパンフーズ	2,800	1,213.00	3,396,400	
日清オイリオグループ	25,300	3,245.00	82,098,500	
不二製油グループ本社	48,000	3,005.00	144,240,000	貸付有価証券 700株
かどや製油	2,100	3,760.00	7,896,000	
J - オイルミルズ	10,200	3,805.00	38,811,000	
キッコーマン	141,700	5,750.00	814,775,000	貸付有価証券 14,000株
味の素	434,700	1,896.50	824,408,550	貸付有価証券 200株
キューピー	109,600	1,991.00	218,213,600	
ハウス食品グループ本社	73,600	3,550.00	261,280,000	貸付有価証券 100株
カゴメ	80,400	3,230.00	259,692,000	貸付有価証券 800株
焼津水産化学工業	9,500	919.00	8,730,500	
アリアケジャパン	18,000	7,260.00	130,680,000	
ピエトロ	2,600	1,663.00	4,323,800	
エバラ食品工業	4,800	2,212.00	10,617,600	
やまみ	1,700	2,129.00	3,619,300	
ニチレイ	93,800	2,966.00	278,210,800	
東洋水産	101,300	6,230.00	631,099,000	
イトアンド	6,800	1,804.00	12,267,200	貸付有価証券 3,100株
大冷	2,600	2,137.00	5,556,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,900	929.00	10,126,100	貸付有価証券 5,100株
日清食品ホールディングス	83,700	10,620.00	888,894,000	貸付有価証券 200株
永谷園ホールディングス	9,600	2,205.00	21,168,000	
一正蒲鉾	7,600	1,021.00	7,759,600	
フジッコ	21,300	2,009.00	42,791,700	
ロック・フィールド	21,200	1,289.00	27,326,800	貸付有価証券 1,100株
日本たばこ産業	1,055,500	1,990.00	2,100,445,000	貸付有価証券 400,000株
ケンコーマヨネーズ	11,000	1,750.00	19,250,000	
わらべや日洋ホールディングス	12,900	1,535.00	19,801,500	

なとり	11,000	1,920.00	21,120,000	貸付有価証券 4,200株
イフジ産業	3,400	848.00	2,883,200	
ピックルスコーポレーション	4,300	2,816.00	12,108,800	
北の達人コーポレーション	68,700	502.00	34,487,400	貸付有価証券 32,300株(25,200株)
ユーグレナ	84,900	716.00	60,788,400	貸付有価証券 12,900株(600株)
ミヨシ油脂	6,900	1,138.00	7,852,200	
理研ビタミン	18,600	2,226.00	41,403,600	
片倉工業	25,700	1,156.00	29,709,200	
グンゼ	14,100	3,865.00	54,496,500	
東洋紡	75,900	1,510.00	114,609,000	
ユニチカ	56,300	371.00	20,887,300	貸付有価証券 8,600株(8,600株)
富士紡ホールディングス	9,300	3,460.00	32,178,000	
倉敷紡績	19,100	2,014.00	38,467,400	貸付有価証券 800株
シキボウ	10,100	973.00	9,827,300	
日本毛織	63,200	967.00	61,114,400	
ダイトウボウ	31,100	110.00	3,421,000	貸付有価証券 14,600株
トーア紡コーポレーション	7,600	460.00	3,496,000	
ダイドーリミテッド	25,200	197.00	4,964,400	貸付有価証券 100株
帝国繊維	21,700	2,534.00	54,987,800	
帝人	156,700	1,680.00	263,256,000	
東レ	1,390,800	504.60	701,797,680	貸付有価証券 400株
サカイオーベックス	5,100	2,157.00	11,000,700	
住江織物	4,200	1,803.00	7,572,600	
日本フェルト	10,900	458.00	4,992,200	貸付有価証券 4,800株
イチカワ	2,700	1,344.00	3,628,800	
日東製網	2,200	1,410.00	3,102,000	
アツギ	15,800	496.00	7,836,800	
ダイニック	7,300	777.00	5,672,100	

セーレン	47,200	1,220.00	57,584,000	
ソトー	7,600	947.00	7,197,200	
東海染工	2,600	1,125.00	2,925,000	
小松マテーレ	31,500	771.00	24,286,500	
ワコールホールディングス	47,900	1,846.00	88,423,400	
ホギメディカル	21,900	3,260.00	71,394,000	
クラウドシアホールディングス	4,700	311.00	1,461,700	貸付有価証券 2,200株
T S Iホールディングス	58,300	338.00	19,705,400	貸付有価証券 3,100株
マツオカコーポレーション	5,500	1,991.00	10,950,500	貸付有価証券 2,200株（800株）
ワールド	27,200	1,573.00	42,785,600	
三陽商会	10,000	603.00	6,030,000	貸付有価証券 4,700株（100株）
ナイガイ	7,000	355.00	2,485,000	
オンワードホールディングス	115,400	294.00	33,927,600	
ルックホールディングス	6,600	737.00	4,864,200	
ゴールドウイン	34,800	6,840.00	238,032,000	貸付有価証券 1,600株
デサント	37,500	1,899.00	71,212,500	
キング	9,100	563.00	5,123,300	
ヤマトインターナショナル	16,900	368.00	6,219,200	貸付有価証券 7,900株
特種東海製紙	12,200	4,665.00	56,913,000	
王子ホールディングス	803,000	467.00	375,001,000	貸付有価証券 1,100株
日本製紙	84,900	1,364.00	115,803,600	貸付有価証券 10,700株（1,600株）
三菱製紙	21,800	342.00	7,455,600	
北越コーポレーション	114,500	362.00	41,449,000	
中越パルプ工業	8,100	1,568.00	12,700,800	
巴川製紙所	5,700	851.00	4,850,700	
大王製紙	84,700	1,452.00	122,984,400	貸付有価証券 34,600株（27,800株）
阿波製紙	5,000	492.00	2,460,000	
レンゴー	181,600	806.00	146,369,600	貸付有価証券

				5,200株
トーマク	11,800	1,650.00	19,470,000	貸付有価証券 100株
ザ・パック	14,500	2,657.00	38,526,500	
クラレ	302,500	1,115.00	337,287,500	貸付有価証券 101,600株
旭化成	1,273,200	900.70	1,146,771,240	貸付有価証券 700株
共和レザー	10,400	553.00	5,751,200	
昭和電工	145,900	2,251.00	328,420,900	貸付有価証券 22,000株
住友化学	1,411,200	353.00	498,153,600	貸付有価証券 1,400株
住友精化	8,500	3,550.00	30,175,000	
日産化学	106,700	5,560.00	593,252,000	
ラサ工業	6,800	1,698.00	11,546,400	
クレハ	16,500	4,685.00	77,302,500	
多木化学	7,500	5,990.00	44,925,000	貸付有価証券 3,000株
テイカ	14,100	1,362.00	19,204,200	
石原産業	34,400	729.00	25,077,600	
片倉コープアグリ	5,000	1,237.00	6,185,000	
日本曹達	28,400	2,993.00	85,001,200	
東ソー	296,900	1,490.00	442,381,000	貸付有価証券 100株
トクヤマ	55,400	2,656.00	147,142,400	貸付有価証券 100株
セントラル硝子	39,300	2,076.00	81,586,800	
東亜合成	120,600	1,055.00	127,233,000	
大阪ソーダ	19,500	2,497.00	48,691,500	
関東電化工業	45,600	778.00	35,476,800	
デンカ	70,100	2,877.00	201,677,700	
信越化学工業	329,800	12,800.00	4,221,440,000	貸付有価証券 100株
日本カーバイド工業	6,800	1,182.00	8,037,600	
堺化学工業	12,400	1,965.00	24,366,000	
第一稀元素化学工業	20,800	737.00	15,329,600	
エア・ウォーター	178,700	1,479.00	264,297,300	
大陽日酸	184,600	1,911.00	352,770,600	

日本化学工業	6,000	2,303.00	13,818,000	
東邦アセチレン	2,900	1,263.00	3,662,700	
日本パーカライジング	96,900	1,060.00	102,714,000	
高圧ガス工業	30,500	789.00	24,064,500	
チタン工業	2,400	1,716.00	4,118,400	貸付有価証券 700株
四国化成工業	28,100	1,147.00	32,230,700	
戸田工業	4,500	2,239.00	10,075,500	
ステラ ケミファ	10,500	2,648.00	27,804,000	
保土谷化学工業	7,200	5,030.00	36,216,000	
日本触媒	29,800	5,480.00	163,304,000	貸付有価証券 8,900株(1,600株)
大日精化工業	17,000	2,239.00	38,063,000	
カネカ	49,700	2,744.00	136,376,800	
三菱瓦斯化学	178,700	1,842.00	329,165,400	
三井化学	178,206	2,420.00	431,258,520	
J S R	179,000	2,343.00	419,397,000	
東京応化工業	33,000	5,490.00	181,170,000	貸付有価証券 2,200株
大阪有機化学工業	17,700	2,575.00	45,577,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,284,100	616.90	792,161,290	貸付有価証券 63,500株
K Hネオケム	31,600	2,165.00	68,414,000	
ダイセル	250,100	712.00	178,071,200	
住友ベークライト	30,200	2,789.00	84,227,800	
積水化学工業	406,200	1,641.00	666,574,200	
日本ゼオン	173,200	1,112.00	192,598,400	
アイカ工業	57,600	3,635.00	209,376,000	
宇部興産	97,000	1,888.00	183,136,000	
積水樹脂	34,600	2,143.00	74,147,800	
タキロンシーアイ	41,600	705.00	29,328,000	
旭有機材	10,900	1,314.00	14,322,600	
ニチバン	10,100	1,523.00	15,382,300	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	48,300	396.00	19,126,800	
大倉工業	9,100	1,488.00	13,540,800	貸付有価証券 1,300株
積水化成成品工業	25,800	547.00	14,112,600	

群栄化学工業	4,400	2,393.00	10,529,200	
タイガースポリマー	10,100	438.00	4,423,800	
ミライアル	6,800	1,026.00	6,976,800	
ダイキアクシス	6,800	904.00	6,147,200	
ダイキョーニシカワ	40,500	527.00	21,343,500	
竹本容器	6,900	955.00	6,589,500	
森六ホールディングス	10,300	1,745.00	17,973,500	
日本化薬	118,900	1,091.00	129,719,900	貸付有価証券 1,700株
カーリットホールディングス	20,500	492.00	10,086,000	貸付有価証券 9,200株
日本精化	15,400	1,515.00	23,331,000	
扶桑化学工業	19,500	3,735.00	72,832,500	貸付有価証券 3,800株
トリケミカル研究所	4,300	10,310.00	44,333,000	貸付有価証券 100株
A D E K A	88,400	1,512.00	133,660,800	
日油	72,300	4,205.00	304,021,500	
新日本理化	31,800	160.00	5,088,000	
ハリマ化成グループ	15,900	963.00	15,311,700	
花王	469,600	8,041.00	3,776,053,600	貸付有価証券 29,200株
第一工業製薬	7,200	4,495.00	32,364,000	
石原ケミカル	5,200	2,011.00	10,457,200	
日華化学	6,500	894.00	5,811,000	
ニイタカ	4,000	3,105.00	12,420,000	貸付有価証券 200株
三洋化成工業	11,500	4,785.00	55,027,500	
有機合成薬品工業	14,700	345.00	5,071,500	貸付有価証券 4,700株（1,500株）
大日本塗料	21,700	920.00	19,964,000	貸付有価証券 100株
日本ペイントホールディングス	158,500	8,010.00	1,269,585,000	貸付有価証券 3,400株
関西ペイント	215,800	2,414.00	520,941,200	貸付有価証券 400株
神東塗料	15,100	160.00	2,416,000	
中国塗料	54,700	966.00	52,840,200	
日本特殊塗料	14,400	953.00	13,723,200	

藤倉化成	25,900	524.00	13,571,600	
太陽ホールディングス	14,100	5,490.00	77,409,000	
D I C	81,100	2,548.00	206,642,800	貸付有価証券 2,200株
サカタインクス	41,900	996.00	41,732,400	貸付有価証券 1,400株
東洋インキ S C ホール ディングス	40,600	1,928.00	78,276,800	貸付有価証券 4,500株
T & K T O K A	14,900	751.00	11,189,900	
富士フィルムホールディ ングス	376,000	5,071.00	1,906,696,000	貸付有価証券 200株
資生堂	389,700	5,662.00	2,206,481,400	貸付有価証券 5,100株(3,400株)
ライオン	255,000	2,300.00	586,500,000	貸付有価証券 5,000株
高砂香料工業	12,300	2,013.00	24,759,900	
マンダム	44,100	1,685.00	74,308,500	
ミルボン	26,200	5,590.00	146,458,000	貸付有価証券 100株
ファンケル	79,400	3,125.00	248,125,000	貸付有価証券 32,700株
コーセー	36,900	11,960.00	441,324,000	貸付有価証券 600株
コタ	11,300	1,205.00	13,616,500	
シーボン	2,500	1,838.00	4,595,000	
ポーラ・オルビスホール ディングス	83,700	1,881.00	157,439,700	貸付有価証券 22,400株
ノエビアホールディング ス	16,600	4,710.00	78,186,000	
アジュバンコスメジャパ ン	4,400	959.00	4,219,600	
エステー	12,600	2,067.00	26,044,200	
アグロ カネショウ	7,300	1,505.00	10,986,500	
コニシ	32,200	1,474.00	47,462,800	
長谷川香料	33,800	2,183.00	73,785,400	
星光 P M C	11,200	661.00	7,403,200	
小林製薬	55,000	9,260.00	509,300,000	貸付有価証券 900株
荒川化学工業	17,600	1,249.00	21,982,400	
メック	13,400	1,830.00	24,522,000	貸付有価証券

				200株
日本高純度化学	5,400	2,679.00	14,466,600	
タカラバイオ	51,300	2,997.00	153,746,100	貸付有価証券 16,600株(1,000株)
J C U	23,700	3,525.00	83,542,500	
新田ゼラチン	12,300	672.00	8,265,600	
O A T アグリオ	3,700	1,093.00	4,044,100	
デクセリアルズ	50,600	1,005.00	50,853,000	
アース製薬	13,600	7,650.00	104,040,000	
北興化学工業	18,300	646.00	11,821,800	
大成ラミック	6,400	2,805.00	17,952,000	
クミアイ化学工業	81,100	1,092.00	88,561,200	貸付有価証券 6,900株
日本農薬	34,900	529.00	18,462,100	
アキレス	13,500	1,861.00	25,123,500	
有沢製作所	31,000	854.00	26,474,000	貸付有価証券 500株
日東電工	135,300	6,210.00	840,213,000	貸付有価証券 300株
レック	20,900	1,696.00	35,446,400	貸付有価証券 200株
三光合成	22,400	266.00	5,958,400	
きもと	33,400	152.00	5,076,800	
藤森工業	17,600	3,885.00	68,376,000	
前澤化成工業	12,500	1,000.00	12,500,000	
未来工業	10,500	1,956.00	20,538,000	
ウェーブロックホールディングス	6,800	794.00	5,399,200	
J S P	11,500	1,603.00	18,434,500	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	21,600	8,230.00	177,768,000	
天馬	13,100	1,788.00	23,422,800	
信越ポリマー	35,200	871.00	30,659,200	
東リ	48,800	251.00	12,248,800	
ニフコ	72,000	2,554.00	183,888,000	
バルカー	15,900	1,885.00	29,971,500	
ユニ・チャーム	415,800	4,648.00	1,932,638,400	貸付有価証券 10,600株
ショーエイコーポレー	2,900	1,180.00	3,422,000	貸付有価証券

ション				1,300株
協和キリン	197,300	2,718.00	536,261,400	貸付有価証券 8,400株
武田薬品工業	1,631,800	3,975.00	6,486,405,000	貸付有価証券 300株
アステラス製薬	1,700,500	1,761.00	2,994,580,500	貸付有価証券 1,000株
大日本住友製薬	145,400	1,402.00	203,850,800	貸付有価証券 200株
塩野義製薬	246,600	6,111.00	1,506,972,600	貸付有価証券 100株
わかもと製薬	23,300	273.00	6,360,900	
あすか製薬	22,300	1,198.00	26,715,400	
日本新薬	51,300	8,870.00	455,031,000	貸付有価証券 400株
ピオフェルミン製薬	3,300	2,399.00	7,916,700	
中外製薬	613,400	4,810.00	2,950,454,000	貸付有価証券 10,600株(1,800株)
科研製薬	33,600	4,980.00	167,328,000	貸付有価証券 200株
エーザイ	234,800	9,611.00	2,256,662,800	貸付有価証券 200株
ロート製薬	100,700	3,475.00	349,932,500	
小野薬品工業	450,400	3,233.00	1,456,143,200	
久光製薬	51,900	4,970.00	257,943,000	
持田製薬	27,200	3,990.00	108,528,000	
参天製薬	365,500	2,016.00	736,848,000	
扶桑薬品工業	6,900	2,661.00	18,360,900	
日本ケミファ	2,600	2,392.00	6,219,200	
ツムラ	60,800	2,881.00	175,164,800	
日医工	55,600	1,219.00	67,776,400	
キッセイ薬品工業	34,700	2,406.00	83,488,200	
生化学工業	38,100	1,047.00	39,890,700	
栄研化学	34,500	1,887.00	65,101,500	
日水製薬	8,200	1,118.00	9,167,600	
鳥居薬品	12,300	2,988.00	36,752,400	
JCRファーマ	13,800	12,320.00	170,016,000	
東和薬品	25,100	2,134.00	53,563,400	
富士製薬工業	13,300	1,156.00	15,374,800	

沢井製薬	40,300	5,300.00	213,590,000	
ゼリア新薬工業	35,600	1,970.00	70,132,000	貸付有価証券 100株
第一三共	561,200	9,617.00	5,397,060,400	貸付有価証券 800株
キョーリン製薬ホールディングス	43,300	2,010.00	87,033,000	貸付有価証券 1,000株
大幸薬品	24,000	2,700.00	64,800,000	貸付有価証券 4,500株(4,500株)
ダイト	12,200	3,555.00	43,371,000	
大塚ホールディングス	407,600	4,727.00	1,926,725,200	貸付有価証券 33,200株
大正製薬ホールディングス	41,500	6,550.00	271,825,000	貸付有価証券 200株
ペプチドリーム	99,700	4,500.00	448,650,000	貸付有価証券 23,400株
日本コークス工業	165,700	64.00	10,604,800	貸付有価証券 200株
ニチレキ	23,200	1,652.00	38,326,400	
ユシロ化学工業	11,000	1,321.00	14,531,000	
ビーピー・カストロール	7,000	1,125.00	7,875,000	
富士石油	52,400	192.00	10,060,800	
MORESCO	7,100	1,001.00	7,107,100	
出光興産	217,600	2,357.00	512,883,200	貸付有価証券 2,100株
ENEOSホールディングス	2,950,500	417.10	1,230,653,550	貸付有価証券 300株
コスモエネルギーホールディングス	56,800	1,682.00	95,537,600	
横浜ゴム	113,600	1,618.00	183,804,800	貸付有価証券 7,300株
TOYO TIRE	103,200	1,693.00	174,717,600	貸付有価証券 33,200株
ブリヂストン	521,500	3,293.00	1,717,299,500	貸付有価証券 109,600株
住友ゴム工業	176,200	995.00	175,319,000	貸付有価証券 1,400株
藤倉コンポジット	17,100	354.00	6,053,400	
オカモト	11,900	4,330.00	51,527,000	
フコク	8,600	641.00	5,512,600	貸付有価証券 1,300株

ニッタ	22,100	2,392.00	52,863,200	
住友理工	38,000	550.00	20,900,000	
三ツ星ベルト	25,800	1,709.00	44,092,200	
バンドー化学	34,500	645.00	22,252,500	
日東紡績	29,200	4,130.00	120,596,000	貸付有価証券 12,500株
A G C	180,000	3,080.00	554,400,000	貸付有価証券 900株
日本板硝子	93,800	403.00	37,801,400	貸付有価証券 41,400株（10,100株）
石塚硝子	3,600	1,917.00	6,901,200	
日本山村硝子	8,100	852.00	6,901,200	
日本電気硝子	72,700	1,893.00	137,621,100	貸付有価証券 24,200株
オハラ	7,700	1,024.00	7,884,800	貸付有価証券 400株（300株）
住友大阪セメント	37,100	3,650.00	135,415,000	貸付有価証券 200株
太平洋セメント	123,900	2,546.00	315,449,400	
日本ヒューム	19,700	764.00	15,050,800	
日本コンクリート工業	42,200	286.00	12,069,200	貸付有価証券 100株
三谷セキサン	9,100	6,490.00	59,059,000	
アジアパイルホールディングス	27,800	467.00	12,982,600	
東海カーボン	191,800	972.00	186,429,600	貸付有価証券 68,700株（10,000株）
日本カーボン	10,800	3,455.00	37,314,000	貸付有価証券 100株
東洋炭素	11,500	1,750.00	20,125,000	
ノリタケカンパニーリミテド	10,800	3,265.00	35,262,000	
TOTO	140,100	4,430.00	620,643,000	
日本碍子	235,400	1,540.00	362,516,000	貸付有価証券 100株
日本特殊陶業	149,200	1,804.00	269,156,800	貸付有価証券 600株
ダントーホールディングス	14,600	183.00	2,671,800	貸付有価証券 6,800株
MARUWA	7,500	9,000.00	67,500,000	

品川リフラクトリーズ	5,200	2,277.00	11,840,400	
黒崎播磨	3,900	3,260.00	12,714,000	
ヨータイ	15,600	740.00	11,544,000	
イソライト工業	10,100	427.00	4,312,700	
東京窯業	24,900	312.00	7,768,800	
ニッカトー	8,900	682.00	6,069,800	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレー テッド	17,500	3,795.00	66,412,500	
クニミネ工業	7,900	990.00	7,821,000	
エーアンドエーマテリア ル	3,300	1,021.00	3,369,300	
ニチアス	53,700	2,458.00	131,994,600	
ニチハ	27,300	2,453.00	66,966,900	
日本製鉄	868,000	1,020.00	885,360,000	貸付有価証券 9,700株
神戸製鋼所	355,000	395.00	140,225,000	貸付有価証券 83,700株
中山製鋼所	26,900	356.00	9,576,400	
合同製鐵	10,400	1,916.00	19,926,400	
ジェイ エフ イー ホールディングス	523,800	787.00	412,230,600	
東京製鐵	94,400	688.00	64,947,200	
共英製鋼	21,900	1,285.00	28,141,500	貸付有価証券 9,800株
大和工業	41,200	2,559.00	105,430,800	
東京鐵鋼	8,000	1,555.00	12,440,000	貸付有価証券 1,400株
大阪製鐵	10,300	1,096.00	11,288,800	
淀川製鋼所	26,200	1,885.00	49,387,000	
丸一鋼管	63,000	2,822.00	177,786,000	
モリ工業	5,800	2,240.00	12,992,000	
大同特殊鋼	31,700	3,405.00	107,938,500	
日本高周波鋼業	7,200	334.00	2,404,800	
日本冶金工業	16,000	1,539.00	24,624,000	貸付有価証券 200株
山陽特殊製鋼	13,300	889.00	11,823,700	
愛知製鋼	10,900	2,680.00	29,212,000	
日立金属	208,900	1,509.00	315,230,100	

日本金属	4,500	556.00	2,502,000	
大平洋金属	13,100	1,676.00	21,955,600	貸付有価証券 500株
新日本電工	125,100	195.00	24,394,500	貸付有価証券 500株
栗本鐵工所	9,600	1,895.00	18,192,000	
虹技	2,900	1,209.00	3,506,100	
日本鑄鉄管	2,000	1,248.00	2,496,000	
三菱製鋼	14,300	567.00	8,108,100	
日亜鋼業	28,400	274.00	7,781,600	
日本精線	3,200	3,220.00	10,304,000	
エンビプロ・ホールディングス	8,200	534.00	4,378,800	貸付有価証券 100株（100株）
シンニッタン	30,100	218.00	6,561,800	貸付有価証券 100株
新家工業	4,400	1,023.00	4,501,200	
大紀アルミニウム工業所	31,900	544.00	17,353,600	
日本軽金属ホールディングス	490,700	186.00	91,270,200	貸付有価証券 5,800株
三井金属鉱業	52,300	2,558.00	133,783,400	貸付有価証券 1,900株
東邦亜鉛	9,900	1,764.00	17,463,600	
三菱マテリアル	128,100	2,233.00	286,047,300	
住友金属鉱山	247,900	3,274.00	811,624,600	貸付有価証券 500株
DOWAホールディングス	49,100	3,255.00	159,820,500	
古河機械金属	34,500	1,062.00	36,639,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,200	888.00	17,937,600	貸付有価証券 3,400株（300株）
東邦チタニウム	34,700	677.00	23,491,900	貸付有価証券 13,400株（9,000株）
UACJ	29,400	1,930.00	56,742,000	
CKサンエツ	4,000	3,110.00	12,440,000	
古河電気工業	60,200	2,426.00	146,045,200	貸付有価証券 200株
住友電気工業	725,200	1,293.00	937,683,600	貸付有価証券 200株
フジクラ	234,200	311.00	72,836,200	貸付有価証券 5,200株

昭和電線ホールディングス	22,500	1,110.00	24,975,000	
東京特殊電線	2,900	2,250.00	6,525,000	
タツタ電線	38,400	598.00	22,963,200	
カナレ電気	3,200	1,596.00	5,107,200	
平河ヒューテック	9,700	975.00	9,457,500	
リョービ	23,900	1,169.00	27,939,100	貸付有価証券 100株
アーレスティ	25,400	327.00	8,305,800	
アサヒホールディングス	34,000	3,475.00	118,150,000	
稲葉製作所	10,900	1,308.00	14,257,200	貸付有価証券 2,500株
宮地エンジニアリンググループ	5,900	1,640.00	9,676,000	貸付有価証券 200株
トーカコ	53,900	1,170.00	63,063,000	
アルファC o	6,800	931.00	6,330,800	
SUMCO	248,200	1,545.00	383,469,000	貸付有価証券 61,200株
川田テクノロジーズ	4,000	4,550.00	18,200,000	
RS Technologies	6,300	3,750.00	23,625,000	
信和	11,200	695.00	7,784,000	
東洋製罐グループホールディングス	123,500	1,192.00	147,212,000	貸付有価証券 1,400株
ホッカンホールディングス	10,700	1,578.00	16,884,600	
コロナ	10,700	996.00	10,657,200	
横河ブリッジホールディングス	36,100	1,890.00	68,229,000	
駒井ハルテック	3,600	1,347.00	4,849,200	
高田機工	1,800	2,335.00	4,203,000	
三和ホールディングス	182,900	974.00	178,144,600	
文化シャッター	57,200	738.00	42,213,600	
三協立山	25,000	906.00	22,650,000	
アルインコ	14,100	902.00	12,718,200	
東洋シャッター	4,700	713.00	3,351,100	
LIXILグループ	286,200	1,715.00	490,833,000	貸付有価証券 1,000株
日本ファイルコン	13,500	541.00	7,303,500	

ノーリツ	40,200	1,342.00	53,948,400	
長府製作所	19,700	2,144.00	42,236,800	
リンナイ	37,700	9,420.00	355,134,000	
ダイニチ工業	10,400	667.00	6,936,800	
日東精工	24,300	458.00	11,129,400	
三洋工業	2,600	1,886.00	4,903,600	
岡部	39,300	794.00	31,204,200	貸付有価証券 4,300株
ジーテクト	24,100	998.00	24,051,800	
東プレ	36,200	1,103.00	39,928,600	
高周波熱錬	37,300	506.00	18,873,800	貸付有価証券 16,700株
東京製綱	13,900	536.00	7,450,400	
サンコール	14,500	395.00	5,727,500	貸付有価証券 100株
モリテック スチール	15,100	294.00	4,439,400	
パイオラックス	28,700	1,621.00	46,522,700	
エイチワン	19,000	538.00	10,222,000	
日本発條	208,100	660.00	137,346,000	
中央発條	2,300	2,553.00	5,871,900	
アドバネクス	2,800	1,370.00	3,836,000	
立川ブラインド工業	8,500	1,208.00	10,268,000	
三益半導体工業	15,100	2,166.00	32,706,600	
日本ドライケミカル	4,800	1,548.00	7,430,400	貸付有価証券 100株
日本製鋼所	58,800	1,613.00	94,844,400	
三浦工業	83,900	4,270.00	358,253,000	貸付有価証券 100株
タクマ	65,700	1,657.00	108,864,900	
ツガミ	40,200	1,087.00	43,697,400	貸付有価証券 13,700株
オークマ	22,600	4,765.00	107,689,000	
芝浦機械	21,900	2,068.00	45,289,200	
アマダ	240,500	854.00	205,387,000	貸付有価証券 100株
アイダエンジニアリング	50,700	693.00	35,135,100	
滝澤鉄工所	6,000	1,021.00	6,126,000	
F U J I	83,400	2,065.00	172,221,000	貸付有価証券

				17,200株(17,200株)
牧野フライス製作所	22,700	3,585.00	81,379,500	
オーエスジー	95,700	1,566.00	149,866,200	貸付有価証券 900株
ダイジェット工業	2,200	1,345.00	2,959,000	
旭ダイヤモンド工業	50,900	490.00	24,941,000	
D M G 森精機	122,700	1,301.00	159,632,700	貸付有価証券 12,900株
ソディック	42,200	841.00	35,490,200	貸付有価証券 1,400株
ディスコ	26,300	25,770.00	677,751,000	
日東工器	10,600	1,978.00	20,966,800	
日進工具	7,600	2,511.00	19,083,600	
パンチ工業	17,500	402.00	7,035,000	
富士ダイス	8,500	671.00	5,703,500	
豊和工業	10,700	825.00	8,827,500	貸付有価証券 500株
O K K	7,900	350.00	2,765,000	
東洋機械金属	13,900	412.00	5,726,800	
津田駒工業	3,700	775.00	2,867,500	
エンシュウ	4,600	902.00	4,149,200	
島精機製作所	30,500	1,445.00	44,072,500	
オプトラン	24,300	2,314.00	56,230,200	
N C ホールディングス	5,900	595.00	3,510,500	
イワキポンプ	12,300	987.00	12,140,100	
フリーー	19,000	939.00	17,841,000	
ヤマシンフィルタ	42,100	1,160.00	48,836,000	貸付有価証券 2,300株
日阪製作所	23,900	789.00	18,857,100	
やまびこ	37,600	1,049.00	39,442,400	
平田機工	9,200	6,140.00	56,488,000	貸付有価証券 300株
ペガサスミシン製造	19,700	276.00	5,437,200	貸付有価証券 200株
マルマエ	7,200	1,006.00	7,243,200	貸付有価証券 3,300株
タツモ	8,200	1,516.00	12,431,200	
ナブテスコ	114,300	3,295.00	376,618,500	貸付有価証券 2,500株

三井海洋開発	20,600	1,768.00	36,420,800	
レオン自動機	19,000	1,072.00	20,368,000	
S M C	61,500	59,520.00	3,660,480,000	貸付有価証券 200株
ホソカワミクロン	6,800	5,660.00	38,488,000	
ユニオンツール	7,200	2,848.00	20,505,600	
オイレス工業	25,100	1,423.00	35,717,300	
日精エー・エス・ビー機 械	5,600	3,735.00	20,916,000	貸付有価証券 200株(200株)
サトーホールディングス	27,600	2,107.00	58,153,200	
技研製作所	17,100	3,960.00	67,716,000	
日本エアテック	6,300	1,383.00	8,712,900	貸付有価証券 2,800株(2,100株)
カワタ	5,700	772.00	4,400,400	
日精樹脂工業	16,300	849.00	13,838,700	
オカダアイヨン	6,100	994.00	6,063,400	貸付有価証券 200株
ワイエイシイホールディ ングス	8,300	656.00	5,444,800	貸付有価証券 3,100株
小松製作所	888,300	2,237.50	1,987,571,250	貸付有価証券 300株
住友重機械工業	112,300	2,516.00	282,546,800	
日立建機	78,600	3,505.00	275,493,000	貸付有価証券 400株
日工	26,800	667.00	17,875,600	
巴工業	7,700	1,894.00	14,583,800	
井関農機	19,600	1,208.00	23,676,800	
T O W A	19,800	1,227.00	24,294,600	
丸山製作所	4,000	1,263.00	5,052,000	
北川鉄工所	8,800	1,441.00	12,680,800	
ローツェ	8,600	5,450.00	46,870,000	
タカキタ	6,800	629.00	4,277,200	
クボタ	1,040,500	1,719.00	1,788,619,500	貸付有価証券 162,900株(1,000株)
荏原実業	4,900	2,991.00	14,655,900	
三菱化工機	6,700	1,823.00	12,214,100	
月島機械	36,100	1,252.00	45,197,200	
帝国電機製作所	16,200	1,161.00	18,808,200	

東京機械製作所	8,000	283.00	2,264,000	
新東工業	46,500	735.00	34,177,500	
澁谷工業	17,100	2,868.00	49,042,800	
アイチ コーポレーション	33,900	820.00	27,798,000	
小森コーポレーション	49,700	758.00	37,672,600	
鶴見製作所	15,100	1,857.00	28,040,700	
住友精密工業	2,900	2,145.00	6,220,500	
日本ギア工業	7,800	280.00	2,184,000	
酒井重工業	3,700	2,371.00	8,772,700	
荏原製作所	81,300	2,819.00	229,184,700	貸付有価証券 300株
石井鐵工所	2,500	2,571.00	6,427,500	
西島製作所	19,800	865.00	17,127,000	
北越工業	20,200	1,101.00	22,240,200	
ダイキン工業	249,900	19,685.00	4,919,281,500	貸付有価証券 3,000株
オルガノ	7,100	5,710.00	40,541,000	
トーヨーカネツ	8,500	2,274.00	19,329,000	
栗田工業	106,100	3,220.00	341,642,000	貸付有価証券 100株
椿本チエイン	28,000	2,552.00	71,456,000	
大同工業	9,300	583.00	5,421,900	
木村化工機	16,300	422.00	6,878,600	
アネスト岩田	30,500	820.00	25,010,000	
ダイフク	100,200	9,720.00	973,944,000	貸付有価証券 500株
サムコ	4,900	2,798.00	13,710,200	貸付有価証券 1,000株（800株）
加藤製作所	10,700	1,128.00	12,069,600	
油研工業	3,300	1,473.00	4,860,900	
タダノ	94,600	892.00	84,383,200	貸付有価証券 17,300株（10,600株）
フジテック	71,300	1,893.00	134,970,900	
C K D	53,800	1,810.00	97,378,000	
キトー	14,800	1,195.00	17,686,000	
平和	54,700	1,799.00	98,405,300	貸付有価証券 400株

理想科学工業	17,300	1,280.00	22,144,000	
SANKYO	43,600	2,855.00	124,478,000	貸付有価証券 300株
日本金銭機械	21,700	568.00	12,325,600	
マースグループホールディングス	12,500	1,656.00	20,700,000	
フクシマガリレイ	12,100	3,485.00	42,168,500	
オーイズミ	8,200	359.00	2,943,800	
ダイコク電機	9,000	1,078.00	9,702,000	貸付有価証券 100株
竹内製作所	32,800	1,984.00	65,075,200	
アマノ	51,300	2,237.00	114,758,100	
JUKI	27,300	475.00	12,967,500	
蛇の目ミシン工業	17,800	609.00	10,840,200	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
マックス	29,900	1,609.00	48,109,100	
グローリー	50,400	2,341.00	117,986,400	
新晃工業	18,200	1,370.00	24,934,000	
大和冷機工業	31,500	899.00	28,318,500	
セガサミーホールディングス	194,500	1,267.00	246,431,500	貸付有価証券 500株
日本ピストンリング	7,100	1,092.00	7,753,200	
リケン	9,100	2,692.00	24,497,200	
TPR	26,400	1,368.00	36,115,200	
ツバキ・ナカシマ	37,500	800.00	30,000,000	貸付有価証券 1,100株
ホシザキ	61,700	7,950.00	490,515,000	貸付有価証券 3,700株
大豊工業	16,000	528.00	8,448,000	
日本精工	369,200	835.00	308,282,000	貸付有価証券 1,800株
NTN	453,900	207.00	93,957,300	貸付有価証券 5,500株
ジェイテクト	188,100	847.00	159,320,700	貸付有価証券 100株
不二越	18,200	3,300.00	60,060,000	
日本トムソン	58,200	340.00	19,788,000	
THK	122,300	2,505.00	306,361,500	貸付有価証券 32,500株

ユーシン精機	15,200	685.00	10,412,000	
前澤給装工業	7,100	2,088.00	14,824,800	
イーグル工業	24,200	745.00	18,029,000	
前澤工業	13,000	433.00	5,629,000	
日本ピラー工業	19,800	1,500.00	29,700,000	
キッツ	79,500	653.00	51,913,500	
マキタ	255,800	4,815.00	1,231,677,000	
日立造船	155,500	406.00	63,133,000	貸付有価証券 100株
三菱重工業	328,700	2,674.00	878,943,800	
I H I	141,300	1,554.00	219,580,200	
スター精密	30,200	1,333.00	40,256,600	
日清紡ホールディングス	119,900	729.00	87,407,100	貸付有価証券 100株
イビデン	120,100	3,645.00	437,764,500	貸付有価証券 700株
コニカミノルタ	428,500	342.00	146,547,000	貸付有価証券 200株
ブラザー工業	239,500	1,819.00	435,650,500	貸付有価証券 1,000株
ミネベアミツミ	364,100	1,888.00	687,420,800	貸付有価証券 200株
日立製作所	942,400	3,591.00	3,384,158,400	
三菱電機	1,961,200	1,447.50	2,838,837,000	貸付有価証券 300株
富士電機	118,200	3,175.00	375,285,000	
東洋電機製造	7,100	1,094.00	7,767,400	
安川電機	211,100	3,815.00	805,346,500	貸付有価証券 200株
シンフォニアテクノロジー	25,400	1,071.00	27,203,400	
明電舎	36,000	1,699.00	61,164,000	
オリジン	5,300	1,216.00	6,444,800	
山洋電気	9,500	5,150.00	48,925,000	
デンヨー	16,700	2,098.00	35,036,600	
東芝テック	24,600	4,430.00	108,978,000	
芝浦メカトロニクス	3,500	2,952.00	10,332,000	
マブチモーター	54,300	3,780.00	205,254,000	
日本電産	472,000	9,043.00	4,268,296,000	貸付有価証券

				19,500株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	11,700	401.00	4,691,700	貸付有価証券 3,800株(100株)
トレックス・セミコンダ クター	11,300	1,219.00	13,774,700	
東光高岳	10,900	990.00	10,791,000	
ダブル・スコープ	31,000	890.00	27,590,000	貸付有価証券 1,500株(100株)
ダイヘン	21,500	3,970.00	85,355,000	
ヤーマン	32,000	1,180.00	37,760,000	貸付有価証券 3,800株(300株)
JVCケンウッド	159,800	155.00	24,769,000	
ミマキエンジニアリング	17,600	398.00	7,004,800	
I - P E X	9,100	2,076.00	18,891,600	貸付有価証券 3,300株
日新電機	46,000	1,067.00	49,082,000	
大崎電気工業	39,000	530.00	20,670,000	
オムロン	175,800	7,830.00	1,376,514,000	貸付有価証券 600株
日東工業	28,800	1,900.00	54,720,000	貸付有価証券 200株
I D E C	28,300	1,742.00	49,298,600	
正興電機製作所	4,600	1,007.00	4,632,200	
不二電機工業	3,200	1,327.00	4,246,400	
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	65,500	1,773.00	116,131,500	貸付有価証券 1,500株
サクサホールディングス	4,600	1,428.00	6,568,800	
メルコホールディングス	6,800	2,668.00	18,142,400	
テクノメディカ	4,400	1,774.00	7,805,600	
ダイヤモンドエレクト リックホールディング	4,200	594.00	2,494,800	
日本電気	237,900	5,430.00	1,291,797,000	貸付有価証券 1,100株
富士通	189,100	14,030.00	2,653,073,000	
沖電気工業	79,700	1,017.00	81,054,900	貸付有価証券 1,300株
岩崎通信機	8,600	843.00	7,249,800	
電気興業	9,400	2,429.00	22,832,600	
サンケン電気	21,400	2,358.00	50,461,200	
ナカヨ	3,800	1,342.00	5,099,600	

アイホン	11,100	1,434.00	15,917,400	
ルネサスエレクトロニクス	837,600	684.00	572,918,400	貸付有価証券 2,100株
セイコーエプソン	243,300	1,243.00	302,421,900	貸付有価証券 600株
ワコム	131,800	675.00	88,965,000	貸付有価証券 100株
アルバック	36,100	3,775.00	136,277,500	貸付有価証券 7,800株
アクセル	8,200	906.00	7,429,200	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
E I Z O	15,200	3,940.00	59,888,000	
日本信号	49,900	1,054.00	52,594,600	
京三製作所	45,900	511.00	23,454,900	貸付有価証券 20,700株
能美防災	25,900	2,099.00	54,364,100	
ホーチキ	14,200	1,193.00	16,940,600	
星和電機	9,700	558.00	5,412,600	
エレコム	22,100	5,230.00	115,583,000	
パナソニック	2,240,700	932.00	2,088,332,400	貸付有価証券 300株
シャープ	226,900	1,257.00	285,213,300	貸付有価証券 76,400株
アンリツ	126,300	2,383.00	300,972,900	貸付有価証券 59,300株(500株)
富士通ゼネラル	53,200	2,721.00	144,757,200	
ソニー	1,228,600	8,826.00	10,843,623,600	貸付有価証券 10,400株
T D K	94,700	11,720.00	1,109,884,000	
帝国通信工業	8,600	1,181.00	10,156,600	
タムラ製作所	65,500	495.00	32,422,500	
アルプスアルパイン	173,600	1,575.00	273,420,000	貸付有価証券 700株
池上通信機	6,200	802.00	4,972,400	
日本電波工業	17,700	323.00	5,717,100	貸付有価証券 2,100株
鈴木	9,600	695.00	6,672,000	
日本トリム	2,600	3,715.00	9,659,000	
ローランド ディー . ジー .	11,600	1,203.00	13,954,800	貸付有価証券 500株

フォスター電機	20,600	1,110.00	22,866,000	
S M K	5,000	2,451.00	12,255,000	
ヨコオ	12,700	2,696.00	34,239,200	貸付有価証券 300株
ティアック	14,100	110.00	1,551,000	貸付有価証券 6,400株
ホシデン	53,600	927.00	49,687,200	貸付有価証券 2,900株
ヒロセ電機	30,200	12,630.00	381,426,000	
日本航空電子工業	45,000	1,363.00	61,335,000	
T O A	21,000	717.00	15,057,000	
マクセルホールディングス	42,200	1,008.00	42,537,600	
古野電気	25,200	972.00	24,494,400	
ユニデンホールディングス	5,400	1,612.00	8,704,800	
スミダコーポレーション	16,700	642.00	10,721,400	
アイコム	10,900	2,854.00	31,108,600	
リオン	8,200	2,230.00	18,286,000	
本多通信工業	16,700	415.00	6,930,500	
船井電機	19,800	524.00	10,375,200	貸付有価証券 5,000株
横河電機	179,900	1,706.00	306,909,400	貸付有価証券 800株
新電元工業	6,900	1,986.00	13,703,400	
アズビル	123,800	3,450.00	427,110,000	
東亜ディーケーケー	9,700	850.00	8,245,000	
日本光電工業	81,000	3,720.00	301,320,000	
チノー	6,800	1,379.00	9,377,200	
共和電業	20,500	414.00	8,487,000	
日本電子材料	7,700	1,690.00	13,013,000	
堀場製作所	38,800	6,220.00	241,336,000	
アドバンテスト	145,800	5,550.00	809,190,000	貸付有価証券 500株
小野測器	8,200	495.00	4,059,000	
エスペック	17,400	1,782.00	31,006,800	
キーエンス	177,700	45,730.00	8,126,221,000	
日置電機	9,400	3,410.00	32,054,000	
シスメックス	140,200	8,442.00	1,183,568,400	

日本マイクロニクス	34,100	1,195.00	40,749,500	貸付有価証券 2,800株
メガチップス	18,200	2,173.00	39,548,600	
O B A R A G R O U P	11,400	3,590.00	40,926,000	貸付有価証券 5,100株(4,300株)
澤藤電機	2,400	1,668.00	4,003,200	
原田工業	9,300	889.00	8,267,700	
コーセル	26,100	886.00	23,124,600	
イリソ電子工業	16,500	3,580.00	59,070,000	貸付有価証券 200株
オブテックスグループ	32,200	1,289.00	41,505,800	
千代田インテグレ	8,200	1,643.00	13,472,600	
アイ・オー・データ機器	6,300	1,086.00	6,841,800	
レーザーテック	86,100	8,690.00	748,209,000	貸付有価証券 1,600株
スタンレー電気	137,500	2,971.00	408,512,500	
岩崎電気	7,600	1,485.00	11,286,000	
ウシオ電機	108,300	1,346.00	145,771,800	
岡谷電機産業	15,400	300.00	4,620,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,100	297.00	5,375,700	貸付有価証券 200株
エノモト	5,900	1,007.00	5,941,300	
日本セラミック	19,900	2,294.00	45,650,600	
遠藤照明	9,900	642.00	6,355,800	
古河電池	14,000	1,158.00	16,212,000	貸付有価証券 6,500株(1,400株)
双信電機	9,500	395.00	3,752,500	
山一電機	14,200	1,367.00	19,411,400	
図研	12,800	2,806.00	35,916,800	貸付有価証券 100株
日本電子	38,700	3,325.00	128,677,500	貸付有価証券 100株
カシオ計算機	173,500	1,596.00	276,906,000	貸付有価証券 600株
ファナック	184,400	19,360.00	3,569,984,000	貸付有価証券 300株
日本シイエムケイ	46,100	431.00	19,869,100	貸付有価証券 100株
エンプラス	10,000	2,234.00	22,340,000	

大真空	7,200	1,830.00	13,176,000	貸付有価証券 900株
ローム	81,500	7,220.00	588,430,000	
浜松ホトニクス	140,700	4,870.00	685,209,000	貸付有価証券 1,800株
三井ハイテック	21,600	1,670.00	36,072,000	貸付有価証券 2,600株
新光電気工業	65,800	1,728.00	113,702,400	
京セラ	275,900	6,315.00	1,742,308,500	貸付有価証券 1,400株
太陽誘電	87,200	3,145.00	274,244,000	貸付有価証券 2,500株
村田製作所	576,100	6,739.00	3,882,337,900	貸付有価証券 200株
双葉電子工業	31,000	922.00	28,582,000	
北陸電気工業	7,900	878.00	6,936,200	
ニチコン	66,500	751.00	49,941,500	貸付有価証券 2,400株
日本ケミコン	14,900	1,748.00	26,045,200	
K O A	29,600	995.00	29,452,000	
市光工業	29,300	482.00	14,122,600	
小糸製作所	117,500	4,980.00	585,150,000	
ミツバ	36,100	392.00	14,151,200	
S C R E E Nホールディ ングス	34,000	5,580.00	189,720,000	
キャノン電子	18,000	1,499.00	26,982,000	
キャノン	974,600	1,884.00	1,836,146,400	貸付有価証券 86,200株(4,900株)
リコー	498,900	792.00	395,128,800	貸付有価証券 200株
象印マホービン	53,000	1,514.00	80,242,000	貸付有価証券 8,600株
M U T O Hホールディ ングス	2,500	1,499.00	3,747,500	
東京エレクトロン	124,400	28,650.00	3,564,060,000	貸付有価証券 100株
トヨタ紡織	57,100	1,375.00	78,512,500	
芦森工業	4,100	898.00	3,681,800	
ユニプレス	38,000	877.00	33,326,000	
豊田自動織機	158,700	6,130.00	972,831,000	貸付有価証券

				300株
モリタホールディングス	34,300	1,908.00	65,444,400	
三櫻工業	24,900	657.00	16,359,300	貸付有価証券 1,000株（700株）
デンソー	431,800	4,355.00	1,880,489,000	貸付有価証券 200株
東海理化電機製作所	51,600	1,435.00	74,046,000	貸付有価証券 2,000株
三井E & Sホールディングス	70,800	466.00	32,992,800	
川崎重工業	152,600	1,510.00	230,426,000	貸付有価証券 8,300株
名村造船所	63,100	155.00	9,780,500	貸付有価証券 5,900株
サノヤスホールディングス	23,900	157.00	3,752,300	貸付有価証券 700株
日本車輛製造	7,100	2,505.00	17,785,500	
三菱ロジスネクスト	26,000	999.00	25,974,000	
近畿車輛	2,900	1,244.00	3,607,600	
日産自動車	2,313,100	421.30	974,509,030	貸付有価証券 278,300株
いすゞ自動車	568,300	1,022.50	581,086,750	貸付有価証券 8,900株
トヨタ自動車	2,188,400	7,156.00	15,660,190,400	貸付有価証券 600株
日野自動車	244,900	712.00	174,368,800	貸付有価証券 300株
三菱自動車工業	726,000	248.00	180,048,000	貸付有価証券 122,600株
エフテック	13,700	490.00	6,713,000	貸付有価証券 2,600株
レシップホールディングス	7,700	562.00	4,327,400	
GMB	3,500	630.00	2,205,000	
ファルテック	3,400	615.00	2,091,000	
武蔵精密工業	43,700	891.00	38,936,700	
日産車体	38,300	840.00	32,172,000	
新明和工業	52,800	956.00	50,476,800	
極東開発工業	36,400	1,350.00	49,140,000	
日信工業	39,900	2,234.00	89,136,600	

トピー工業	16,100	1,151.00	18,531,100	
ティラド	7,100	1,321.00	9,379,100	
タチエス	32,200	885.00	28,497,000	貸付有価証券 14,300株
N O K	105,400	1,161.00	122,369,400	
フタバ産業	54,500	502.00	27,359,000	貸付有価証券 300株
K Y B	22,000	2,113.00	46,486,000	
大同メタル工業	37,600	522.00	19,627,200	
プレス工業	97,200	308.00	29,937,600	
ミクニ	24,900	263.00	6,548,700	
太平洋工業	41,100	882.00	36,250,200	
ケーヒン	45,100	2,581.00	116,403,100	貸付有価証券 1,100株
河西工業	26,500	412.00	10,918,000	
アイシン精機	161,500	3,640.00	587,860,000	
マツダ	577,100	658.00	379,731,800	貸付有価証券 1,900株
今仙電機製作所	18,200	689.00	12,539,800	
本田技研工業	1,544,200	2,741.00	4,232,652,200	貸付有価証券 3,600株
スズキ	388,700	4,277.00	1,662,469,900	貸付有価証券 37,800株
S U B A R U	608,900	2,236.00	1,361,500,400	貸付有価証券 200株
安永	9,500	1,001.00	9,509,500	
ヤマハ発動機	277,200	1,775.00	492,030,000	貸付有価証券 11,300株
ショーワ	46,300	2,282.00	105,656,600	
T B K	23,300	434.00	10,112,200	
エクセディ	26,600	1,399.00	37,213,400	貸付有価証券 400株
豊田合成	63,300	2,276.00	144,070,800	
愛三工業	30,700	522.00	16,025,400	
盟和産業	3,000	890.00	2,670,000	
日本プラスト	15,400	389.00	5,990,600	
ヨロズ	18,300	1,007.00	18,428,100	
エフ・シー・シー	32,100	1,825.00	58,582,500	
シマノ	73,400	22,790.00	1,672,786,000	

テイ・エス テック	45,500	3,190.00	145,145,000	
ジャムコ	9,800	712.00	6,977,600	貸付有価証券 300株
テルモ	555,000	4,291.00	2,381,505,000	貸付有価証券 4,900株
クリエートメディック	6,500	990.00	6,435,000	
日機装	63,300	1,050.00	66,465,000	貸付有価証券 9,700株
日本エム・ディ・エム	11,300	1,994.00	22,532,200	
島津製作所	234,400	3,185.00	746,564,000	貸付有価証券 11,000株
JMS	16,600	871.00	14,458,600	
クボテック	5,100	344.00	1,754,400	貸付有価証券 800株
長野計器	14,200	877.00	12,453,400	
ブイ・テクノロジー	9,200	3,870.00	35,604,000	貸付有価証券 1,300株
東京計器	12,500	924.00	11,550,000	
愛知時計電機	2,600	4,435.00	11,531,000	
インターアクション	10,500	1,800.00	18,900,000	貸付有価証券 2,700株（100株）
オーバル	17,500	218.00	3,815,000	
東京精密	35,600	3,470.00	123,532,000	
マニー	78,100	2,753.00	215,009,300	貸付有価証券 200株（100株）
ニコン	299,500	835.00	250,082,500	貸付有価証券 1,500株
トプコン	98,800	806.00	79,632,800	貸付有価証券 2,000株
オリンパス	1,085,200	2,126.00	2,307,135,200	貸付有価証券 1,700株
理研計器	17,300	2,493.00	43,128,900	
タムロン	15,800	1,760.00	27,808,000	
HOYA	389,100	10,530.00	4,097,223,000	
シード	8,300	713.00	5,917,900	
ノーリツ鋼機	13,200	1,472.00	19,430,400	
エー・アンド・デイ	17,900	659.00	11,796,100	
朝日インテック	222,100	3,005.00	667,410,500	貸付有価証券 3,100株
シチズン時計	229,700	319.00	73,274,300	貸付有価証券

				500株
リズム時計工業	6,100	615.00	3,751,500	
大研医器	13,600	548.00	7,452,800	貸付有価証券 2,200株(1,000株)
メニコン	27,800	5,940.00	165,132,000	貸付有価証券 100株
シンシア	2,100	395.00	829,500	
松風	8,800	1,409.00	12,399,200	
セイコーホールディングス	27,700	1,561.00	43,239,700	
ニプロ	135,700	1,207.00	163,789,900	貸付有価証券 100株
中本パックス	5,000	1,603.00	8,015,000	
スノーピーク	11,600	1,369.00	15,880,400	貸付有価証券 5,200株
パラマウントベッドホールディングス	20,700	4,290.00	88,803,000	
トランザクション	10,700	1,146.00	12,262,200	貸付有価証券 5,000株(300株)
粧美堂	5,700	355.00	2,023,500	貸付有価証券 200株
ニホンフラッシュ	18,300	1,540.00	28,182,000	
前田工織	21,600	2,505.00	54,108,000	貸付有価証券 700株
永大産業	25,600	299.00	7,654,400	
アートネイチャー	20,900	611.00	12,769,900	
バンダイナムコホールディングス	202,800	6,470.00	1,312,116,000	貸付有価証券 100株
アイフィスジャパン	5,000	718.00	3,590,000	
共立印刷	32,800	133.00	4,362,400	
S H O E I	17,200	3,015.00	51,858,000	
フランスベッドホールディングス	27,700	847.00	23,461,900	
パイロットコーポレーション	34,700	3,305.00	114,683,500	
萩原工業	10,900	1,454.00	15,848,600	
トッパン・フォームズ	42,000	1,005.00	42,210,000	
フジシールインターナショナル	44,000	1,874.00	82,456,000	
タカラトミー	87,900	890.00	78,231,000	貸付有価証券

				700株
廣済堂	13,700	748.00	10,247,600	
エステールホールディングス	5,200	645.00	3,354,000	
タカノ	7,700	639.00	4,920,300	
プロネクサス	16,800	1,110.00	18,648,000	
ホクシン	12,100	116.00	1,403,600	
ウッドワン	6,600	1,209.00	7,979,400	
大建工業	13,200	1,642.00	21,674,400	
凸版印刷	276,800	1,695.00	469,176,000	貸付有価証券 100株
大日本印刷	256,700	2,273.00	583,479,100	貸付有価証券 100株
共同印刷	6,000	2,687.00	16,122,000	
N I S S H A	40,300	1,200.00	48,360,000	貸付有価証券 2,400株(2,400株)
光村印刷	1,700	1,565.00	2,660,500	
TAKARA & COMPANY	9,500	2,251.00	21,384,500	
アシックス	173,400	1,412.00	244,840,800	貸付有価証券 62,600株
ツツミ	6,100	1,799.00	10,973,900	
小松ウオール工業	6,000	1,771.00	10,626,000	
ヤマハ	116,600	5,100.00	594,660,000	貸付有価証券 900株(700株)
河合楽器製作所	6,000	2,807.00	16,842,000	
クリナップ	18,200	519.00	9,445,800	
ビジョン	125,900	4,655.00	586,064,500	貸付有価証券 3,900株
オリバー	4,100	2,489.00	10,204,900	貸付有価証券 400株
兼松サステック	1,300	1,398.00	1,817,400	
キングジム	16,300	877.00	14,295,100	貸付有価証券 300株
リンテック	46,600	2,503.00	116,639,800	
イトーキ	38,900	353.00	13,731,700	
任天堂	120,300	51,550.00	6,201,465,000	
三菱鉛筆	32,300	1,279.00	41,311,700	
タカラスタンダード	40,500	1,400.00	56,700,000	

コクヨ	94,100	1,188.00	111,790,800	貸付有価証券 2,500株
ナカバヤシ	19,300	621.00	11,985,300	
グローブライド	8,800	2,423.00	21,322,400	
オカムラ	68,400	735.00	50,274,000	
美津濃	17,800	1,888.00	33,606,400	
東京電力ホールディングス	1,565,700	315.00	493,195,500	貸付有価証券 400株
中部電力	600,000	1,318.00	790,800,000	
関西電力	743,100	1,041.50	773,938,650	貸付有価証券 300株
中国電力	282,900	1,324.00	374,559,600	貸付有価証券 600株
北陸電力	179,300	724.00	129,813,200	
東北電力	489,900	1,074.00	526,152,600	
四国電力	176,600	777.00	137,218,200	貸付有価証券 200株
九州電力	404,200	952.00	384,798,400	
北海道電力	183,500	439.00	80,556,500	貸付有価証券 6,300株
沖縄電力	38,100	1,679.00	63,969,900	
電源開発	156,000	1,602.00	249,912,000	貸付有価証券 100株
エフオン	10,500	678.00	7,119,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
イーレックス	28,000	1,335.00	37,380,000	貸付有価証券 3,300株
レノバ	32,800	1,150.00	37,720,000	貸付有価証券 300株
東京瓦斯	377,200	2,370.00	893,964,000	
大阪瓦斯	380,600	2,092.00	796,215,200	
東邦瓦斯	96,500	4,790.00	462,235,000	貸付有価証券 12,800株
北海道瓦斯	10,500	1,595.00	16,747,500	貸付有価証券 100株
広島ガス	40,400	363.00	14,665,200	
西部瓦斯	22,100	2,508.00	55,426,800	
静岡ガス	55,700	884.00	49,238,800	
メタウォーター	9,500	4,465.00	42,417,500	
SBSホールディングス	14,500	2,130.00	30,885,000	

東武鉄道	204,400	3,305.00	675,542,000	貸付有価証券 1,200株
相鉄ホールディングス	62,800	2,836.00	178,100,800	
東急	494,600	1,356.00	670,677,600	貸付有価証券 100株
京浜急行電鉄	251,900	1,556.00	391,956,400	貸付有価証券 7,500株
小田急電鉄	291,700	2,517.00	734,208,900	貸付有価証券 10,400株
京王電鉄	101,800	6,090.00	619,962,000	貸付有価証券 6,300株
京成電鉄	136,500	2,997.00	409,090,500	
富士急行	26,700	3,050.00	81,435,000	貸付有価証券 600株
新京成電鉄	5,000	2,212.00	11,060,000	
東日本旅客鉄道	345,200	6,542.00	2,258,298,400	貸付有価証券 2,000株
西日本旅客鉄道	174,800	5,120.00	894,976,000	貸付有価証券 14,000株
東海旅客鉄道	163,100	14,745.00	2,404,909,500	貸付有価証券 16,000株
西武ホールディングス	256,100	1,108.00	283,758,800	
鴻池運輸	31,200	1,085.00	33,852,000	
西日本鉄道	54,400	2,847.00	154,876,800	貸付有価証券 500株
ハマキョウレックス	15,000	3,310.00	49,650,000	
サカイ引越センター	10,300	4,655.00	47,946,500	
近鉄グループホールディングス	185,800	4,525.00	840,745,000	貸付有価証券 1,500株
阪急阪神ホールディングス	247,700	3,370.00	834,749,000	貸付有価証券 800株
南海電気鉄道	88,000	2,303.00	202,664,000	貸付有価証券 1,200株
京阪ホールディングス	82,700	4,570.00	377,939,000	貸付有価証券 1,700株
神戸電鉄	4,400	3,670.00	16,148,000	貸付有価証券 2,100株
名古屋鉄道	152,700	2,914.00	444,967,800	貸付有価証券 25,200株
山陽電気鉄道	13,300	2,139.00	28,448,700	貸付有価証券 1,100株

日本通運	64,300	5,950.00	382,585,000	貸付有価証券 400株
ヤマトホールディングス	325,600	2,757.00	897,679,200	貸付有価証券 200株
山九	51,600	4,205.00	216,978,000	
丸運	10,600	218.00	2,310,800	
丸全昭和運輸	15,100	3,325.00	50,207,500	
センコーグループホールディングス	102,400	886.00	90,726,400	
トナミホールディングス	4,500	5,830.00	26,235,000	
ニッコンホールディングス	66,500	2,117.00	140,780,500	
日本石油輸送	2,000	2,834.00	5,668,000	
福山通運	23,800	4,705.00	111,979,000	貸付有価証券 300株
セイノーホールディングス	139,100	1,550.00	215,605,000	
エスライン	5,600	924.00	5,174,400	
神奈川中央交通	4,600	3,940.00	18,124,000	
日立物流	34,000	3,445.00	117,130,000	
丸和運輸機関	19,600	4,215.00	82,614,000	
C & F ロジホールディングス	18,800	1,871.00	35,174,800	
九州旅客鉄道	162,800	2,303.00	374,928,400	
S Gホールディングス	195,000	4,760.00	928,200,000	貸付有価証券 3,500株
日本郵船	155,300	1,632.00	253,449,600	
商船三井	117,500	1,882.00	221,135,000	貸付有価証券 100株
川崎汽船	57,200	1,101.00	62,977,200	貸付有価証券 21,100株（5,100株）
N S ユナイテッド海運	10,200	1,438.00	14,667,600	貸付有価証券 100株
明治海運	19,700	321.00	6,323,700	
飯野海運	87,900	353.00	31,028,700	
共栄タンカー	3,300	771.00	2,544,300	
乾汽船	10,700	809.00	8,656,300	
日本航空	328,500	1,979.00	650,101,500	貸付有価証券 500株
A N A ホールディングス	339,500	2,415.00	819,892,500	貸付有価証券

				161,100株(60,000株)
パスコ	3,600	1,351.00	4,863,600	
トランコム	5,200	7,430.00	38,636,000	
日新	16,000	1,613.00	25,808,000	
三菱倉庫	58,900	3,040.00	179,056,000	貸付有価証券 6,900株(5,400株)
三井倉庫ホールディングス	21,200	1,669.00	35,382,800	
住友倉庫	66,800	1,321.00	88,242,800	
澁澤倉庫	10,200	2,003.00	20,430,600	
東陽倉庫	33,500	324.00	10,854,000	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	40,900	515.00	21,063,500	貸付有価証券 100株
ケイヒン	3,600	1,275.00	4,590,000	
中央倉庫	11,300	1,010.00	11,413,000	
川西倉庫	3,400	1,042.00	3,542,800	
安田倉庫	15,300	912.00	13,953,600	
ファイズホールディングス	4,000	1,069.00	4,276,000	
東洋埠頭	5,700	1,430.00	8,151,000	
宇徳	15,900	476.00	7,568,400	
上組	103,600	2,132.00	220,875,200	貸付有価証券 800株
サンリツ	4,400	598.00	2,631,200	
キムラユニティー	5,000	1,047.00	5,235,000	貸付有価証券 2,300株
キューソー流通システム	4,600	1,463.00	6,729,800	
近鉄エクスプレス	39,500	2,081.00	82,199,500	
東海運	10,600	277.00	2,936,200	
エーアイテイー	13,100	989.00	12,955,900	
内外トランスライン	6,500	1,100.00	7,150,000	
日本コンセプト	5,900	1,239.00	7,310,100	
NEC ネットエスアイ	54,600	2,103.00	114,823,800	貸付有価証券 600株
クロスキャット	5,000	1,120.00	5,600,000	
システナ	68,600	1,765.00	121,079,000	貸付有価証券 2,800株

デジタルアーツ	9,500	8,480.00	80,560,000	貸付有価証券 600株（600株）
日鉄ソリューションズ	28,800	3,055.00	87,984,000	
キューブシステム	10,200	1,074.00	10,954,800	貸付有価証券 400株
エイジア	3,500	1,815.00	6,352,500	
コア	8,100	1,345.00	10,894,500	
ラクーンホールディングス	8,900	1,046.00	9,309,400	
ソリトンシステムズ	9,600	1,701.00	16,329,600	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
ソフトクリエイティブホールディングス	8,400	2,600.00	21,840,000	
T I S	192,400	2,207.00	424,626,800	貸付有価証券 600株
ネオス	7,700	600.00	4,620,000	貸付有価証券 2,900株
電算システム	6,700	3,790.00	25,393,000	貸付有価証券 400株
グリー	118,000	478.00	56,404,000	貸付有価証券 3,100株
コーエーテクモホールディングス	39,400	4,320.00	170,208,000	
三菱総合研究所	8,300	4,025.00	33,407,500	
ボルテージ	4,500	586.00	2,637,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
電算	2,100	2,163.00	4,542,300	
A G S	10,900	828.00	9,025,200	
ファインデックス	16,200	1,036.00	16,783,200	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
ブレインパッド	4,900	3,900.00	19,110,000	
K L a b	35,000	900.00	31,500,000	貸付有価証券 13,900株（13,900株）
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	23,200	929.00	21,552,800	貸付有価証券 1,600株
イーブックイニシアティブジャパン	2,800	3,685.00	10,318,000	
ネクソン	484,700	2,589.00	1,254,888,300	貸付有価証券 11,800株
アイスタイル	53,900	315.00	16,978,500	貸付有価証券 11,100株（100株）

エムアップホールディングス	5,600	2,920.00	16,352,000	貸付有価証券 2,500株(1,600株)
エイチーム	13,200	886.00	11,695,200	
エニグモ	18,200	1,461.00	26,590,200	貸付有価証券 6,800株(5,800株)
テクノスジャパン	14,900	815.00	12,143,500	
e n i s h	9,800	899.00	8,810,200	貸付有価証券 4,100株(1,500株)
コロブラ	63,100	991.00	62,532,100	貸付有価証券 27,000株(7,800株)
オルトプラス	11,700	487.00	5,697,900	貸付有価証券 4,900株(100株)
ブロードリーフ	95,400	526.00	50,180,400	貸付有価証券 45,600株
クロス・マーケティンググループ	8,500	318.00	2,703,000	貸付有価証券 3,100株(3,100株)
デジタルハーツホールディングス	10,200	932.00	9,506,400	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
システム情報	14,400	1,269.00	18,273,600	貸付有価証券 6,700株
メディアドゥ	6,100	6,340.00	38,674,000	
じげん	47,600	352.00	16,755,200	貸付有価証券 3,200株
ブイキューブ	10,400	1,344.00	13,977,600	貸付有価証券 5,500株(1,700株)
エンカレッジ・テクノロジー	4,200	743.00	3,120,600	
サイバーリンクス	3,100	1,944.00	6,026,400	
ディー・エル・イー	15,500	549.00	8,509,500	貸付有価証券 7,200株(4,900株)
フィックスターズ	20,500	1,079.00	22,119,500	
CARTA HOLDINGS	7,800	1,258.00	9,812,400	貸付有価証券 3,900株(3,700株)
オブティム	10,100	3,385.00	34,188,500	
セレス	6,300	1,253.00	7,893,900	貸付有価証券 700株(700株)
S H I F T	7,800	11,670.00	91,026,000	貸付有価証券 800株
ティーガイア	17,100	2,130.00	36,423,000	
セック	2,800	2,987.00	8,363,600	
日本アジアグループ	20,300	298.00	6,049,400	

テクマトリックス	27,100	2,112.00	57,235,200	貸付有価証券 3,200株(3,200株)
プロシップ	5,600	1,420.00	7,952,000	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	46,400	2,116.00	98,182,400	貸付有価証券 7,900株
GMOペイメントゲート ウェイ	40,700	11,430.00	465,201,000	
ザッパラス	8,300	400.00	3,320,000	
システムリサーチ	5,100	1,820.00	9,282,000	
インターネットイニシア ティブ	28,500	4,245.00	120,982,500	
さくらインターネット	20,600	566.00	11,659,600	貸付有価証券 300株
ヴィンクス	5,400	1,168.00	6,307,200	貸付有価証券 200株
GMOクラウド	4,300	7,910.00	34,013,000	貸付有価証券 2,000株(1,200株)
SRAホールディングス	10,200	2,450.00	24,990,000	
システムインテグレータ	6,100	808.00	4,928,800	貸付有価証券 2,600株
朝日ネット	13,600	975.00	13,260,000	貸付有価証券 1,000株
eBASE	23,000	1,295.00	29,785,000	
アバント	18,300	1,094.00	20,020,200	
アドソル日進	6,800	2,683.00	18,244,400	
フリービット	10,000	759.00	7,590,000	
コムチュア	21,600	2,372.00	51,235,200	貸付有価証券 600株
サイバーコム	3,400	1,822.00	6,194,800	
アステリア	11,700	614.00	7,183,800	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
アイル	10,700	1,562.00	16,713,400	貸付有価証券 4,800株(2,300株)
マークラインズ	8,000	2,004.00	16,032,000	
メディカル・データ・ピ ジョン	21,900	1,556.00	34,076,400	貸付有価証券 5,200株(4,800株)
gumi	24,700	982.00	24,255,400	
ショーケース	4,100	620.00	2,542,000	
モバイルファクトリー	4,300	1,156.00	4,970,800	貸付有価証券 1,400株

テラスカイ	6,900	4,200.00	28,980,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,600	1,280.00	9,728,000	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
P C Iホールディングス	7,300	1,052.00	7,679,600	
パイブドHD	2,500	1,447.00	3,617,500	貸付有価証券 1,100株（700株）
アイピーシー	3,100	991.00	3,072,100	
ネオジャパン	3,600	2,504.00	9,014,400	貸付有価証券 1,600株
P R T I M E S	3,200	2,120.00	6,784,000	貸付有価証券 1,500株（1,400株）
ランドコンピュータ	2,900	1,035.00	3,001,500	
ダブルスタンダード	2,500	4,870.00	12,175,000	
オープンドア	9,500	1,154.00	10,963,000	貸付有価証券 4,400株（1,100株）
マイネット	6,300	1,690.00	10,647,000	
アカツキ	6,800	4,085.00	27,778,000	貸付有価証券 1,800株（200株）
ベネフィットジャパン	1,400	1,934.00	2,707,600	
U b i c o mホールディングス	4,300	1,978.00	8,505,400	
L I N E	58,800	5,390.00	316,932,000	貸付有価証券 200株
カナミックネットワーク	17,600	780.00	13,728,000	
ノムラシステムコーポレーション	8,400	430.00	3,612,000	貸付有価証券 500株
チェンジ	6,700	11,630.00	77,921,000	貸付有価証券 1,000株（400株）
シンクロ・フード	8,200	322.00	2,640,400	貸付有価証券 700株
オークネット	10,200	1,127.00	11,495,400	
セグエグループ	4,900	890.00	4,361,000	貸付有価証券 200株
エイトレッド	3,200	2,005.00	6,416,000	貸付有価証券 100株（100株）
A O I T Y O H o l d i n g s	19,400	401.00	7,779,400	貸付有価証券 6,700株（6,700株）
マクロミル	39,300	787.00	30,929,100	
ビーグリー	3,700	1,825.00	6,752,500	貸付有価証券 800株
オロ	6,100	3,110.00	18,971,000	貸付有価証券

				2,600株(2,100株)
ユーザーローカル	1,900	3,710.00	7,049,000	
テモナ	4,100	995.00	4,079,500	
ニーズウェル	3,600	726.00	2,613,600	
サインポスト	4,000	1,361.00	5,444,000	貸付有価証券 400株(400株)
ソルクシーズ	7,300	770.00	5,621,000	貸付有価証券 300株
フェイス	6,700	926.00	6,204,200	
プロトコーポレーション	17,200	1,218.00	20,949,600	
ハイマックス	2,300	2,016.00	4,636,800	貸付有価証券 100株
野村総合研究所	272,800	2,841.00	775,024,800	貸付有価証券 1,400株
サイバネットシステム	13,700	788.00	10,795,600	貸付有価証券 500株
C Eホールディングス	10,100	500.00	5,050,000	貸付有価証券 4,700株
日本システム技術	3,100	1,508.00	4,674,800	
インテージホールディングス	24,000	917.00	22,008,000	
東邦システムサイエンス	5,100	974.00	4,967,400	
ソースネクスト	91,300	266.00	24,285,800	貸付有価証券 42,900株(17,000株)
インフォコム	21,000	3,385.00	71,085,000	
HEROZ	2,700	3,670.00	9,909,000	貸付有価証券 1,200株(1,100株)
ラクスル	15,500	3,145.00	48,747,500	貸付有価証券 6,000株(2,800株)
F I G	20,800	236.00	4,908,800	
システムサポート	4,300	1,840.00	7,912,000	
イーソル	10,500	1,078.00	11,319,000	貸付有価証券 3,400株
アルテリア・ネットワークス	21,300	1,862.00	39,660,600	
東海ソフト	1,300	1,236.00	1,606,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,300	1,099.00	3,626,700	
東名	1,000	1,386.00	1,386,000	
ヴィッツ	700	2,530.00	1,771,000	

トピラスシステムズ	1,900	1,913.00	3,634,700	貸付有価証券 200株
Link-U	1,200	2,481.00	2,977,200	
フォーカスシステムズ	11,900	791.00	9,412,900	
クレスコ	11,700	1,296.00	15,163,200	
フジ・メディア・ホールディングス	185,400	1,047.00	194,113,800	
オービック	66,700	18,420.00	1,228,614,000	
ジャストシステム	31,300	7,610.00	238,193,000	
TDCソフト	16,800	972.00	16,329,600	
Zホールディングス	2,642,900	654.00	1,728,456,600	貸付有価証券 100株
トレンドマイクロ	102,700	6,450.00	662,415,000	貸付有価証券 3,700株(100株)
IDホールディングス	7,300	1,436.00	10,482,800	
日本オラクル	39,000	12,350.00	481,650,000	
アルファシステムズ	6,000	3,690.00	22,140,000	
フューチャー	23,200	1,776.00	41,203,200	貸付有価証券 6,400株
CAC Holdings	12,500	1,311.00	16,387,500	貸付有価証券 4,800株
SBテクノロジー	6,900	3,270.00	22,563,000	
トーセ	5,200	925.00	4,810,000	
オービックビジネスコンサルティング	19,700	6,550.00	129,035,000	貸付有価証券 8,400株
伊藤忠テクノソリューションズ	87,700	4,005.00	351,238,500	貸付有価証券 100株
アイティフォー	23,300	806.00	18,779,800	
東計電算	2,800	4,240.00	11,872,000	
エクスネット	3,000	966.00	2,898,000	
大塚商会	104,100	5,410.00	563,181,000	
サイボウズ	22,500	3,000.00	67,500,000	
ソフトブレーン	15,100	484.00	7,308,400	貸付有価証券 100株
電通国際情報サービス	11,900	5,710.00	67,949,000	
ACCESS	18,000	799.00	14,382,000	
デジタルガレージ	34,600	3,515.00	121,619,000	貸付有価証券 9,300株
EMシステムズ	27,200	860.00	23,392,000	

ウェザーニューズ	6,500	4,025.00	26,162,500	
C I J	13,100	833.00	10,912,300	
ビジネスエンジニアリング	2,200	2,893.00	6,364,600	貸付有価証券 1,000株
日本エンタープライズ	19,600	300.00	5,880,000	貸付有価証券 100株
WOWOW	9,200	2,596.00	23,883,200	貸付有価証券 2,400株(300株)
スカラ	12,800	744.00	9,523,200	
インテリジェント ウェイブ	11,200	811.00	9,083,200	
I M A G I C A G R O U P	16,300	379.00	6,177,700	
ネットワンシステムズ	73,300	4,260.00	312,258,000	貸付有価証券 200株
システムソフト	41,400	94.00	3,891,600	貸付有価証券 200株
アルゴグラフィックス	16,300	3,400.00	55,420,000	
マーベラス	29,400	785.00	23,079,000	
エイベックス	33,000	903.00	29,799,000	
日本ユニシス	60,100	3,085.00	185,408,500	
兼松エレクトロニクス	10,500	4,115.00	43,207,500	
都築電気	6,100	1,608.00	9,808,800	貸付有価証券 2,300株
東京放送ホールディングス	117,000	1,753.00	205,101,000	
日本テレビホールディングス	160,600	1,247.00	200,268,200	
朝日放送グループホールディングス	19,100	736.00	14,057,600	貸付有価証券 100株
テレビ朝日ホールディングス	52,900	1,638.00	86,650,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	126,600	395.00	50,007,000	貸付有価証券 200株
テレビ東京ホールディングス	15,800	2,309.00	36,482,200	貸付有価証券 100株
日本BS放送	6,500	1,122.00	7,293,000	貸付有価証券 3,000株
ビジョン	23,900	736.00	17,590,400	貸付有価証券 4,700株(3,500株)
スマートバリュー	5,000	945.00	4,725,000	貸付有価証券

				100株(100株)
USEN - NEXT HOLDINGS	7,300	1,244.00	9,081,200	貸付有価証券 2,200株(1,100株)
ワイヤレスゲート	7,800	746.00	5,818,800	貸付有価証券 4,200株
コネクシオ	10,900	1,278.00	13,930,200	
日本通信	150,000	201.00	30,150,000	貸付有価証券 62,700株(62,100株)
ク Robbins	3,500	786.00	2,751,000	
日本電信電話	2,572,600	2,609.50	6,713,199,700	貸付有価証券 100株
KDDI	1,403,100	3,346.00	4,694,772,600	貸付有価証券 900株
ソフトバンク	1,749,000	1,486.50	2,599,888,500	貸付有価証券 41,600株
光通信	19,800	24,600.00	487,080,000	貸付有価証券 1,700株
NTTドコモ	1,376,200	3,101.00	4,267,596,200	
エムティーアイ	18,600	713.00	13,261,800	
GMOインターネット	69,000	3,000.00	207,000,000	
ファイバーゲート	6,200	2,035.00	12,617,000	貸付有価証券 1,500株(1,100株)
アйдママーケティング コミュニケーション	5,800	430.00	2,494,000	
KADOKAWA	51,800	2,595.00	134,421,000	貸付有価証券 7,900株
学研ホールディングス	25,800	1,507.00	38,880,600	
ゼンリン	38,400	1,156.00	44,390,400	貸付有価証券 2,500株
昭文社ホールディングス	8,900	457.00	4,067,300	貸付有価証券 200株
インプレスホールディングス	15,900	155.00	2,464,500	
アイネット	9,900	1,486.00	14,711,400	
松竹	12,700	13,810.00	175,387,000	貸付有価証券 5,900株(400株)
東宝	113,600	3,655.00	415,208,000	貸付有価証券 100株
東映	7,200	15,740.00	113,328,000	貸付有価証券 2,300株
エヌ・ティ・ティ・デー	512,400	1,253.00	642,037,200	貸付有価証券

タ				400株
ピー・シー・エー	3,300	5,010.00	16,533,000	貸付有価証券 500株
ビジネスブレイン太田昭 和	6,600	1,303.00	8,599,800	
D T S	43,000	2,167.00	93,181,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	82,100	6,750.00	554,175,000	貸付有価証券 2,700株
シーイーシー	20,600	1,647.00	33,928,200	
カブコン	90,700	5,050.00	458,035,000	貸付有価証券 300株
アイ・エス・ピー	4,100	2,707.00	11,098,700	
ジャステック	12,200	1,280.00	15,616,000	
S C S K	44,400	5,780.00	256,632,000	貸付有価証券 100株
日本システムウエア	6,400	1,948.00	12,467,200	
アイネス	18,900	1,442.00	27,253,800	
T K C	16,300	6,080.00	99,104,000	
富士ソフト	20,500	5,080.00	104,140,000	貸付有価証券 4,600株(4,600株)
N S D	61,900	1,970.00	121,943,000	
コナミホールディングス	69,900	3,935.00	275,056,500	貸付有価証券 1,500株
福井コンピュータホール ディングス	7,600	2,724.00	20,702,400	
J B C C ホールディング ス	13,000	1,620.00	21,060,000	
ミロク情報サービス	17,000	2,166.00	36,822,000	貸付有価証券 400株
ソフトバンクグループ	1,527,000	6,237.00	9,523,899,000	貸付有価証券 2,600株
ハウスイ	1,500	879.00	1,318,500	
高千穂交易	7,400	919.00	6,800,600	
カワニシホールディング ス	2,300	1,360.00	3,128,000	
伊藤忠食品	4,800	5,220.00	25,056,000	
エレマテック	18,000	901.00	16,218,000	
J A L U X	5,400	1,633.00	8,818,200	貸付有価証券 2,500株
あらた	15,400	4,980.00	76,692,000	

トーメンデバイス	2,900	3,760.00	10,904,000	貸付有価証券 1,300株
東京エレクトロン デバイス	7,000	3,195.00	22,365,000	
フィールズ	14,800	341.00	5,046,800	
双日	1,066,900	237.00	252,855,300	貸付有価証券 4,700株
アルフレッサ ホールディングス	214,700	2,124.00	456,022,800	
横浜冷凍	50,500	886.00	44,743,000	
神栄	2,700	487.00	1,314,900	
ラサ商事	10,200	934.00	9,526,800	
アルコニックス	20,500	1,405.00	28,802,500	
神戸物産	66,600	6,630.00	441,558,000	貸付有価証券 30,800株
ハイパー	2,900	504.00	1,461,600	
あい ホールディングス	27,600	1,496.00	41,289,600	
ディービーエックス	6,900	904.00	6,237,600	貸付有価証券 2,100株
ダイワボウホールディングス	16,400	6,400.00	104,960,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	46,100	1,694.00	78,093,400	貸付有価証券 20,600株
ラクト・ジャパン	8,400	3,315.00	27,846,000	貸付有価証券 100株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	36,300	1,054.00	38,260,200	
八洲電機	14,900	942.00	14,035,800	貸付有価証券 7,000株
メディアスホールディングス	10,900	816.00	8,894,400	
レスターホールディングス	20,100	1,929.00	38,772,900	
ジューテックホールディングス	4,400	983.00	4,325,200	
大光	8,200	677.00	5,551,400	
OCHIホールディングス	5,600	1,521.00	8,517,600	
TOKAIホールディングス	102,100	1,001.00	102,202,100	
黒谷	5,200	541.00	2,813,200	貸付有価証券

				2,400株
Cominix	3,300	698.00	2,303,400	
三洋貿易	19,400	977.00	18,953,800	
ビューティガレージ	3,100	1,981.00	6,141,100	
ウイン・パートナーズ	13,900	943.00	13,107,700	貸付有価証券 6,200株
ミタチ産業	5,800	533.00	3,091,400	
シップヘルスケアホールディングス	31,000	4,670.00	144,770,000	貸付有価証券 3,000株
明治電機工業	6,100	1,404.00	8,564,400	
デリカフーズホールディングス	6,800	629.00	4,277,200	貸付有価証券 3,200株
スターティアホールディングス	4,400	570.00	2,508,000	貸付有価証券 100株
コマダホールディングス	42,100	1,748.00	73,590,800	貸付有価証券 19,700株
ピーバンドットコム	1,900	929.00	1,765,100	
アセンテック	4,100	2,014.00	8,257,400	
富士興産	5,900	506.00	2,985,400	
協栄産業	2,100	1,353.00	2,841,300	
小野建	17,300	1,130.00	19,549,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
南陽	4,200	1,528.00	6,417,600	
佐鳥電機	13,100	845.00	11,069,500	
エコトレーディング	4,400	535.00	2,354,000	
伯東	11,800	1,072.00	12,649,600	
コンドーテック	14,900	1,174.00	17,492,600	
中山福	11,100	468.00	5,194,800	
ナガイレーベン	25,600	2,722.00	69,683,200	
三菱食品	21,200	2,687.00	56,964,400	
松田産業	14,100	1,586.00	22,362,600	
第一興商	28,800	3,200.00	92,160,000	
メディカルホールディングス	208,500	2,032.00	423,672,000	貸付有価証券 1,100株
S P K	8,300	1,425.00	11,827,500	
萩原電気ホールディングス	7,100	1,910.00	13,561,000	
アズワン	12,600	12,520.00	157,752,000	
スズデン	6,700	1,148.00	7,691,600	

尾家産業	5,600	1,530.00	8,568,000	
シモジマ	11,800	1,245.00	14,691,000	
ドウシヤ	18,200	1,901.00	34,598,200	
小津産業	4,200	1,763.00	7,404,600	
高速	11,500	1,374.00	15,801,000	貸付有価証券 1,500株
たけびし	6,800	1,466.00	9,968,800	
リックス	4,300	1,414.00	6,080,200	
丸文	17,100	487.00	8,327,700	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
ハピネット	16,100	1,271.00	20,463,100	
橋本総業ホールディングス	3,900	2,076.00	8,096,400	
日本ライフライン	57,200	1,422.00	81,338,400	
タカショー	12,500	525.00	6,562,500	
マルカ	6,200	1,987.00	12,319,400	
I D O M	52,100	512.00	26,675,200	
進和	11,400	2,051.00	23,381,400	貸付有価証券 5,300株
エスケイジャパン	4,100	294.00	1,205,400	
ダイトロン	8,200	1,474.00	12,086,800	貸付有価証券 100株
シークス	24,600	882.00	21,697,200	貸付有価証券 300株
田中商事	5,900	705.00	4,159,500	
オーハシテクニカ	9,900	1,499.00	14,840,100	
白銅	6,900	1,249.00	8,618,100	
ダイコー通産	1,200	1,229.00	1,474,800	
伊藤忠商事	1,351,100	2,570.00	3,472,327,000	貸付有価証券 300株
丸紅	2,010,700	578.70	1,163,592,090	貸付有価証券 900株
高島	3,100	1,810.00	5,611,000	
長瀬産業	108,600	1,320.00	143,352,000	
蝶理	12,300	1,593.00	19,593,900	
豊田通商	215,600	3,055.00	658,658,000	貸付有価証券 200株
三共生興	29,200	424.00	12,380,800	
兼松	72,000	1,290.00	92,880,000	

ツカモトコーポレーショ ン	3,500	1,170.00	4,095,000	
三井物産	1,672,500	1,772.50	2,964,506,250	貸付有価証券 300株
日本紙パルプ商事	11,000	3,850.00	42,350,000	
カメイ	25,200	1,013.00	25,527,600	
東都水産	2,500	3,035.00	7,587,500	貸付有価証券 1,100株
OUGホールディングス	3,000	2,720.00	8,160,000	貸付有価証券 1,400株
スターゼン	7,100	4,000.00	28,400,000	
山善	75,400	991.00	74,721,400	
椿本興業	3,600	3,140.00	11,304,000	
住友商事	1,218,800	1,258.50	1,533,859,800	貸付有価証券 300株
内田洋行	7,600	6,240.00	47,424,000	貸付有価証券 400株
三菱商事	1,266,600	2,311.50	2,927,745,900	貸付有価証券 300株
第一実業	9,500	3,630.00	34,485,000	
キャノンマーケティング ジャパン	47,900	2,042.00	97,811,800	貸付有価証券 1,100株
西華産業	10,900	1,283.00	13,984,700	
佐藤商事	15,900	890.00	14,151,000	
菱洋エレクトロ	19,600	3,000.00	58,800,000	
東京産業	17,500	516.00	9,030,000	
ユアサ商事	18,300	3,000.00	54,900,000	
神鋼商事	4,900	1,815.00	8,893,500	
トルク	11,500	299.00	3,438,500	
阪和興業	36,100	2,065.00	74,546,500	貸付有価証券 1,700株
正栄食品工業	12,500	3,880.00	48,500,000	
カナデン	15,700	1,367.00	21,461,900	
菱電商事	13,900	1,441.00	20,029,900	
フルサト工業	10,600	1,329.00	14,087,400	
岩谷産業	42,900	3,765.00	161,518,500	貸付有価証券 13,700株(5,500株)
ナイス	8,200	1,167.00	9,569,400	
昭光通商	6,200	578.00	3,583,600	

ニチモウ	3,000	1,901.00	5,703,000	
極東貿易	5,500	1,320.00	7,260,000	
イワキ	25,400	481.00	12,217,400	貸付有価証券 200株
三愛石油	47,600	920.00	43,792,000	
稲畑産業	42,500	1,282.00	54,485,000	貸付有価証券 100株
G S Iクレオス	4,700	1,744.00	8,196,800	
明和産業	17,800	458.00	8,152,400	貸付有価証券 8,300株(5,900株)
クワザワ	6,900	535.00	3,691,500	
ヤマエ久野	14,100	1,236.00	17,427,600	
ワキタ	41,200	932.00	38,398,400	
東邦ホールディングス	62,000	1,982.00	122,884,000	
サンゲツ	52,100	1,569.00	81,744,900	
ミツウロコグループホールディングス	28,500	1,143.00	32,575,500	
シナネンホールディングス	7,900	2,931.00	23,154,900	
伊藤忠エネクス	42,700	947.00	40,436,900	
サンリオ	54,200	1,736.00	94,091,200	貸付有価証券 16,200株(5,600株)
サンワテクノス	13,700	827.00	11,329,900	
リョーサン	21,300	2,035.00	43,345,500	
新光商事	30,300	821.00	24,876,300	
トーヨー	8,700	1,868.00	16,251,600	
三信電気	10,300	1,814.00	18,684,200	
東陽テクニカ	20,600	973.00	20,043,800	
モスフードサービス	25,300	2,828.00	71,548,400	貸付有価証券 2,200株
加賀電子	19,200	2,188.00	42,009,600	
ソーダニッカ	19,900	526.00	10,467,400	
立花エレテック	14,300	1,686.00	24,109,800	
フォーバル	8,400	1,102.00	9,256,800	
P A L T A C	31,000	5,900.00	182,900,000	
三谷産業	25,400	335.00	8,509,000	
太平洋興発	7,600	627.00	4,765,200	
西本Wismettac	4,400	1,977.00	8,698,800	貸付有価証券

ホールディングス				100株
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,700	1,529.00	2,599,300	
コア商事ホールディングス	1,800	2,007.00	3,612,600	
国際紙パルプ商事	45,700	278.00	12,704,600	
ヤマタネ	9,700	1,275.00	12,367,500	
丸紅建材リース	1,900	1,699.00	3,228,100	
日鉄物産	13,800	3,205.00	44,229,000	
泉州電業	5,400	3,065.00	16,551,000	
トラスコ中山	44,200	2,588.00	114,389,600	
オートバックスセブン	71,700	1,395.00	100,021,500	
モリト	14,100	592.00	8,347,200	
加藤産業	27,900	3,710.00	103,509,000	
北恵	4,900	988.00	4,841,200	
イノテック	10,000	1,051.00	10,510,000	
イエローハット	36,500	1,624.00	59,276,000	
J Kホールディングス	17,400	768.00	13,363,200	貸付有価証券 7,900株
日伝	17,500	2,145.00	37,537,500	
北沢産業	14,500	258.00	3,741,000	
杉本商事	10,400	1,927.00	20,040,800	
因幡電機産業	55,000	2,611.00	143,605,000	
東テク	6,400	2,335.00	14,944,000	
ミスミグループ本社	242,100	2,741.00	663,596,100	
アルテック	14,100	237.00	3,341,700	
タキヒヨー	5,800	1,832.00	10,625,600	貸付有価証券 2,700株
蔵王産業	3,700	1,404.00	5,194,800	
スズケン	81,800	3,930.00	321,474,000	貸付有価証券 1,000株
ジェコス	13,300	911.00	12,116,300	
グローセル	19,300	409.00	7,893,700	
ローソン	48,900	5,350.00	261,615,000	貸付有価証券 1,600株
サンエー	16,100	4,150.00	66,815,000	
カワチ薬品	15,000	3,080.00	46,200,000	
エービーシー・マート	30,200	5,620.00	169,724,000	

ハードオフコーポレーション	7,600	670.00	5,092,000	
アスクル	20,200	3,145.00	63,529,000	
ゲオホールディングス	34,800	1,571.00	54,670,800	
アダストリア	26,700	1,627.00	43,440,900	貸付有価証券 8,900株
ジーフット	11,700	521.00	6,095,700	貸付有価証券 5,300株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,800	433.00	1,212,400	
くら寿司	11,300	4,745.00	53,618,500	貸付有価証券 1,200株
キャンドウ	9,200	2,235.00	20,562,000	
パルグループホールディングス	19,700	1,164.00	22,930,800	貸付有価証券 100株
エディオン	88,700	1,144.00	101,472,800	貸付有価証券 40,300株
サーラコーポレーション	39,200	592.00	23,206,400	
ワッツ	8,500	1,019.00	8,661,500	貸付有価証券 3,900株
ハローズ	7,300	3,740.00	27,302,000	
フジオフードグループ本 社	16,300	1,245.00	20,293,500	
あみやき亭	4,200	2,745.00	11,529,000	
ひらまつ	35,500	173.00	6,141,500	
大黒天物産	4,600	5,850.00	26,910,000	
ハニーズホールディングス	17,000	1,052.00	17,884,000	
ファーマライズホール ディングス	4,700	706.00	3,318,200	
アルペン	14,800	1,752.00	25,929,600	
ハブ	5,500	591.00	3,250,500	貸付有価証券 100株（100株）
クオールホールディングス	28,400	1,082.00	30,728,800	
ジズホールディングス	10,200	7,060.00	72,012,000	貸付有価証券 4,700株
ビックカメラ	114,600	1,129.00	129,383,400	貸付有価証券 53,800株
D C Mホールディングス	109,200	1,294.00	141,304,800	貸付有価証券 2,900株

MonotaRO	137,400	4,265.00	586,011,000	貸付有価証券 21,700株（3,700株）
東京一番フーズ	4,900	512.00	2,508,800	貸付有価証券 1,400株
DDホールディングス	7,600	798.00	6,064,800	貸付有価証券 3,500株（100株）
きちりホールディングス	5,100	556.00	2,835,600	
アークランドサービス ホールディングス	16,100	1,948.00	31,362,800	
J・フロント リテイリ ング	230,700	730.00	168,411,000	貸付有価証券 100株
ドトール・日レスホール ディングス	27,800	1,553.00	43,173,400	
マツモトキヨシホール ディングス	79,800	3,675.00	293,265,000	貸付有価証券 1,900株
ブロンコビリー	10,100	2,144.00	21,654,400	貸付有価証券 100株
ZOZO	132,800	2,878.00	382,198,400	貸付有価証券 1,500株
トレジャー・ファクト リー	5,700	763.00	4,349,100	
物語コーポレーション	5,100	7,880.00	40,188,000	貸付有価証券 100株（100株）
ココカラファイン	20,200	5,790.00	116,958,000	
三越伊勢丹ホールディ ングス	337,700	555.00	187,423,500	貸付有価証券 9,500株
Hamee	6,900	2,095.00	14,455,500	
ウエルシアホールディ ングス	57,400	9,430.00	541,282,000	
クリエイトSDホール ディングス	32,500	3,880.00	126,100,000	
丸善CHIホールディ ングス	22,500	376.00	8,460,000	貸付有価証券 10,500株（4,600株）
ミサワ	3,900	712.00	2,776,800	
ティーライフ	2,800	1,145.00	3,206,000	
エー・ピーカンパニー	3,600	423.00	1,522,800	貸付有価証券 100株（100株）
チムニー	5,900	1,248.00	7,363,200	貸付有価証券 2,700株
シュッピン	13,100	748.00	9,798,800	
オイシックス・ラ・大地	19,100	3,065.00	58,541,500	貸付有価証券

				200株
ネクステージ	32,300	1,026.00	33,139,800	
ジョイフル本田	56,600	1,468.00	83,088,800	貸付有価証券 800株
鳥貴族	5,700	1,390.00	7,923,000	貸付有価証券 2,400株(400株)
キリン堂ホールディングス	7,600	2,892.00	21,979,200	
ホットランド	14,400	1,107.00	15,940,800	
すかいらくホールディングス	216,500	1,550.00	335,575,000	貸付有価証券 99,600株(500株)
SFPホールディングス	11,000	1,366.00	15,026,000	貸付有価証券 5,100株(200株)
綿半ホールディングス	7,200	2,370.00	17,064,000	
ヨシックス	3,100	1,671.00	5,180,100	貸付有価証券 1,400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	56,100	1,287.00	72,200,700	貸付有価証券 25,800株
ゴルフダイジェスト・オンライン	10,000	494.00	4,940,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
B E E N O S	8,900	1,405.00	12,504,500	貸付有価証券 700株
あさひ	14,400	1,822.00	26,236,800	貸付有価証券 500株(500株)
日本調剤	11,700	1,608.00	18,813,600	
コスモス薬品	17,000	18,660.00	317,220,000	
トーエル	9,300	740.00	6,882,000	
オンリー	3,300	527.00	1,739,100	貸付有価証券 1,100株(100株)
セブン & アイ・ホールディングス	755,700	3,444.00	2,602,630,800	貸付有価証券 200株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	103,800	641.00	66,535,800	貸付有価証券 48,700株(1,800株)
ツルハホールディングス	42,000	14,490.00	608,580,000	
サンマルクホールディングス	15,300	1,556.00	23,806,800	
フェリシモ	4,300	1,054.00	4,532,200	貸付有価証券 2,000株
トリドールホールディングス	47,800	1,220.00	58,316,000	貸付有価証券 22,500株(4,300株)
T O K Y O B A S E	17,400	311.00	5,411,400	貸付有価証券

				4,200株(3,000株)
ウイルプラスホールディングス	2,400	624.00	1,497,600	
J Mホールディングス	14,600	3,665.00	53,509,000	貸付有価証券 1,000株
サツドラホールディングス	2,900	1,964.00	5,695,600	
アレンザホールディングス	9,600	1,333.00	12,796,800	
串カツ田中ホールディングス	5,100	1,404.00	7,160,400	貸付有価証券 2,300株(1,600株)
パロックジャパンリミテッド	13,400	630.00	8,442,000	貸付有価証券 6,200株
クスリのアオキホールディングス	17,300	9,430.00	163,139,000	貸付有価証券 500株
力の源ホールディングス	8,800	638.00	5,614,400	貸付有価証券 100株
スシローグローバルホールディングス	106,000	2,441.00	258,746,000	
L I X I L ビバ	19,100	2,596.00	49,583,600	
メディカルシステムネットワーク	18,700	477.00	8,919,900	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	9,000	717.00	6,453,000	貸付有価証券 4,000株
ノジマ	34,400	2,968.00	102,099,200	
カップ・クリエイト	27,100	1,405.00	38,075,500	貸付有価証券 12,700株(100株)
ライトオン	14,400	576.00	8,294,400	貸付有価証券 6,700株(400株)
ジーンズメイト	5,900	213.00	1,256,700	貸付有価証券 2,700株(2,700株)
良品計画	256,500	1,566.00	401,679,000	貸付有価証券 1,600株
三城ホールディングス	20,500	261.00	5,350,500	
アドヴァン	29,500	1,276.00	37,642,000	
アルビス	7,300	2,439.00	17,804,700	
コナカ	22,800	277.00	6,315,600	
ハウス オブ ローゼ	2,400	1,577.00	3,784,800	貸付有価証券 200株(200株)
G - 7ホールディングス	11,400	2,864.00	32,649,600	
イオン北海道	25,500	787.00	20,068,500	貸付有価証券

				400株
コジマ	33,200	552.00	18,326,400	貸付有価証券 15,600株
ヒマラヤ	6,800	825.00	5,610,000	貸付有価証券 3,100株
コーナン商事	27,500	4,045.00	111,237,500	貸付有価証券 300株
エコス	7,100	2,239.00	15,896,900	貸付有価証券 3,300株
ワタミ	22,800	894.00	20,383,200	貸付有価証券 11,000株
マルシェ	5,100	532.00	2,713,200	貸付有価証券 2,300株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	424,600	2,465.00	1,046,639,000	貸付有価証券 1,600株
西松屋チェーン	42,400	1,174.00	49,777,600	貸付有価証券 19,900株
ゼンショーホールディン グス	92,500	2,192.00	202,760,000	貸付有価証券 4,500株
幸楽苑ホールディングス	12,300	1,621.00	19,938,300	貸付有価証券 2,400株(700株)
ハークスレイ	4,000	960.00	3,840,000	
サイゼリヤ	28,600	1,864.00	53,310,400	貸付有価証券 13,400株
V Tホールディングス	80,000	339.00	27,120,000	
魚力	5,300	1,612.00	8,543,600	貸付有価証券 2,400株
ポプラ	5,000	403.00	2,015,000	貸付有価証券 2,300株
フジ・コーポレーション	5,100	2,038.00	10,393,800	
ユナイテッドアローズ	20,200	1,497.00	30,239,400	
ハイデイ日高	27,900	1,679.00	46,844,100	貸付有価証券 13,100株
京都きもの友禅	12,300	237.00	2,915,100	
コロワイド	64,200	1,392.00	89,366,400	貸付有価証券 30,100株(1,600株)
ピーシーデポコーポレー ション	25,600	656.00	16,793,600	貸付有価証券 3,800株
壱番屋	13,600	5,100.00	69,360,000	貸付有価証券 6,200株
トップカルチャー	7,000	376.00	2,632,000	貸付有価証券

				2,200株(2,200株)
P L A N T	4,900	813.00	3,983,700	
スギホールディングス	38,600	7,590.00	292,974,000	貸付有価証券 100株
薬王堂ホールディングス	8,400	2,556.00	21,470,400	
スクロール	29,700	739.00	21,948,300	
ヨンドシーホールディングス	19,600	1,792.00	35,123,200	貸付有価証券 100株
ファミリーマート	154,300	2,301.00	355,044,300	貸付有価証券 58,200株(500株)
木曽路	25,200	2,285.00	57,582,000	貸付有価証券 11,800株(600株)
S R S ホールディングス	22,700	878.00	19,930,600	貸付有価証券 10,800株
千趣会	34,900	339.00	11,831,100	
タカキュー	14,900	130.00	1,937,000	貸付有価証券 300株(300株)
リテールパートナーズ	25,600	1,997.00	51,123,200	貸付有価証券 12,000株(5,700株)
ケーヨー	39,700	889.00	35,293,300	貸付有価証券 600株
上新電機	22,700	2,258.00	51,256,600	
日本瓦斯	30,500	4,610.00	140,605,000	
ロイヤルホールディングス	33,700	1,673.00	56,380,100	貸付有価証券 1,100株(300株)
東天紅	1,400	980.00	1,372,000	貸付有価証券 100株
いなげや	23,900	1,835.00	43,856,500	
島忠	36,300	3,030.00	109,989,000	貸付有価証券 10,600株
チヨダ	20,300	1,025.00	20,807,500	
ライフコーポレーション	14,600	5,010.00	73,146,000	貸付有価証券 300株
リンガーハット	23,800	2,432.00	57,881,600	貸付有価証券 11,100株
MrMaxHD	26,500	800.00	21,200,000	
テンアライド	17,800	369.00	6,568,200	貸付有価証券 8,400株
A O K I ホールディングス	38,600	575.00	22,195,000	貸付有価証券 500株
オークワ	30,300	1,481.00	44,874,300	

コメリ	29,800	3,215.00	95,807,000	
青山商事	39,900	655.00	26,134,500	貸付有価証券 15,500株(2,300株)
しまむら	22,500	7,950.00	178,875,000	貸付有価証券 100株
はせがわ	10,200	303.00	3,090,600	
高島屋	140,700	830.00	116,781,000	貸付有価証券 10,600株
松屋	38,900	658.00	25,596,200	貸付有価証券 16,500株
エイチ・ツー・オー リテイリング	91,500	724.00	66,246,000	貸付有価証券 8,300株
近鉄百貨店	7,400	2,840.00	21,016,000	貸付有価証券 3,400株
丸井グループ	177,000	1,810.00	320,370,000	貸付有価証券 800株
アクシアル リテイリング	16,000	4,750.00	76,000,000	
井筒屋	10,500	168.00	1,764,000	貸付有価証券 100株
イオン	743,300	2,693.00	2,001,706,900	貸付有価証券 600株
イズミ	39,300	4,380.00	172,134,000	
平和堂	39,200	2,142.00	83,966,400	貸付有価証券 18,400株
フジ	23,300	1,914.00	44,596,200	貸付有価証券 10,900株
ヤオコー	21,900	8,380.00	183,522,000	貸付有価証券 6,100株
ゼビオホールディングス	23,300	749.00	17,451,700	
ケーズホールディングス	186,400	1,433.00	267,111,200	
Olympicグループ	10,000	995.00	9,950,000	
日産東京販売ホールディングス	28,400	252.00	7,156,800	貸付有価証券 100株
シルバーライフ	2,600	1,980.00	5,148,000	貸付有価証券 1,200株
一家ダイニングプロジェクト	2,000	531.00	1,062,000	
Genky Drugs tores	8,500	3,460.00	29,410,000	
ナルミヤ・インターナ	4,300	593.00	2,549,900	

シヨナル				
ブックオフグループホールディングス	11,300	807.00	9,119,100	貸付有価証券 5,200株（400株）
アインホールディングス	23,700	6,600.00	156,420,000	貸付有価証券 300株
元気寿司	4,900	2,126.00	10,417,400	貸付有価証券 2,500株
ヤマダ電機	588,500	543.00	319,555,500	貸付有価証券 2,700株
アークランドサカモト	30,200	2,132.00	64,386,400	貸付有価証券 7,200株（7,200株）
ニトリホールディングス	83,600	22,290.00	1,863,444,000	
グルメ杵屋	13,800	941.00	12,985,800	貸付有価証券 6,400株
愛眼	15,400	222.00	3,418,800	
ケーユーホールディングス	10,100	814.00	8,221,400	
吉野家ホールディングス	63,500	2,060.00	130,810,000	貸付有価証券 29,900株（12,300株）
松屋フーズホールディングス	9,300	3,510.00	32,643,000	
サガミホールディングス	25,800	1,227.00	31,656,600	貸付有価証券 12,300株
関西スーパーマーケット	16,000	1,214.00	19,424,000	
王将フードサービス	14,200	5,790.00	82,218,000	
プレナス	21,600	1,739.00	37,562,400	貸付有価証券 8,300株
ミニストップ	14,300	1,525.00	21,807,500	貸付有価証券 6,700株
アークス	39,500	2,555.00	100,922,500	
バローホールディングス	42,700	2,536.00	108,287,200	
藤久	2,000	1,740.00	3,480,000	
ベルク	9,500	7,560.00	71,820,000	
大庄	10,300	1,195.00	12,308,500	貸付有価証券 4,800株
ファーストリテイリング	25,800	61,020.00	1,574,316,000	
サンドラッグ	72,700	3,985.00	289,709,500	
サックスパーホールディングス	16,400	548.00	8,987,200	
ヤマザワ	4,500	1,744.00	7,848,000	貸付有価証券 2,100株

やまや	4,000	2,060.00	8,240,000	貸付有価証券 1,800株
ペルーナ	41,400	920.00	38,088,000	貸付有価証券 200株
島根銀行	5,100	577.00	2,942,700	
じもとホールディングス	130,700	106.00	13,854,200	貸付有価証券 1,500株(700株)
めぶきフィナンシャルグループ	1,005,100	262.00	263,336,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	26,100	1,145.00	29,884,500	
九州フィナンシャルグループ	423,200	481.00	203,559,200	貸付有価証券 4,000株
ゆうちょ銀行	548,000	848.00	464,704,000	貸付有価証券 258,000株
富山第一銀行	46,100	267.00	12,308,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,104,800	354.00	391,099,200	貸付有価証券 6,100株
西日本フィナンシャルホールディングス	128,700	754.00	97,039,800	貸付有価証券 1,700株
関西みらいフィナンシャルグループ	113,500	445.00	50,507,500	貸付有価証券 8,500株
三十三フィナンシャルグループ	17,900	1,353.00	24,218,700	
第四北越フィナンシャルグループ	33,600	2,066.00	69,417,600	貸付有価証券 200株
新生銀行	142,000	1,208.00	171,536,000	
あおぞら銀行	115,200	1,896.00	218,419,200	貸付有価証券 6,000株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,232,500	432.20	5,719,086,500	貸付有価証券 1,687,500株
りそなホールディングス	2,103,100	382.90	805,276,990	
三井住友トラスト・ホールディングス	365,600	2,998.50	1,096,251,600	貸付有価証券 200株
三井住友フィナンシャルグループ	1,337,800	3,068.00	4,104,370,400	
千葉銀行	645,600	541.00	349,269,600	貸付有価証券 200株
群馬銀行	371,600	365.00	135,634,000	
武蔵野銀行	28,800	1,605.00	46,224,000	
千葉興業銀行	53,000	234.00	12,402,000	

筑波銀行	80,400	172.00	13,828,800	
七十七銀行	65,300	1,597.00	104,284,100	
青森銀行	15,000	2,231.00	33,465,000	
秋田銀行	12,400	1,497.00	18,562,800	
山形銀行	21,700	1,381.00	29,967,700	貸付有価証券 200株
岩手銀行	12,700	2,580.00	32,766,000	
東邦銀行	173,000	228.00	39,444,000	
東北銀行	9,300	994.00	9,244,200	
みちのく銀行	12,400	1,086.00	13,466,400	
ふくおかフィナンシャル グループ	162,900	1,733.00	282,305,700	貸付有価証券 100株
静岡銀行	471,100	742.00	349,556,200	貸付有価証券 200株
十六銀行	24,200	2,015.00	48,763,000	
スルガ銀行	197,900	379.00	75,004,100	
八十二銀行	466,800	415.00	193,722,000	貸付有価証券 200株
山梨中央銀行	22,500	871.00	19,597,500	
大垣共立銀行	38,200	2,278.00	87,019,600	
福井銀行	16,500	1,792.00	29,568,000	
北國銀行	19,300	3,135.00	60,505,500	
清水銀行	8,000	1,652.00	13,216,000	
富山銀行	3,700	2,331.00	8,624,700	
滋賀銀行	38,800	2,546.00	98,784,800	貸付有価証券 1,100株
南都銀行	32,200	2,002.00	64,464,400	
百五銀行	174,100	327.00	56,930,700	
京都銀行	69,300	4,350.00	301,455,000	貸付有価証券 600株
紀陽銀行	68,500	1,591.00	108,983,500	
ほくほくフィナンシャル グループ	128,800	992.00	127,769,600	貸付有価証券 100株
広島銀行	285,600	535.00	152,796,000	貸付有価証券 500株
山陰合同銀行	114,700	550.00	63,085,000	
中国銀行	166,500	1,018.00	169,497,000	
鳥取銀行	6,600	1,112.00	7,339,200	

伊予銀行	276,000	682.00	188,232,000	貸付有価証券 2,700株
百十四銀行	20,600	1,820.00	37,492,000	
四国銀行	29,400	792.00	23,284,800	
阿波銀行	31,600	2,512.00	79,379,200	貸付有価証券 800株
大分銀行	11,100	2,562.00	28,438,200	
宮崎銀行	12,900	2,484.00	32,043,600	
佐賀銀行	11,700	1,264.00	14,788,800	
沖縄銀行	17,700	3,005.00	53,188,500	
琉球銀行	44,600	894.00	39,872,400	
セブン銀行	646,300	267.00	172,562,100	貸付有価証券 22,300株
みずほフィナンシャルグループ	26,285,200	142.80	3,753,526,560	貸付有価証券 400株
高知銀行	7,000	687.00	4,809,000	
山口フィナンシャルグループ	241,500	729.00	176,053,500	
長野銀行	6,300	1,064.00	6,703,200	
名古屋銀行	14,500	2,508.00	36,366,000	
北洋銀行	291,600	239.00	69,692,400	
愛知銀行	7,000	2,909.00	20,363,000	
中京銀行	7,900	2,012.00	15,894,800	
大光銀行	6,600	1,255.00	8,283,000	
愛媛銀行	27,000	1,163.00	31,401,000	貸付有価証券 1,300株
トマト銀行	7,500	1,015.00	7,612,500	
京葉銀行	82,500	501.00	41,332,500	
栃木銀行	93,400	165.00	15,411,000	
北日本銀行	6,000	1,742.00	10,452,000	
東和銀行	34,000	690.00	23,460,000	
福島銀行	18,200	156.00	2,839,200	貸付有価証券 3,500株
大東銀行	10,100	618.00	6,241,800	
トモニホールディングス	149,500	353.00	52,773,500	
フィデアホールディングス	187,800	103.00	19,343,400	
池田泉州ホールディングス	222,400	168.00	37,363,200	

F P G	59,700	519.00	30,984,300	貸付有価証券 13,900株
マーキュリアインベスト メント	7,500	589.00	4,417,500	
S B Iホールディングス	216,100	2,344.00	506,538,400	
日本アジア投資	16,300	217.00	3,537,100	
ジャフコ	29,700	4,090.00	121,473,000	
大和証券グループ本社	1,552,200	483.60	750,643,920	貸付有価証券 300株
野村ホールディングス	3,403,700	535.40	1,822,340,980	貸付有価証券 3,300株
岡三証券グループ	164,800	322.00	53,065,600	貸付有価証券 1,000株
丸三証券	57,500	416.00	23,920,000	貸付有価証券 13,600株
東洋証券	69,100	107.00	7,393,700	貸付有価証券 1,200株
東海東京フィナンシャル・ ホールディングス	222,100	245.00	54,414,500	貸付有価証券 7,000株
光世証券	4,600	572.00	2,631,200	
水戸証券	56,000	200.00	11,200,000	貸付有価証券 300株
いちよし証券	36,200	438.00	15,855,600	
松井証券	110,500	921.00	101,770,500	貸付有価証券 500株
マネックスグループ	141,900	257.00	36,468,300	貸付有価証券 38,200株(37,400株)
極東証券	25,900	578.00	14,970,200	
岩井コスモホールディン グス	18,300	1,246.00	22,801,800	貸付有価証券 400株
藍澤証券	34,700	704.00	24,428,800	
マネーパートナーズグ ループ	20,600	203.00	4,181,800	
スパークス・グループ	89,300	201.00	17,949,300	貸付有価証券 1,100株
小林洋行	5,500	255.00	1,402,500	貸付有価証券 100株
かんぽ生命保険	68,500	1,584.00	108,504,000	貸付有価証券 4,100株
S O M P Oホールディン グス	363,700	3,865.00	1,405,700,500	

アニコム ホールディングス	16,000	4,580.00	73,280,000	貸付有価証券 2,100株
M S & A Dインシュアランスグループホール	505,800	2,893.00	1,463,279,400	貸付有価証券 100株
第一生命ホールディングス	1,094,600	1,508.50	1,651,204,100	
東京海上ホールディングス	683,900	4,804.00	3,285,455,600	貸付有価証券 100株
T & Dホールディングス	578,200	1,055.00	610,001,000	
アドバンスクリエイト	4,000	1,991.00	7,964,000	貸付有価証券 600株
全国保証	54,500	3,850.00	209,825,000	貸付有価証券 9,600株（4,900株）
ジェイリース	5,400	437.00	2,359,800	貸付有価証券 2,500株（900株）
イントラスト	6,800	886.00	6,024,800	貸付有価証券 800株
日本モーゲージサービス	3,900	2,440.00	9,516,000	
C a s a	6,700	1,083.00	7,256,100	貸付有価証券 3,100株
アルヒ	30,800	1,627.00	50,111,600	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
プレミアグループ	10,500	1,939.00	20,359,500	
クレディセゾン	135,500	1,142.00	154,741,000	貸付有価証券 100株
芙蓉総合リース	20,300	6,280.00	127,484,000	
みずほリース	29,800	2,566.00	76,466,800	貸付有価証券 700株
東京センチュリー	39,000	6,020.00	234,780,000	貸付有価証券 3,700株
日本証券金融	85,200	509.00	43,366,800	貸付有価証券 100株
アイフル	295,100	243.00	71,709,300	貸付有価証券 10,900株
リコーリース	15,200	2,839.00	43,152,800	貸付有価証券 200株
イオンフィナンシャルサービス	118,400	920.00	108,928,000	
アコム	388,800	401.00	155,908,800	貸付有価証券 22,100株
ジャックス	21,400	1,713.00	36,658,200	

オリエントコーポレーション	523,200	115.00	60,168,000	
日立キャピタル	45,600	2,617.00	119,335,200	
アプラスフィナンシャル	92,800	71.00	6,588,800	貸付有価証券 10,700株（100株）
オリックス	1,200,100	1,295.00	1,554,129,500	
三菱UFJリース	490,900	504.00	247,413,600	
九州リースサービス	9,500	585.00	5,557,500	
日本取引所グループ	555,200	2,602.00	1,444,630,400	貸付有価証券 43,900株（43,300株）
イー・ギャランティ	20,700	2,356.00	48,769,200	
アサックス	10,000	718.00	7,180,000	貸付有価証券 3,800株
NECキャピタルソリューション	7,900	1,852.00	14,630,800	
いちご	246,200	271.00	66,720,200	貸付有価証券 700株
日本駐車場開発	190,900	136.00	25,962,400	貸付有価証券 28,300株
スター・マイカ・ホールディングス	10,000	1,278.00	12,780,000	貸付有価証券 100株
ADワークスグループ	35,900	162.00	5,815,800	
ヒューリック	410,400	956.00	392,342,400	貸付有価証券 63,900株
三栄建築設計	7,800	1,339.00	10,444,200	
野村不動産ホールディングス	117,500	1,964.00	230,770,000	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	39,200	445.00	17,444,000	貸付有価証券 18,400株
サムティ	27,500	1,287.00	35,392,500	貸付有価証券 900株
ディア・ライフ	27,300	539.00	14,714,700	
コーセーアールイー	5,700	490.00	2,793,000	
日本商業開発	12,200	1,615.00	19,703,000	貸付有価証券 5,700株
プレサンスコーポレーション	31,800	1,338.00	42,548,400	貸付有価証券 500株（400株）
ハウスコム	3,300	1,284.00	4,237,200	
日本管理センター	10,400	1,257.00	13,072,800	
サンセイランディック	5,700	705.00	4,018,500	

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	38,600	573.00	22,117,800	
オープンハウス	60,900	3,450.00	210,105,000	
東急不動産ホールディングス	526,000	449.00	236,174,000	貸付有価証券 200株
飯田グループホールディングス	161,400	2,055.00	331,677,000	
イーランド	3,100	701.00	2,173,100	
ムゲンエステート	11,900	481.00	5,723,900	貸付有価証券 100株
ビーロット	9,000	655.00	5,895,000	
ファーストブラザーズ	3,500	795.00	2,782,500	
ハウストゥ	9,500	903.00	8,578,500	貸付有価証券 2,500株
シーアールイー	5,000	1,377.00	6,885,000	
プロパティエージェント	3,100	1,106.00	3,428,600	
ケイアイスター不動産	6,100	2,055.00	12,535,500	
アグレ都市デザイン	3,100	519.00	1,608,900	
グッドコムアセット	4,600	1,741.00	8,008,600	貸付有価証券 1,100株
ジェイ・エス・ビー	3,500	2,928.00	10,248,000	
テンポイノベーション	4,300	722.00	3,104,600	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	602.00	1,926,400	
パーク24	103,800	1,662.00	172,515,600	貸付有価証券 9,900株
パラカ	5,000	1,688.00	8,440,000	貸付有価証券 2,300株
三井不動産	954,000	1,802.00	1,719,108,000	貸付有価証券 300株
三菱地所	1,355,400	1,668.50	2,261,484,900	貸付有価証券 300株
平和不動産	35,500	2,703.00	95,956,500	貸付有価証券 900株
東京建物	191,000	1,258.00	240,278,000	貸付有価証券 13,300株（3,000株）
ダイビル	49,800	1,093.00	54,431,400	貸付有価証券 3,300株
京阪神ビルディング	31,000	1,370.00	42,470,000	

住友不動産	434,800	3,118.00	1,355,706,400	貸付有価証券 3,300株
テーオーシー	38,000	688.00	26,144,000	
東京楽天地	3,200	4,115.00	13,168,000	
レオパレス21	253,500	165.00	41,827,500	貸付有価証券 103,700株（46,300 株）
スターツコーポレーション	26,300	2,193.00	57,675,900	
フジ住宅	22,400	508.00	11,379,200	
空港施設	19,400	437.00	8,477,800	
明和地所	10,600	462.00	4,897,200	
ゴールドクレスト	15,300	1,458.00	22,307,400	貸付有価証券 3,200株
エスリード	7,500	1,294.00	9,705,000	
日神グループホールディングス	28,600	381.00	10,896,600	
日本エスコン	35,000	767.00	26,845,000	
タカラレーベン	88,400	343.00	30,321,200	貸付有価証券 1,100株
A V A N T I A	10,900	893.00	9,733,700	貸付有価証券 5,100株
イオンモール	97,000	1,380.00	133,860,000	貸付有価証券 100株
毎日コムネット	4,900	768.00	3,763,200	
ファースト住建	8,200	981.00	8,044,200	
カチタス	47,900	2,506.00	120,037,400	貸付有価証券 8,000株
トーセイ	26,700	939.00	25,071,300	
穴吹興産	4,200	1,486.00	6,241,200	
サンフロンティア不動産	26,700	833.00	22,241,100	
エフ・ジェー・ネクスト	16,900	820.00	13,858,000	貸付有価証券 800株
インテリックス	5,400	484.00	2,613,600	
ランドビジネス	6,500	357.00	2,320,500	
サンネクスタグループ	6,000	1,006.00	6,036,000	
グランディハウス	15,000	349.00	5,235,000	
日本空港ビルデング	61,700	4,355.00	268,703,500	貸付有価証券 14,300株
日本工営	12,600	2,788.00	35,128,800	貸付有価証券

				100株
L I F U L L	65,400	481.00	31,457,400	
ミクシィ	35,700	2,405.00	85,858,500	貸付有価証券 14,500株(4,300株)
ジェイエイシーリクルー トメント	12,600	1,223.00	15,409,800	貸付有価証券 2,800株(2,100株)
日本M&Aセンター	141,600	5,340.00	756,144,000	貸付有価証券 15,600株
メンバーズ	5,500	1,595.00	8,772,500	貸付有価証券 1,500株
中広	2,600	517.00	1,344,200	貸付有価証券 1,200株
UTグループ	29,500	3,025.00	89,237,500	貸付有価証券 13,500株(4,900株)
アイティメディア	7,500	2,616.00	19,620,000	貸付有価証券 1,000株(100株)
タケエイ	17,900	1,155.00	20,674,500	
E・Jホールディングス	3,300	2,448.00	8,078,400	
ビーネックスグループ	23,500	1,184.00	27,824,000	貸付有価証券 600株
コシダカホールディング ス	45,100	427.00	19,257,700	貸付有価証券 21,100株
アルトナー	4,500	899.00	4,045,500	
パソナグループ	20,300	1,344.00	27,283,200	貸付有価証券 1,000株
C D S	4,600	1,247.00	5,736,200	
リンクアンドモチベー ション	34,400	305.00	10,492,000	貸付有価証券 16,100株(5,400株)
G C A	24,100	604.00	14,556,400	
エス・エム・エス	58,300	2,913.00	169,827,900	
サニーサイドアップグ ループ	6,500	708.00	4,602,000	貸付有価証券 900株(300株)
パーソルホールディング ス	187,400	1,682.00	315,206,800	貸付有価証券 1,800株
リニカル	9,000	824.00	7,416,000	貸付有価証券 1,000株
クックパッド	58,900	366.00	21,557,400	貸付有価証券 7,000株(5,000株)
エスクリ	5,800	338.00	1,960,400	貸付有価証券 2,700株
アイ・ケイ・ケイ	9,100	535.00	4,868,500	

学情	6,600	1,011.00	6,672,600	貸付有価証券 800株
スタジオアリス	9,400	1,545.00	14,523,000	貸付有価証券 4,400株
シミックホールディングス	9,200	1,303.00	11,987,600	
エプロ	4,500	1,028.00	4,626,000	
N J S	4,600	1,743.00	8,017,800	
総合警備保障	74,600	5,200.00	387,920,000	貸付有価証券 600株
カカクコム	138,500	2,609.00	361,346,500	貸付有価証券 800株
セントケア・ホールディング	12,200	500.00	6,100,000	貸付有価証券 6,600株
サイネックス	3,200	666.00	2,131,200	
ルネサンス	10,400	855.00	8,892,000	貸付有価証券 4,800株
ディップ	26,400	2,155.00	56,892,000	貸付有価証券 8,700株（8,500株）
デジタルホールディングス	13,100	1,218.00	15,955,800	
新日本科学	20,300	691.00	14,027,300	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
ツクイ	44,100	563.00	24,828,300	
キャリアデザインセンター	4,300	830.00	3,569,000	
ベネフィット・ワン	68,200	2,567.00	175,069,400	貸付有価証券 2,700株
エムスリー	413,300	5,930.00	2,450,869,000	貸付有価証券 300株
ツカダ・グローバルホールディング	14,900	251.00	3,739,900	貸付有価証券 200株
プラス	2,400	406.00	974,400	
アウトソーシング	107,300	815.00	87,449,500	貸付有価証券 6,600株
ウェルネット	18,900	611.00	11,547,900	
ワールドホールディングス	6,400	1,761.00	11,270,400	
ディー・エヌ・エー	79,300	1,759.00	139,488,700	貸付有価証券 900株
博報堂D Yホールディング	260,700	1,342.00	349,859,400	貸付有価証券

グス				100株
ぐるなび	32,600	552.00	17,995,200	貸付有価証券 100株
タカミヤ	19,900	544.00	10,825,600	
ジャパンベストレス キューシステム	14,800	906.00	13,408,800	貸付有価証券 4,100株
ファンコミュニケーションズ	51,500	451.00	23,226,500	貸付有価証券 200株
ライク	6,200	1,812.00	11,234,400	
ビジネス・ブレイクス ルー	7,800	382.00	2,979,600	
エスプール	48,100	703.00	33,814,300	
WDBホールディングス	8,600	2,797.00	24,054,200	貸付有価証券 700株
手間いらず	1,200	4,475.00	5,370,000	貸付有価証券 500株(300株)
ティア	10,900	465.00	5,068,500	
CDG	2,000	1,638.00	3,276,000	貸付有価証券 900株
パリュウコマース	12,600	3,300.00	41,580,000	
インフォマート	189,600	689.00	130,634,400	貸付有価証券 16,500株(7,100株)
JPホールディングス	58,800	289.00	16,993,200	貸付有価証券 27,600株
EPSホールディングス	25,400	1,015.00	25,781,000	
レグス	4,600	961.00	4,420,600	
プレステージ・インター ナショナル	70,200	952.00	66,830,400	
アミューズ	10,200	2,111.00	21,532,200	
ドリームインキュベータ	5,700	1,380.00	7,866,000	
クイック	11,600	1,241.00	14,395,600	
TAC	11,300	189.00	2,135,700	
ケネディクス	161,200	476.00	76,731,200	
電通グループ	210,700	2,745.00	578,371,500	貸付有価証券 12,000株
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	7,200	501.00	3,607,200	
ぴあ	5,400	2,780.00	15,012,000	貸付有価証券 2,500株(1,400株)
イオンファンタジー	7,200	1,602.00	11,534,400	貸付有価証券

				3,200株(3,000株)
シーティーエス	21,100	845.00	17,829,500	
ネクシィーズグループ	5,700	835.00	4,759,500	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
H.U.グループホールディングス	52,400	2,329.00	122,039,600	貸付有価証券 1,100株
アルプス技研	16,600	1,929.00	32,021,400	
ダイオーズ	3,700	941.00	3,481,700	貸付有価証券 2,100株
日本空調サービス	19,600	723.00	14,170,800	
オリエンタルランド	199,300	13,875.00	2,765,287,500	貸付有価証券 200株
ダスキン	46,600	2,677.00	124,748,200	
明光ネットワークジャパン	23,700	756.00	17,917,200	貸付有価証券 11,100株
ファルコホールディングス	10,300	1,412.00	14,543,600	
秀英予備校	4,100	430.00	1,763,000	貸付有価証券 100株
ラウンドワン	52,300	772.00	40,375,600	貸付有価証券 21,400株
リゾートトラスト	85,900	1,326.00	113,903,400	貸付有価証券 3,100株
ピー・エム・エル	24,100	2,715.00	65,431,500	
ワタベウェディング	2,400	255.00	612,000	貸付有価証券 1,100株
りらいあコミュニケーションズ	33,900	1,135.00	38,476,500	
リソー教育	85,600	311.00	26,621,600	
早稲田アカデミー	8,100	939.00	7,605,900	
ユー・エス・エス	209,800	1,750.00	367,150,000	
東京個別指導学院	6,600	528.00	3,484,800	貸付有価証券 100株
サイバーエージェント	115,500	5,830.00	673,365,000	貸付有価証券 1,700株
楽天	873,500	972.00	849,042,000	貸付有価証券 13,000株
クリーク・アンド・リバー社	9,800	1,229.00	12,044,200	
テー・オー・ダブリュー	29,800	297.00	8,850,600	
山田コンサルティンググループ	12,100	1,173.00	14,193,300	

ループ				
セントラルスポーツ	7,000	2,080.00	14,560,000	貸付有価証券 3,200株
フルキャストホールディングス	16,400	1,526.00	25,026,400	貸付有価証券 300株
エン・ジャパン	33,300	3,005.00	100,066,500	貸付有価証券 600株
リソルホールディングス	2,000	3,330.00	6,660,000	
テクノプロ・ホールディングス	37,400	5,880.00	219,912,000	
アトラ	4,300	252.00	1,083,600	
インターワークス	3,600	339.00	1,220,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,600	12,350.00	93,860,000	貸付有価証券 100株
Keepers 技研	6,900	1,763.00	12,164,700	
ファーストロジック	3,600	754.00	2,714,400	貸付有価証券 500株（300株）
三機サービス	3,600	1,058.00	3,808,800	
Gunosy	11,600	893.00	10,358,800	貸付有価証券 600株（600株）
デザインワン・ジャパン	5,500	249.00	1,369,500	
イー・ガーディアン	8,200	3,235.00	26,527,000	
リブセンス	10,300	284.00	2,925,200	貸付有価証券 100株
ジャパンマテリアル	57,600	1,555.00	89,568,000	
ベクトル	23,400	841.00	19,679,400	貸付有価証券 4,100株
ウチヤマホールディングス	9,200	285.00	2,622,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	15,900	951.00	15,120,900	貸付有価証券 600株
キャリアリンク	6,100	772.00	4,709,200	貸付有価証券 2,800株
I B J	15,300	816.00	12,484,800	貸付有価証券 4,100株（4,000株）
アサンテ	7,500	1,434.00	10,755,000	
N・フィールド	12,900	595.00	7,675,500	
パリューHR	7,400	1,400.00	10,360,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	15,200	4,000.00	60,800,000	

ライドオンエクスプレス ホールディングス	7,200	2,898.00	20,865,600	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
E R Iホールディングス	5,200	563.00	2,927,600	
アビスト	2,900	2,699.00	7,827,100	
シグマクシス	12,800	1,459.00	18,675,200	貸付有価証券 6,000株
ウィルグループ	12,200	760.00	9,272,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	27,700	310.00	8,587,000	貸付有価証券 4,800株
リクルートホールディン グス	1,342,600	3,756.00	5,042,805,600	貸付有価証券 1,400株
エラン	12,900	2,299.00	29,657,100	貸付有価証券 100株
土木管理総合試験所	9,100	369.00	3,357,900	
ネットマーケティング	7,200	560.00	4,032,000	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
日本郵政	1,536,100	773.10	1,187,558,910	貸付有価証券 1,600株
ベルシステム24ホール ディングス	31,400	1,789.00	56,174,600	
鎌倉新書	14,100	875.00	12,337,500	貸付有価証券 5,000株（100株）
S M N	4,000	895.00	3,580,000	
一蔵	2,000	345.00	690,000	
L I T A L I C O	6,400	2,365.00	15,136,000	貸付有価証券 600株（600株）
グローバルキッズCOM P A N Y	3,400	669.00	2,274,600	
エアトリ	9,800	1,241.00	12,161,800	貸付有価証券 4,500株（100株）
ハイアス・アンド・カン パニー	11,300	314.00	3,548,200	貸付有価証券 5,300株
アトラエ	5,700	3,245.00	18,496,500	貸付有価証券 900株
ストライク	7,100	4,740.00	33,654,000	貸付有価証券 2,900株（200株）
ソラスト	51,700	1,155.00	59,713,500	貸付有価証券 600株
セラク	5,900	1,194.00	7,044,600	貸付有価証券 2,300株

インソース	7,800	2,647.00	20,646,600	貸付有価証券 3,100株(1,100株)
ベイカレント・コンサルティング	11,400	11,500.00	131,100,000	貸付有価証券 300株(300株)
Orchestra Holdings	3,900	1,597.00	6,228,300	貸付有価証券 100株
アイモバイル	6,600	756.00	4,989,600	貸付有価証券 1,800株(1,700株)
キャリアインデックス	7,700	502.00	3,865,400	貸付有価証券 2,400株(700株)
MS - Japan	6,100	818.00	4,989,800	貸付有価証券 2,400株(300株)
船場	3,700	896.00	3,315,200	
グレイステクノロジー	8,600	5,140.00	44,204,000	貸付有価証券 600株
ジャパンエレベーター サービスホールディング	19,700	3,650.00	71,905,000	
フルテック	2,600	1,284.00	3,338,400	
グリーンズ	4,700	429.00	2,016,300	
ツナググループ・ホール ディングス	3,100	411.00	1,274,100	
GameWith	5,500	600.00	3,300,000	貸付有価証券 200株
ソウルドアウト	4,500	1,702.00	7,659,000	
MS & Consulting	3,500	576.00	2,016,000	
エル・ティー・エス	1,300	3,575.00	4,647,500	
ミダック	2,400	1,732.00	4,156,800	
日総工産	12,500	657.00	8,212,500	貸付有価証券 200株
キュービーネットホール ディングス	7,800	1,730.00	13,494,000	
RPAホールディングス	14,200	786.00	11,161,200	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
スプリックス	5,300	860.00	4,558,000	貸付有価証券 400株(400株)
マネジメントソリューションズ	9,100	1,162.00	10,574,200	貸付有価証券 300株(300株)
プロレド・パートナーズ	2,500	5,010.00	12,525,000	
and factory	1,800	908.00	1,634,400	貸付有価証券 200株

ピアラ	1,300	1,643.00	2,135,900	
ギークス	1,900	1,215.00	2,308,500	貸付有価証券 800株(800株)
カーブスホールディングス	51,400	628.00	32,279,200	貸付有価証券 24,100株(2,200株)
フォーラムエンジニアリング	9,700	818.00	7,934,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	9,400	698.00	6,561,200	
リログループ	102,400	2,078.00	212,787,200	
東祥	11,700	1,291.00	15,104,700	
エイチ・アイ・エス	29,200	1,604.00	46,836,800	貸付有価証券 13,700株(4,000株)
ラックランド	5,300	2,181.00	11,559,300	
共立メンテナンス	31,000	3,425.00	106,175,000	貸付有価証券 7,900株
イチネンホールディングス	21,000	1,145.00	24,045,000	
建設技術研究所	12,100	1,875.00	22,687,500	
スペース	12,100	822.00	9,946,200	貸付有価証券 1,300株
長大	7,500	1,209.00	9,067,500	
燦ホールディングス	8,100	1,204.00	9,752,400	
スバル興業	1,100	7,340.00	8,074,000	
東京テアトル	7,300	1,240.00	9,052,000	
タナベ経営	3,600	1,323.00	4,762,800	
ナガワ	6,000	7,770.00	46,620,000	
よみうりランド	4,100	3,565.00	14,616,500	貸付有価証券 1,800株
東京都競馬	12,300	4,745.00	58,363,500	
常磐興産	7,500	1,355.00	10,162,500	
カナモト	33,000	2,278.00	75,174,000	
東京ドーム	75,900	748.00	56,773,200	貸付有価証券 31,400株
西尾レントオール	17,300	2,196.00	37,990,800	
トランス・コスモス	17,800	2,893.00	51,495,400	貸付有価証券 600株
乃村工藝社	80,300	737.00	59,181,100	貸付有価証券 100株
藤田観光	7,400	1,446.00	10,700,400	貸付有価証券

				400株
KNT - CTホールディングス	11,600	821.00	9,523,600	貸付有価証券 5,400株
日本管財	20,100	1,958.00	39,355,800	
トーカイ	18,100	2,199.00	39,801,900	
白洋舎	2,100	2,436.00	5,115,600	貸付有価証券 900株
セコム	198,900	10,175.00	2,023,807,500	貸付有価証券 300株
セントラル警備保障	9,000	3,605.00	32,445,000	貸付有価証券 100株
丹青社	35,400	648.00	22,939,200	貸付有価証券 1,600株
メイテック	23,000	5,200.00	119,600,000	
応用地質	21,800	1,269.00	27,664,200	
船井総研ホールディングス	38,700	2,359.00	91,293,300	
進学会ホールディングス	7,300	423.00	3,087,900	
オオバ	13,300	714.00	9,496,200	貸付有価証券 100株(100株)
いであ	4,600	1,923.00	8,845,800	
学究社	5,500	1,114.00	6,127,000	
ベネッセホールディングス	62,400	2,704.00	168,729,600	貸付有価証券 1,200株
イオンディライト	23,100	3,205.00	74,035,500	
ナック	10,400	942.00	9,796,800	貸付有価証券 2,600株
ニチイ学館	26,700	1,698.00	45,336,600	貸付有価証券 600株
ダイセキ	31,400	2,345.00	73,633,000	
ステップ	6,900	1,507.00	10,398,300	
小計	銘柄数：2,153 組入時価比率：98.4%		442,417,529,610 100.0%	
合計			442,417,529,610	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年8月17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 8月17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	6,846,624,807	-	7,063,510,000	216,667,888
合計	6,846,624,807	-	7,063,510,000	216,667,888

（注）時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2020年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,218,243,759
国債証券	31,653,340,830
未収入金	107,995,250
未収利息	71,795,803
前払費用	484,705
流動資産合計	34,051,860,347
資産合計	34,051,860,347
負債の部	
流動負債	
未払金	2,008,212,000
未払解約金	15,785,501
未払利息	2,714
流動負債合計	2,024,000,215
負債合計	2,024,000,215
純資産の部	
元本等	
元本	23,499,753,310
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,528,106,822
元本等合計	32,027,860,132
純資産合計	32,027,860,132

(2020年 8月17日現在)

負債純資産合計	34,051,860,347
---------	----------------

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17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	1.3629円
(10,000口当たり純資産額)	(13,629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 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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。	
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 8月17日現在	
期首	2020年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	24,808,962,337円
同期中における追加設定元本額	5,489,195,750円
同期中における一部解約元本額	6,798,404,777円
期末元本額	23,499,753,310円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	526,757,267円
バランスセレクト50	574,649,814円
バランスセレクト70	246,939,255円
ネクストコア	380,604,212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)	2,471,360,051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)	7,069,771,441円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	24,139,266円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	45,313,685円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	19,047,421円
野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け)	5,182,614,363円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	144,769,169円
野村DC運用戦略ファンド	6,022,803,698円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	790,983,668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8月17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8月17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405回	200,000,000	200,526,000	
		国庫債券 利付(2年)第409回	100,000,000	100,343,000	
		国庫債券 利付(2年)第410回	200,000,000	200,722,000	
		国庫債券 利付(2年)第414回	200,000,000	200,860,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	420,000,000	421,054,200	
		国庫債券 利付(5年)第130回	410,000,000	411,262,800	
		国庫債券 利付(5年)第131回	200,000,000	200,730,000	
		国庫債券 利付(5年)第132回	420,000,000	421,776,600	
		国庫債券 利付(5年)第133回	380,000,000	381,789,800	
		国庫債券 利付(5年)第134回	470,000,000	472,476,900	
		国庫債券 利付(5年)第135回	150,000,000	150,874,500	
		国庫債券 利付(5年)第137回	350,000,000	352,387,000	
		国庫債券 利付(5年)第138回	350,000,000	352,579,500	
		国庫債券 利付(5年)第139回	620,000,000	624,798,800	
		国庫債券 利付(5年)第140回	390,000,000	393,229,200	
		国庫債券 利付(5年)第141回	100,000,000	100,862,000	
		国庫債券 利付(5年)第142回	200,000,000	201,742,000	
		国庫債券 利付(5年)第143回	270,000,000	272,362,500	
		国庫債券 利付(40年)第1回	30,000,000	43,977,900	
		国庫債券 利付(40年)第2回	30,000,000	42,702,300	
		国庫債券 利付(40年)第3回	60,000,000	85,956,600	
		国庫債券 利付(40年)第4回	75,000,000	108,107,250	
		国庫債券 利付(40年)第5回	60,000,000	83,750,400	
		国庫債券 利付(40年)第6回	90,000,000	123,916,500	
		国庫債券 利付(40年)第7回	100,000,000	132,601,000	
		国庫債券 利付(40年)第8回	70,000,000	86,910,600	
		国庫債券 利付(40年)第9回	110,000,000	102,198,800	
国庫債券 利付(40年)第10回	70,000,000	76,300,000			
国庫債券 利付(40年)第11回	80,000,000	84,647,200			
国庫債券 利付(40年)第12回	70,000,000	66,966,900			

国庫債券	利付(40年)第13回	50,000,000	47,789,000	
国庫債券	利付(10年)第319回	70,000,000	71,155,000	
国庫債券	利付(10年)第320回	90,000,000	91,364,400	
国庫債券	利付(10年)第321回	150,000,000	152,694,000	
国庫債券	利付(10年)第322回	130,000,000	132,128,100	
国庫債券	利付(10年)第323回	70,000,000	71,328,600	
国庫債券	利付(10年)第324回	150,000,000	152,569,500	
国庫債券	利付(10年)第325回	330,000,000	336,395,400	
国庫債券	利付(10年)第326回	240,000,000	244,644,000	
国庫債券	利付(10年)第327回	230,000,000	234,991,000	
国庫債券	利付(10年)第328回	230,000,000	234,326,300	
国庫債券	利付(10年)第329回	350,000,000	359,170,000	
国庫債券	利付(10年)第330回	220,000,000	226,276,600	
国庫債券	利付(10年)第331回	90,000,000	92,009,700	
国庫債券	利付(10年)第332回	350,000,000	358,449,000	
国庫債券	利付(10年)第333回	250,000,000	256,435,000	
国庫債券	利付(10年)第334回	340,000,000	349,370,400	
国庫債券	利付(10年)第335回	200,000,000	205,012,000	
国庫債券	利付(10年)第336回	120,000,000	123,138,000	
国庫債券	利付(10年)第337回	220,000,000	223,834,600	
国庫債券	利付(10年)第338回	400,000,000	409,024,000	
国庫債券	利付(10年)第339回	300,000,000	306,993,000	
国庫債券	利付(10年)第340回	330,000,000	338,180,700	
国庫債券	利付(10年)第341回	300,000,000	306,195,000	
国庫債券	利付(10年)第342回	520,000,000	525,252,000	
国庫債券	利付(10年)第343回	250,000,000	252,637,500	
国庫債券	利付(10年)第344回	550,000,000	556,055,500	

国庫債券 回	利付(10年)第345	560,000,000	566,417,600
国庫債券 回	利付(10年)第346	350,000,000	354,168,500
国庫債券 回	利付(10年)第347	300,000,000	303,606,000
国庫債券 回	利付(10年)第348	120,000,000	121,410,000
国庫債券 回	利付(10年)第349	400,000,000	404,716,000
国庫債券 回	利付(10年)第350	500,000,000	505,900,000
国庫債券 回	利付(10年)第351	330,000,000	333,762,000
国庫債券 回	利付(10年)第352	450,000,000	454,927,500
国庫債券 回	利付(10年)第353	340,000,000	343,549,600
国庫債券 回	利付(10年)第354	200,000,000	201,890,000
国庫債券 回	利付(10年)第355	50,000,000	50,441,500
国庫債券 回	利付(10年)第357	70,000,000	70,521,500
国庫債券 回	利付(10年)第358	100,000,000	100,669,000
国庫債券 回	利付(10年)第359	310,000,000	311,819,700
国庫債券	利付(30年)第3回	40,000,000	48,806,400
国庫債券	利付(30年)第5回	10,000,000	12,253,700
国庫債券	利付(30年)第6回	10,000,000	12,553,400
国庫債券	利付(30年)第7回	15,000,000	18,778,950
国庫債券	利付(30年)第8回	20,000,000	23,988,000
国庫債券	利付(30年)第9回	20,000,000	23,028,800
国庫債券	利付(30年)第10回	30,000,000	33,438,000
国庫債券	利付(30年)第11回	10,000,000	11,914,800
国庫債券	利付(30年)第12回	10,000,000	12,455,500
国庫債券	利付(30年)第13回	10,000,000	12,354,800
国庫債券	利付(30年)第14回	30,000,000	38,755,200
国庫債券	利付(30年)第15回	70,000,000	91,617,400
国庫債券	利付(30年)第16回	10,000,000	13,124,900
国庫債券	利付(30年)第17回	20,000,000	26,060,800
国庫債券	利付(30年)第18回	120,000,000	155,055,600
国庫債券	利付(30年)第19回	10,000,000	12,951,500
国庫債券	利付(30年)第20回	10,000,000	13,281,500
国庫債券	利付(30年)第21回	60,000,000	78,112,800
国庫債券	利付(30年)第22回	50,000,000	66,776,500
国庫債券	利付(30年)第23回	40,000,000	53,548,400

国庫債券	利付(30年)第24回	80,000,000	107,427,200
国庫債券	利付(30年)第25回	50,000,000	65,678,000
国庫債券	利付(30年)第26回	80,000,000	106,628,000
国庫債券	利付(30年)第27回	100,000,000	135,654,000
国庫債券	利付(30年)第28回	30,000,000	40,922,700
国庫債券	利付(30年)第29回	120,000,000	162,404,400
国庫債券	利付(30年)第30回	80,000,000	107,316,800
国庫債券	利付(30年)第31回	40,000,000	53,194,400
国庫債券	利付(30年)第32回	110,000,000	148,907,000
国庫債券	利付(30年)第33回	80,000,000	104,092,800
国庫債券	利付(30年)第34回	110,000,000	147,940,100
国庫債券	利付(30年)第35回	122,000,000	159,809,020
国庫債券	利付(30年)第36回	130,000,000	170,821,300
国庫債券	利付(30年)第37回	130,000,000	168,721,800
国庫債券	利付(30年)第38回	140,000,000	179,300,800
国庫債券	利付(30年)第39回	80,000,000	104,347,200
国庫債券	利付(30年)第40回	120,000,000	154,207,200
国庫債券	利付(30年)第41回	100,000,000	126,535,000
国庫債券	利付(30年)第42回	110,000,000	139,318,300
国庫債券	利付(30年)第43回	90,000,000	114,096,600
国庫債券	利付(30年)第44回	110,000,000	139,581,200
国庫債券	利付(30年)第45回	90,000,000	110,246,400
国庫債券	利付(30年)第46回	150,000,000	183,847,500
国庫債券	利付(30年)第47回	110,000,000	137,493,400
国庫債券	利付(30年)第48回	110,000,000	132,513,700
国庫債券	利付(30年)第49回	120,000,000	144,614,400
国庫債券	利付(30年)第50回	40,000,000	42,480,800
国庫債券	利付(30年)第51回	130,000,000	122,370,300
国庫債券	利付(30年)第52回	90,000,000	88,973,100
国庫債券	利付(30年)第53回	100,000,000	101,150,000
国庫債券	利付(30年)第54回	130,000,000	137,857,200
国庫債券	利付(30年)第55回	80,000,000	84,776,000
国庫債券	利付(30年)第56回	80,000,000	84,715,200
国庫債券	利付(30年)第57回	110,000,000	116,396,500
国庫債券	利付(30年)第58回	180,000,000	190,321,200
国庫債券	利付(30年)第59回	110,000,000	113,435,300
国庫債券	利付(30年)第60回	100,000,000	108,121,000
国庫債券	利付(30年)第61回	100,000,000	102,920,000
国庫債券	利付(30年)第62回	40,000,000	39,023,600
国庫債券	利付(30年)第63回	40,000,000	37,939,600
国庫債券	利付(30年)第64回	60,000,000	56,816,400
国庫債券	利付(30年)第65回	100,000,000	94,538,000
国庫債券	利付(30年)第66回	20,000,000	18,899,800

国庫債券	利付(30年)第67回	50,000,000	49,810,500
国庫債券	利付(20年)第53回	10,000,000	10,298,500
国庫債券	利付(20年)第54回	10,000,000	10,312,000
国庫債券	利付(20年)第55回	10,000,000	10,339,100
国庫債券	利付(20年)第56回	10,000,000	10,391,500
国庫債券	利付(20年)第57回	10,000,000	10,373,100
国庫債券	利付(20年)第58回	10,000,000	10,424,400
国庫債券	利付(20年)第59回	30,000,000	31,284,600
国庫債券	利付(20年)第60回	10,000,000	10,357,800
国庫債券	利付(20年)第61回	10,000,000	10,291,900
国庫債券	利付(20年)第62回	80,000,000	82,096,000
国庫債券	利付(20年)第63回	10,000,000	10,546,800
国庫債券	利付(20年)第64回	10,000,000	10,624,900
国庫債券	利付(20年)第65回	10,000,000	10,675,500
国庫債券	利付(20年)第66回	20,000,000	21,284,000
国庫債券	利付(20年)第67回	10,000,000	10,723,700
国庫債券	利付(20年)第68回	10,000,000	10,831,700
国庫債券	利付(20年)第69回	30,000,000	32,387,100
国庫債券	利付(20年)第70回	40,000,000	43,870,000
国庫債券	利付(20年)第71回	10,000,000	10,890,400
国庫債券	利付(20年)第72回	20,000,000	21,811,600
国庫債券	利付(20年)第73回	10,000,000	10,915,300
国庫債券	利付(20年)第74回	10,000,000	10,958,900
国庫債券	利付(20年)第75回	40,000,000	44,034,000
国庫債券	利付(20年)第76回	17,000,000	18,557,880
国庫債券	利付(20年)第77回	15,000,000	16,443,750
国庫債券	利付(20年)第78回	10,000,000	10,959,000
国庫債券	利付(20年)第79回	10,000,000	11,007,600
国庫債券	利付(20年)第80回	10,000,000	11,056,100
国庫債券	利付(20年)第81回	10,000,000	11,063,100
国庫債券	利付(20年)第82回	15,000,000	16,671,300
国庫債券	利付(20年)第83回	15,000,000	16,753,500
国庫債券	利付(20年)第84回	50,000,000	55,577,000
国庫債券	利付(20年)第85回	13,000,000	14,586,130
国庫債券	利付(20年)第86回	10,000,000	11,332,300
国庫債券	利付(20年)第88回	20,000,000	22,785,400
国庫債券	利付(20年)第90回	20,000,000	22,783,800
国庫債券	利付(20年)第91回	10,000,000	11,453,100
国庫債券	利付(20年)第92回	30,000,000	34,156,200
国庫債券	利付(20年)第93回	20,000,000	22,746,800
国庫債券	利付(20年)第94回	20,000,000	22,879,200
国庫債券	利付(20年)第95回	10,000,000	11,628,400

国庫債券	利付(20年)第96回	15,000,000	17,236,500
国庫債券	利付(20年)第97回	50,000,000	58,046,000
国庫債券	利付(20年)第99回	30,000,000	34,764,300
国庫債券	利付(20年)第100回	20,000,000	23,426,800
国庫債券	利付(20年)第101回	20,000,000	23,731,400
国庫債券	利付(20年)第102回	20,000,000	23,837,000
国庫債券	利付(20年)第103回	25,000,000	29,599,750
国庫債券	利付(20年)第104回	10,000,000	11,682,600
国庫債券	利付(20年)第105回	70,000,000	82,125,400
国庫債券	利付(20年)第106回	100,000,000	118,133,000
国庫債券	利付(20年)第107回	100,000,000	117,758,000
国庫債券	利付(20年)第108回	80,000,000	92,869,600
国庫債券	利付(20年)第109回	30,000,000	34,923,900
国庫債券	利付(20年)第110回	90,000,000	106,318,800
国庫債券	利付(20年)第111回	10,000,000	11,944,400
国庫債券	利付(20年)第112回	85,000,000	100,776,000
国庫債券	利付(20年)第113回	160,000,000	190,369,600
国庫債券	利付(20年)第114回	100,000,000	119,390,000
国庫債券	利付(20年)第115回	50,000,000	60,161,000
国庫債券	利付(20年)第116回	110,000,000	132,816,200
国庫債券	利付(20年)第117回	60,000,000	71,871,600
国庫債券	利付(20年)第118回	40,000,000	47,682,800
国庫債券	利付(20年)第119回	50,000,000	58,623,500
国庫債券	利付(20年)第120回	110,000,000	126,815,700
国庫債券	利付(20年)第121回	70,000,000	83,001,100
国庫債券	利付(20年)第122回	130,000,000	152,839,700
国庫債券	利付(20年)第123回	100,000,000	120,900,000
国庫債券	利付(20年)第124回	100,000,000	119,873,000

国庫債券 回	利付(20年)第125	100,000,000	122,318,000	
国庫債券 回	利付(20年)第126	30,000,000	36,065,400	
国庫債券 回	利付(20年)第128	100,000,000	119,427,000	
国庫債券 回	利付(20年)第129	50,000,000	59,177,000	
国庫債券 回	利付(20年)第130	90,000,000	106,781,400	
国庫債券 回	利付(20年)第131	35,000,000	41,142,500	
国庫債券 回	利付(20年)第132	60,000,000	70,684,800	
国庫債券 回	利付(20年)第133	120,000,000	142,713,600	
国庫債券 回	利付(20年)第134	70,000,000	83,438,600	
国庫債券 回	利付(20年)第135	60,000,000	70,833,000	
国庫債券 回	利付(20年)第136	30,000,000	35,073,600	
国庫債券 回	利付(20年)第137	40,000,000	47,321,600	
国庫債券 回	利付(20年)第138	50,000,000	57,986,000	
国庫債券 回	利付(20年)第139	60,000,000	70,282,800	
国庫債券 回	利付(20年)第140	140,000,000	165,965,800	
国庫債券 回	利付(20年)第141	100,000,000	118,778,000	
国庫債券 回	利付(20年)第142	100,000,000	119,990,000	
国庫債券 回	利付(20年)第143	130,000,000	153,000,900	
国庫債券 回	利付(20年)第144	80,000,000	93,168,000	
国庫債券 回	利付(20年)第145	190,000,000	226,381,200	
国庫債券 回	利付(20年)第146	140,000,000	167,108,200	
国庫債券 回	利付(20年)第147	150,000,000	177,400,500	
国庫債券 回	利付(20年)第148	170,000,000	199,098,900	
国庫債券 回	利付(20年)第149	100,000,000	117,268,000	
国庫債券 回	利付(20年)第150	220,000,000	255,303,400	
国庫債券 回	利付(20年)第151	170,000,000	192,756,200	
		330,000,000	374,381,700	

	国庫債券 利付(20年)第152回			
	国庫債券 利付(20年)第153回	120,000,000	137,928,000	
	国庫債券 利付(20年)第154回	160,000,000	181,705,600	
	国庫債券 利付(20年)第155回	160,000,000	177,073,600	
	国庫債券 利付(20年)第156回	150,000,000	152,346,000	
	国庫債券 利付(20年)第157回	10,000,000	9,833,900	
	国庫債券 利付(20年)第158回	60,000,000	61,746,600	
	国庫債券 利付(20年)第159回	100,000,000	104,347,000	
	国庫債券 利付(20年)第160回	130,000,000	137,671,300	
	国庫債券 利付(20年)第161回	110,000,000	114,645,300	
	国庫債券 利付(20年)第163回	100,000,000	104,086,000	
	国庫債券 利付(20年)第164回	230,000,000	235,520,000	
	国庫債券 利付(20年)第165回	190,000,000	194,294,000	
	国庫債券 利付(20年)第166回	160,000,000	168,952,000	
	国庫債券 利付(20年)第168回	70,000,000	70,060,200	
	国庫債券 利付(20年)第169回	40,000,000	39,264,800	
	国庫債券 利付(20年)第170回	120,000,000	117,662,400	
	国庫債券 利付(20年)第171回	50,000,000	48,970,500	
	国庫債券 利付(20年)第172回	200,000,000	199,276,000	
	国庫債券 利付(20年)第173回	40,000,000	39,780,400	
小計	銘柄数:250	29,307,000,000	31,653,340,830	
	組入時価比率:98.8%		100.0%	
合計			31,653,340,830	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	4,217,163,997
コール・ローン	1,437,322,749
株式	678,290,373,902
投資証券	16,580,431,531
派生商品評価勘定	227,798,720
未収入金	556,707
未収配当金	859,276,662
差入委託証拠金	3,597,559,483
流動資産合計	705,210,483,751
資産合計	705,210,483,751
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,705,921
未払解約金	954,202,175
未払利息	1,759
その他未払費用	2,789,600
流動負債合計	969,699,455
負債合計	969,699,455
純資産の部	
元本等	
元本	230,010,875,385
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	474,229,908,911
元本等合計	704,240,784,296
純資産合計	704,240,784,296
負債純資産合計	705,210,483,751

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 8月17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	3.0618円
(10,000口当たり純資産額)	(30,618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 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17日現在	
期首	2020年 2月18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	219,238,217,195円
同期中における追加設定元本額	31,638,242,737円
同期中における一部解約元本額	20,865,584,547円
期末元本額	230,010,875,385円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	44,777,418円
バランスセレクト50	132,754,759円
バランスセレクト70	141,332,242円
野村外国株式インデックスファンド	497,885,486円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	4,478,028,595円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	5,870,776,923円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,295,395,096円
野村資産設計ファンド2015	14,967,749円
野村資産設計ファンド2020	15,209,202円
野村資産設計ファンド2025	26,926,910円

野村資産設計ファンド2030	34,926,441円
野村資産設計ファンド2035	26,963,641円
野村資産設計ファンド2040	55,463,248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)	34,075,656,396円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	1,004,415,249円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	8,108,548,501円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	5,926,747,746円
野村資産設計ファンド2045	8,551,578円
野村インデックスファンド・外国株式	5,389,157,781円
マイ・ロード	1,289,048,262円
ネクストコア	21,574,829円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	131,124,216円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,263,603,003円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	593,481,698円
野村資産設計ファンド2050	14,095,796円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,725,539円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,292,183円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,781,005円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,160,733円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	202,313,978円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	484,940,182円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,563,415円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,291,951円
インデックス・ブレンド(タイプ)	22,014,333円
インデックス・ブレンド(タイプ)	7,888,941円
インデックス・ブレンド(タイプ)	31,178,781円
野村6資産均等バランス	788,184,048円
野村つみたて外国株投信	5,460,900,902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)	3,464,517,939円
世界6資産分散ファンド	63,247,087円
野村資産設計ファンド2060	5,013,165円
野村スリーゼロ先進国株式投信	28,929,399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	703,464,455円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	1,129,461,609円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	231,306,448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)	155,972,699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)	1,067,989,503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)	2,050,656,051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)	2,432,720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)	6,431,865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)	1,050,962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)	2,537,074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)	38,950,673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)	12,843,943円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	13,593,654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)	38,225,658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)	145,485,926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)	2,849,960,364円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	42,919,316円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	51,996,466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)	344,688,386円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	15,329,034,942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)	654,229円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,057,952円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	10,672,392円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	11,120,100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)	70,840,327,011円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,819,188,805円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	9,659,014,046円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,548,552,501円
マイバランスDC30	945,079,159円
マイバランスDC50	1,974,339,966円
マイバランスDC70	1,545,371,782円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	23,958,351,438円
野村DC運用戦略ファンド	340,774,035円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	26,384,115円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	302,330,938円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	244,543,556円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	208,611,961円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	12,716,957円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	6,156,453円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	26,675,083円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	4,012,175円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,879,409円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,704,420円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	107,735,428円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	76,133,819円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	36,076,613円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	41,759,014円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,292,968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8月17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	17.23	1,740,230.00
		HALLIBURTON CO	135,000	16.63	2,245,050.00
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	58,000	13.12	760,960.00
		SCHLUMBERGER LTD	216,000	20.07	4,335,120.00
		CABOT OIL & GAS CORP	64,000	20.04	1,282,560.00
		CHENIERE ENERGY INC	36,400	54.25	1,974,700.00
		CHEVRON CORP	292,600	90.35	26,436,410.00
		CONCHO RESOURCES INC	31,000	51.26	1,589,060.00
		CONOCOPHILLIPS	167,100	40.82	6,821,022.00
		DIAMONDBACK ENERGY INC	23,100	45.51	1,051,281.00
		EOG RESOURCES INC	90,700	47.97	4,350,879.00
		EXXON MOBIL CORP	662,000	43.20	28,598,400.00
		HESS CORP	43,200	53.78	2,323,296.00
		HOLLYFRONTIER CORP	23,600	25.99	613,364.00
		KINDER MORGAN INC	314,000	14.29	4,487,060.00
		MARATHON PETROLEUM CORP	100,800	38.35	3,865,680.00
		OCCIDENTAL PETE CORP	142,000	14.64	2,078,880.00
		ONEOK INC	67,000	29.49	1,975,830.00
		PHILLIPS 66	67,600	63.66	4,303,416.00
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,100	110.73	2,890,053.00
		VALERO ENERGY CORP	62,700	54.46	3,414,642.00
		WILLIAMS COS	191,000	22.13	4,226,830.00
		AIR PRODUCTS	34,600	289.82	10,027,772.00
		ALBEMARLE CORP	16,700	92.39	1,542,913.00
		AXALTA COATING SYSTEMS LTD	36,000	23.90	860,400.00
		CELANESE CORP-SERIES A	18,000	101.48	1,826,640.00
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	35.10	1,239,030.00
		CORTEVA INC	120,000	27.87	3,344,400.00
		DOW INC	115,600	44.87	5,186,972.00
		DUPONT DE NEMOURS INC	115,500	58.16	6,717,480.00
		EASTMAN CHEMICAL CO.	20,800	73.29	1,524,432.00
		ECOLAB INC	39,500	194.71	7,691,045.00
		FMC CORP	19,600	109.61	2,148,356.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	13,600	123.17	1,675,112.00		
LINDE PLC	83,000	248.50	20,625,500.00		

LYONDELLBASELL INDU-CL A	42,100	69.01	2,905,321.00	
MOSAIC CO/THE	56,000	17.83	998,480.00	
PPG INDUSTRIES	36,800	118.98	4,378,464.00	
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	84.25	1,777,675.00	
SHERWIN-WILLIAMS	12,920	666.56	8,611,955.20	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9,700	219.33	2,127,501.00	
VULCAN MATERIALS CO	20,800	129.74	2,698,592.00	
AMCOR PLC	250,000	11.20	2,800,000.00	
AVERY DENNISON CORP	13,400	116.59	1,562,306.00	
BALL CORP	49,800	75.50	3,759,900.00	
CROWN HOLDINGS INC	21,200	76.36	1,618,832.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	59,800	37.27	2,228,746.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	14,500	99.67	1,445,215.00	
SEALED AIR CORP	22,500	41.16	926,100.00	
WESTROCK CO	38,700	30.29	1,172,223.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	225,000	13.78	3,100,500.00	
NEWMONT CORP	125,700	63.85	8,025,945.00	
NUCOR CORP	46,700	46.24	2,159,408.00	
STEEL DYNAMICS	33,400	30.95	1,033,730.00	
BOEING CO	83,500	178.08	14,869,680.00	
GENERAL DYNAMICS	38,000	156.46	5,945,480.00	
HEICO CORP	6,300	106.57	671,391.00	
HEICO CORP-CLASS A	10,500	87.35	917,175.00	
HOWMET AEROSPACE INC	57,000	17.55	1,000,350.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	166.89	1,084,785.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	34,100	182.58	6,225,978.00	
LOCKHEED MARTIN	39,620	391.42	15,508,060.40	
NORTHROP GRUMMAN CORP	24,670	342.06	8,438,620.20	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	235,600	63.64	14,993,584.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,770	332.18	1,916,678.60	
TEXTRON INC	37,900	38.49	1,458,771.00	
TRANSDIGM GROUP INC	8,090	498.79	4,035,211.10	
ALLEGION PLC	14,800	101.56	1,503,088.00	
CARRIER GLOBAL CORP	130,000	29.52	3,837,600.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	21,600	83.06	1,794,096.00	

INC			
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	118,700	40.86	4,850,082.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	277.97	1,584,429.00
MASCO CORP	42,500	57.96	2,463,300.00
OWENS CORNING INC	16,800	67.33	1,131,144.00
SMITH (A.O.) CORP	21,800	49.76	1,084,768.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	37,600	118.88	4,469,888.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	21,600	90.00	1,944,000.00
AMETEK INC	35,500	101.28	3,595,440.00
EATON CORP PLC	64,600	100.89	6,517,494.00
EMERSON ELEC	94,600	69.73	6,596,458.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,900	232.05	4,153,695.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	41.22	1,009,890.00
3M CORP	89,800	166.10	14,915,780.00
GENERAL ELEC CO	1,355,000	6.66	9,024,300.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	110,800	160.28	17,759,024.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	35,400	40.25	1,424,850.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	33,300	20.21	672,993.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,420	444.95	7,306,079.00
CATERPILLAR INC DEL	85,800	139.96	12,008,568.00
CUMMINS INC	23,500	213.51	5,017,485.00
DEERE & COMPANY	46,200	191.13	8,830,206.00
DOVER CORP	22,900	111.52	2,553,808.00
FORTIVE CORP	47,600	73.58	3,502,408.00
IDEX CORP	12,300	176.70	2,173,410.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	49,900	196.13	9,786,887.00
INGERSOLL-RAND INC	53,400	35.40	1,890,360.00
NORDSON CORP	8,700	206.67	1,798,029.00
OTIS WORLDWIDE CORP	65,000	64.07	4,164,550.00
PACCAR	53,800	88.95	4,785,510.00
PARKER HANNIFIN CORP	20,100	209.62	4,213,362.00
PENTAIR PLC	23,200	45.08	1,045,856.00
SNAP-ON INC	8,400	153.64	1,290,576.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	23,900	158.78	3,794,842.00
WABTEC CORP	28,800	69.52	2,002,176.00

XYLEM INC	27,800	79.62	2,213,436.00
AERCAP HOLDINGS NV	21,000	31.70	665,700.00
FASTENAL CO	88,300	47.99	4,237,517.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,970	351.38	2,449,118.60
HD SUPPLY HOLDINGS INC	26,800	41.92	1,123,456.00
UNITED RENTALS INC	11,300	179.33	2,026,429.00
CINTAS CORP	13,600	316.44	4,303,584.00
COPART INC	33,700	100.01	3,370,337.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	34,200	90.37	3,090,654.00
ROLLINS INC	23,900	54.73	1,308,047.00
WASTE CONNECTIONS INC	40,500	99.81	4,042,305.00
WASTE MANAGEMENT INC	66,800	111.47	7,446,196.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	20,400	95.08	1,939,632.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	27,300	86.10	2,350,530.00
FEDEX CORPORATION	39,100	208.60	8,156,260.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	109,600	160.74	17,617,104.00
XPO LOGISTICS INC	14,300	82.96	1,186,328.00
DELTA AIR LINES INC	25,200	28.95	729,540.00
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	34.90	691,020.00
AMERCO	1,170	350.70	410,319.00
CSX CORP	120,400	74.25	8,939,700.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	137.19	1,810,908.00
KANSAS CITY SOUTHERN	14,800	183.93	2,722,164.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,800	43.85	912,080.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	40,300	206.61	8,326,383.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,300	191.56	2,930,868.00
UBER TECHNOLOGIES INC	150,800	29.99	4,522,492.00
UNION PAC CORP	107,400	191.92	20,612,208.00
APTIV PLC	41,500	88.34	3,666,110.00
AUTOLIV INC	11,900	72.25	859,775.00
BORGWARNER INC	30,600	41.79	1,278,774.00
LEAR CORP	8,400	118.53	995,652.00
FORD MOTOR COMPANY	607,000	7.04	4,273,280.00
GENERAL MOTORS CO	198,000	27.86	5,516,280.00

TESLA INC	23,080	1,650.71	38,098,386.80
DR HORTON INC	53,800	71.39	3,840,782.00
GARMIN LTD	22,700	104.27	2,367,042.50
LENNAR CORP-A	43,000	74.25	3,192,750.00
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	90.26	920,652.00
NEWELL BRANDS INC	66,000	16.99	1,121,340.00
NVR INC	559	4,044.81	2,261,048.79
PULTEGROUP INC	43,000	45.07	1,938,010.00
WHIRLPOOL CORP	9,400	180.93	1,700,742.00
HASBRO INC	21,400	79.63	1,704,082.00
LULULEMON ATHLETICA INC	19,130	349.12	6,678,665.60
NIKE INC-B	194,100	106.43	20,658,063.00
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	70.66	551,148.00
V F CORP	52,000	64.24	3,340,480.00
ARAMARK	34,000	24.99	849,660.00
CARNIVAL CORP	72,000	15.47	1,113,840.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,120	1,186.53	4,888,503.60
DARDEN RESTAURANTS INC	19,800	84.07	1,664,586.00
DOMINOS PIZZA INC	5,870	398.99	2,342,071.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	43,400	86.00	3,732,400.00
LAS VEGAS SANDS CORP	53,800	48.37	2,602,306.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	42,900	96.01	4,118,829.00
MCDONALD'S CORP	116,000	207.03	24,015,480.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	19.49	662,660.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	21.81	1,548,510.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,600	60.50	1,609,300.00
STARBUCKS CORP	184,400	78.37	14,451,428.00
VAIL RESORTS INC	6,000	216.92	1,301,520.00
WYNN RESORTS LTD	15,500	84.98	1,317,190.00
YUM BRANDS INC	46,800	92.65	4,336,020.00
GENUINE PARTS CO	23,200	94.56	2,193,792.00
LKQ CORP	44,000	31.49	1,385,560.00
AMAZON.COM INC	66,030	3,148.02	207,863,760.60
BOOKING HOLDINGS INC	6,400	1,778.87	11,384,768.00
EBAY INC	124,500	56.29	7,008,105.00

EXPEDIA GROUP INC	20,500	86.73	1,777,965.00
MERCADOLIBRE INC	6,980	1,156.44	8,071,951.20
WAYFAIR INC - CLASS A	9,800	309.99	3,037,902.00
DOLLAR GENERAL CORP	39,800	198.55	7,902,290.00
DOLLAR TREE INC	37,600	98.84	3,716,384.00
TARGET CORP	78,900	136.53	10,772,217.00
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	158.66	1,729,394.00
AUTOZONE	3,670	1,196.05	4,389,503.50
BEST BUY COMPANY INC	36,000	109.49	3,941,640.00
BURLINGTON STORES INC	10,500	193.80	2,034,900.00
CARMAX INC	26,100	104.35	2,723,535.00
HOME DEPOT	170,000	280.55	47,693,500.00
LOWES COS INC	119,700	154.34	18,474,498.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,610	463.55	5,381,815.50
ROSS STORES INC	56,000	94.06	5,267,360.00
TIFFANY & CO	16,900	125.00	2,112,500.00
TJX COS INC	186,700	57.87	10,804,329.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	18,000	148.60	2,674,800.00
ULTA BEAUTY INC	8,600	225.42	1,938,612.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	69,070	336.28	23,226,859.60
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	4.27	192,150.00
KROGER CO	126,900	35.39	4,490,991.00
SYSCO CORP	75,800	59.54	4,513,132.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	116,500	41.91	4,882,515.00
WALMART INC	221,000	132.60	29,304,600.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	47,500	71.13	3,378,675.00
COCA COLA CO	637,700	48.45	30,896,565.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	32,600	42.10	1,372,460.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	25,800	176.03	4,541,574.00
KEURIG DR PEPPER INC	56,000	29.89	1,673,840.00
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	31,400	37.68	1,183,152.00
MONSTER BEVERAGE CORP	63,800	83.32	5,315,816.00
PEPSICO INC	217,400	137.56	29,905,544.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	88,400	44.59	3,941,756.00
BUNGE LIMITED	22,000	45.93	1,010,460.00

CAMPBELL SOUP CO	27,400	51.63	1,414,662.00	
CONAGRA BRANDS INC	76,900	37.78	2,905,282.00	
GENERAL MILLS	94,400	63.27	5,972,688.00	
HERSHEY CO/THE	23,500	146.07	3,432,645.00	
HORMEL FOODS CORP	45,600	52.23	2,381,688.00	
INGREDION INC	11,200	81.65	914,480.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,600	113.97	2,119,842.00	
KELLOGG CO	40,000	69.10	2,764,000.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	103,500	35.59	3,683,565.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,900	64.65	1,545,135.00	
MCCORMICK & CO INC.	19,000	201.55	3,829,450.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	224,800	56.12	12,615,776.00	
TYSON FOODS INC-CL A	46,900	63.94	2,998,786.00	
ALTRIA GROUP INC	289,800	42.54	12,328,092.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	243,100	77.71	18,891,301.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	37,700	94.26	3,553,602.00	
COLOROX CO	19,300	224.25	4,328,025.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	126,500	77.05	9,746,825.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	53,200	158.23	8,417,836.00	
PROCTER & GAMBLE CO	385,000	135.10	52,013,500.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	34,500	212.09	7,317,105.00	
ABBOTT LABORATORIES	275,900	99.99	27,587,241.00	
ABIOMED INC	7,200	307.35	2,212,920.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,800	306.96	3,622,128.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	78,900	83.50	6,588,150.00	
BECTON,DICKINSON	42,300	258.17	10,920,591.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	218,600	39.16	8,560,376.00	
DANAHER CORP	97,900	204.86	20,055,794.00	
DENTSPLY SIRONA INC	35,200	44.52	1,567,104.00	
DEXCOM INC	14,480	425.16	6,156,316.80	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	97,100	78.07	7,580,597.00	
HOLOGIC INC	40,400	66.81	2,699,124.00	
IDEXX LABORATORIES INC	13,150	379.40	4,989,110.00	
INSULET CORP	9,800	202.13	1,980,874.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	18,200	684.52	12,458,264.00	

MASIMO CORP	8,200	214.09	1,755,538.00	
MEDTRONIC PLC	209,600	100.71	21,108,816.00	
RESMED INC	22,500	176.78	3,977,550.00	
STERIS PLC	13,800	158.70	2,190,060.00	
STRYKER CORP	53,100	188.37	10,002,447.00	
TELEFLEX INC	7,070	378.47	2,675,782.90	
THE COOPER COMPANIES, INC.	7,500	303.82	2,278,650.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,200	173.15	2,458,730.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,800	272.47	3,215,146.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	31,900	137.32	4,380,508.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	23,900	103.75	2,479,625.00	
ANTHEM INC	39,600	283.23	11,215,908.00	
CARDINAL HEALTH INC	47,200	53.68	2,533,696.00	
CENTENE CORP	92,100	64.64	5,953,344.00	
CIGNA CORP	58,000	183.40	10,637,200.00	
CVS HEALTH CORP	203,500	65.67	13,363,845.00	
DAVITA INC	14,800	82.17	1,216,116.00	
HCA HEALTHCARE INC	42,200	134.43	5,672,946.00	
HENRY SCHEIN INC	23,100	67.23	1,553,013.00	
HUMANA INC	20,550	422.02	8,672,511.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,900	189.84	2,828,616.00	
MCKESSON CORP	25,600	158.67	4,061,952.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	9,700	193.76	1,879,472.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	20,500	120.01	2,460,205.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	147,900	323.70	47,875,230.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	13,200	114.16	1,506,912.00	
ABBVIE INC	276,200	95.07	26,258,334.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	34,400	102.97	3,542,168.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,500	136.14	2,382,450.00	
AMGEN INC	91,800	239.71	22,005,378.00	
BEIGENE, LTD ADR	6,300	210.72	1,327,536.00	
BIOGEN INC	27,000	289.45	7,815,150.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28,000	118.16	3,308,480.00	
EXACT SCIENCES CORP	22,600	85.33	1,928,458.00	
GILEAD SCIENCES INC	197,200	68.50	13,508,200.00	

INCYTE CORP	28,500	94.87	2,703,795.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	21,400	52.78	1,129,492.00
MODERNA INC	43,200	69.15	2,987,280.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,200	114.39	1,624,338.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	15,710	612.57	9,623,474.70
SAREPTA THERAPEUTICS INC	11,300	157.00	1,774,100.00
SEATTLE GENETICS INC	18,700	157.27	2,940,949.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	40,400	267.29	10,798,516.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	351,400	63.16	22,194,424.00
CATALENT INC	24,800	87.02	2,158,096.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	60,000	25.77	1,546,200.00
ELI LILLY & CO.	133,900	150.09	20,097,051.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,000	124.26	1,118,340.00
JOHNSON & JOHNSON	410,800	148.24	60,896,992.00
MERCK & CO INC	396,900	83.48	33,133,212.00
MYLAN NV	86,000	16.19	1,392,340.00
PERRIGO CO PLC	19,600	53.40	1,046,640.00
PFIZER INC	866,000	38.06	32,959,960.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	166,000	11.50	1,909,000.00
ZOETIS INC	74,000	157.05	11,621,700.00
BANK OF AMERICA CORP	1,229,000	26.47	32,531,630.00
CITIGROUP	327,600	52.93	17,339,868.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	70,000	25.90	1,813,000.00
COMERICA INC	23,000	41.82	961,860.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	38.46	796,122.00
FIFTH THIRD BANCORP	112,000	20.96	2,347,520.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	27,100	117.34	3,179,914.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	153,000	9.90	1,514,700.00
JPMORGAN CHASE & CO	479,200	102.41	49,074,872.00
KEYCORP	158,000	12.75	2,014,500.00
M & T BANK CORP	20,000	109.21	2,184,200.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	71,000	11.36	806,560.00
PNC FINANCIAL	67,000	111.75	7,487,250.00
REGIONS FINANCIAL CORP	150,000	11.77	1,765,500.00
SIGNATURE BANK	8,900	107.43	956,127.00

SVB FINANCIAL GROUP	8,100	250.38	2,028,078.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	208,700	39.50	8,243,650.00	
US BANCORP	212,200	37.78	8,016,916.00	
WELLS FARGO CO	605,000	25.30	15,306,500.00	
ZIONS BANCORP NA	27,500	34.49	948,475.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	216,100	210.96	45,588,456.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	62,000	21.80	1,351,600.00	
VOYA FINANCIAL INC	21,700	52.16	1,131,872.00	
AFLAC INC	108,900	38.07	4,145,823.00	
ALLEGHANY CORP	2,300	549.70	1,264,310.00	
ALLSTATE CORP	50,300	96.12	4,834,836.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	67.61	845,125.00	
AMERICAN INTL GROUP	137,800	30.99	4,270,422.00	
AON PLC	36,000	197.20	7,099,200.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	63,900	32.25	2,060,775.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,700	106.99	3,177,603.00	
ASSURANT INC	9,000	125.07	1,125,630.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	36.93	782,916.00	
BROWN & BROWN INC	38,800	45.82	1,777,816.00	
CHUBB LTD	70,800	130.14	9,213,912.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24,600	80.11	1,970,706.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	217.32	804,084.00	
EVEREST RE GROUP LTD	6,200	225.28	1,396,736.00	
FNF GROUP	45,400	33.10	1,502,740.00	
GLOBE LIFE INC	15,700	85.48	1,342,036.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	54,400	42.81	2,328,864.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	38.82	1,160,718.00	
LOEWS CORP	38,700	37.61	1,455,507.00	
MARKEL CORP	2,130	1,097.18	2,336,993.40	
MARSH & MCLENNAN COS	78,900	116.61	9,200,529.00	
METLIFE INC	120,400	39.61	4,769,044.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,400	45.22	2,007,768.00	
PROGRESSIVE CO	91,500	88.97	8,140,755.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,000	70.59	4,447,170.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10,500	95.38	1,001,490.00	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,700	179.02	1,199,434.00
TRAVELERS COS INC/THE	39,300	118.60	4,660,980.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	20,200	201.51	4,070,502.00
WR BERKLEY CORP	24,100	62.28	1,500,948.00
ACCENTURE PLC-CL A	99,300	230.25	22,863,825.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	25,800	107.90	2,783,820.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	67,700	138.96	9,407,592.00
BLACK KNIGHT INC	24,200	79.16	1,915,672.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	86.43	1,953,318.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	17,900	138.88	2,485,952.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	86,600	66.93	5,796,138.00
EPAM SYSTEMS INC	8,400	307.97	2,586,948.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	96,200	143.88	13,841,256.00
FISERV INC	90,600	99.77	9,039,162.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13,100	240.28	3,147,668.00
GARTNER INC	14,100	129.49	1,825,809.00
GLOBAL PAYMENTS INC	47,300	172.50	8,159,250.00
GODADDY INC - CLASS A	26,900	80.72	2,171,368.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	138,800	125.27	17,387,476.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,600	194.36	2,254,576.00
LEIDOS HOLDINGS INC	21,500	94.72	2,036,480.00
MASTERCARD INC	139,500	326.80	45,588,600.00
MONGODB INC	7,400	199.13	1,473,562.00
OKTA INC	18,000	198.86	3,579,480.00
PAYCHEX INC	50,500	74.31	3,752,655.00
PAYPAL HOLDINGS INC	174,400	191.46	33,390,624.00
SQUARE INC - A	55,700	141.96	7,907,172.00
TWILIO INC - A	18,600	240.06	4,465,116.00
VERISIGN INC	16,200	207.29	3,358,098.00
VISA INC-CLASS A SHARES	266,000	196.64	52,306,240.00
WESTERN UNION CO	66,000	23.64	1,560,240.00
WIX.COM LTD	7,700	277.68	2,138,136.00
ADOBE INC	75,450	447.60	33,771,420.00
ANSYS INC	13,400	313.19	4,196,746.00
AUTODESK INC.	34,200	234.35	8,014,770.00

AVALARA INC	11,800	119.27	1,407,386.00
CADENCE DESIGN SYS INC	43,100	108.00	4,654,800.00
CDK GLOBAL INC	20,000	45.50	910,000.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	18,900	123.95	2,342,655.00
CITRIX SYSTEMS INC	18,400	136.35	2,508,840.00
COUPA SOFTWARE INC	10,600	285.89	3,030,434.00
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	16,400	101.25	1,660,500.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	108.94	599,170.00
DATADOG INC - CLASS A	16,700	81.24	1,356,708.00
DOCUSIGN INC	26,300	199.71	5,252,373.00
DROPBOX INC-CLASS A	39,000	19.50	760,500.00
DYNATRACE INC	29,000	37.31	1,081,990.00
FAIR ISAAC CORP	4,630	429.67	1,989,372.10
FORTINET INC	22,800	127.60	2,909,280.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	110.63	1,504,568.00
INTUIT INC	40,600	305.54	12,404,924.00
MICROSOFT CORP	1,127,600	208.90	235,555,640.00
NORTONLIFELOCK INC	91,000	22.92	2,085,720.00
ORACLE CORPORATION	349,300	54.20	18,932,060.00
PALO ALTO NETWORKS INC	15,200	259.11	3,938,472.00
PAYCOM SOFTWARE INC	8,100	303.07	2,454,867.00
PTC INC	17,000	87.48	1,487,160.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	11,200	284.42	3,185,504.00
SALESFORCE.COM INC	131,200	193.46	25,381,952.00
SERVICENOW INC	29,610	435.73	12,901,965.30
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	48,800	28.36	1,383,968.00
SPLUNK INC	24,800	192.34	4,770,032.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	36,700	61.16	2,244,572.00
SYNOPSIS INC	23,900	196.16	4,688,224.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,480	465.60	3,017,088.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,100	335.57	2,046,977.00
VMWARE INC - CLASS A	13,000	135.85	1,766,050.00
WORKDAY INC-CLASS A	26,500	181.58	4,811,870.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	17,200	244.91	4,212,452.00

ARISTA NETWORKS INC	8,700	212.67	1,850,229.00
CISCO SYSTEMS	663,600	42.50	28,203,000.00
F5 NETWORKS INC	9,300	136.05	1,265,265.00
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	24.82	1,315,460.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,800	145.37	3,895,916.00
APPLE INC	682,880	459.63	313,872,134.40
DELL TECHNOLOGIES-C	38,300	59.91	2,294,553.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	202,000	9.67	1,953,340.00
HP INC	223,000	18.18	4,054,140.00
NETAPP INC	35,200	41.56	1,462,912.00
SEAGATE TECHNOLOGY	37,300	45.07	1,681,111.00
WESTERN DIGITAL CORP	47,600	35.74	1,701,224.00
AMPHENOL CORP-CL A	46,400	109.78	5,093,792.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	75.82	917,422.00
CDW CORPORATION	22,400	113.52	2,542,848.00
COGNEX CORP	27,800	67.49	1,876,222.00
CORNING INC	119,000	32.32	3,846,080.00
FLIR SYSTEMS INC	20,700	37.80	782,460.00
IPG PHOTONICS CORP	5,900	158.25	933,675.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	28,700	102.95	2,954,665.00
TE CONNECTIVITY LTD	52,400	94.76	4,965,424.00
TRIMBLE INC	38,800	50.38	1,954,744.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,400	286.03	2,402,652.00
ADVANCED MICRO DEVICES	182,600	81.30	14,845,380.00
ANALOG DEVICES INC	58,100	117.18	6,808,158.00
APPLIED MATERIALS	143,800	67.62	9,723,756.00
BROADCOM INC	62,160	327.82	20,377,291.20
INTEL CORP	669,300	48.89	32,722,077.00
KLA CORP	24,400	211.51	5,160,844.00
LAM RESEARCH	22,650	373.64	8,462,946.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	106,400	33.57	3,571,848.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,400	68.60	2,908,640.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	37,300	100.20	3,737,460.00
MICRON TECHNOLOGY	174,000	45.60	7,934,400.00
NVIDIA CORP	95,390	462.56	44,123,598.40

NXP SEMICONDUCTORS NV	43,200	123.04	5,315,328.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	61,000	22.04	1,344,440.00
QORVO INC	17,700	131.68	2,330,736.00
QUALCOMM INC	178,600	113.74	20,313,964.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	27,200	146.12	3,974,464.00
TERADYNE INC	25,400	90.06	2,287,524.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	145,300	137.35	19,956,955.00
XILINX INC	38,200	105.31	4,022,842.00
AT & T INC	1,122,000	30.01	33,671,220.00
CENTURYLINK INC	147,000	11.07	1,627,290.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	22.20	532,800.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	21.54	1,378,560.00
VERIZON COMMUNICATIONS	644,500	58.79	37,890,155.00
T-MOBILE US INC	86,100	115.49	9,943,689.00
ALLIANT ENERGY CORP	37,600	53.77	2,021,752.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	77,200	82.95	6,403,740.00
DUKE ENERGY CORP	114,200	82.15	9,381,530.00
EDISON INTERNATIONAL	58,000	52.69	3,056,020.00
ENTERGY CORP	31,300	100.93	3,159,109.00
EVERGY INC	35,900	53.57	1,923,163.00
EVERSOURCE ENERGY	52,100	87.15	4,540,515.00
EXELON CORPORATION	150,400	37.93	5,704,672.00
FIRSTENERGY CORP	86,600	29.33	2,539,978.00
NEXTERA ENERGY INC	76,400	280.50	21,430,200.00
NRG ENERGY INC	40,500	34.94	1,415,070.00
OGE ENERGY CORP	32,500	32.62	1,060,150.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,000	78.00	1,326,000.00
PPL CORPORATION	121,800	29.05	3,538,290.00
SOUTHERN CO.	165,200	53.56	8,848,112.00
XCEL ENERGY INC	81,000	70.73	5,729,130.00
ATMOS ENERGY CORP	18,400	104.50	1,922,800.00
UGI CORP	30,900	34.60	1,069,140.00
AMEREN CORPORATION	39,100	81.27	3,177,657.00
CENTERPOINT ENERGY INC	75,400	20.54	1,548,716.00
CMS ENERGY CORP	45,600	60.88	2,776,128.00

CONSOLIDATED EDISON INC	52,500	73.53	3,860,325.00
DOMINION ENERGY INC	130,600	78.85	10,297,810.00
DTE ENERGY COMPANY	30,500	117.71	3,590,155.00
NISOURCE INC	58,200	24.12	1,403,784.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	77,700	55.17	4,286,709.00
SEMPRA ENERGY	45,100	131.89	5,948,239.00
WEC ENERGY GROUP INC	49,800	91.21	4,542,258.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,300	145.31	4,112,273.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	34,900	45.35	1,582,715.00
ALLY FINANCIAL INC	57,400	22.64	1,299,536.00
AMERICAN EXPRESS CO	107,000	100.41	10,743,870.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	72,500	69.47	5,036,575.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	49,600	54.30	2,693,280.00
SYNCHRONY FINANCIAL	88,000	24.93	2,193,840.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,000	159.66	3,033,540.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,500	47.87	1,316,425.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	127,100	37.53	4,770,063.00
BLACKROCK INC	23,930	588.46	14,081,847.80
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	106,900	52.74	5,637,906.00
CARLYLE GROUP INC/THE	22,000	27.14	597,080.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	88.26	1,579,854.00
CME GROUP INC	56,500	171.44	9,686,360.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	54.36	1,902,600.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,920	354.59	2,099,172.80
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	21.95	952,630.00
GOLDMAN SACHS GROUP	51,200	207.97	10,648,064.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	86,700	102.49	8,885,883.00
INVESCO LTD	58,000	10.68	619,440.00
KKR & CO INC-A	78,400	36.63	2,871,792.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5,820	496.50	2,889,630.00
MOODYS CORP	26,100	281.05	7,335,405.00
MORGAN STANLEY	186,800	52.30	9,769,640.00
MSCI INC	13,130	356.41	4,679,663.30
NASDAQ INC	18,400	129.24	2,378,016.00
NORTHERN TRUST CORP	32,100	83.42	2,677,782.00

RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,600	75.98	1,489,208.00
S&P GLOBAL INC	38,040	352.27	13,400,350.80
SCHWAB(CHARLES)CORP	178,800	35.05	6,266,940.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	53.23	1,016,693.00
STATE STREET CORP	56,200	70.53	3,963,786.00
T ROWE PRICE GROUP INC	36,600	136.94	5,012,004.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	41,200	37.95	1,563,540.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	13,000	55.28	718,640.00
AES CORP	101,000	17.57	1,774,570.00
VISTRA CORP	70,000	19.05	1,333,500.00
CERNER CORP	49,900	72.91	3,638,209.00
TELADOC HEALTH INC	11,200	187.50	2,100,000.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	20,700	258.34	5,347,638.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	49,000	97.37	4,771,130.00
AVANTOR INC	68,000	20.68	1,406,240.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	506.37	1,843,186.80
ILLUMINA INC	22,880	347.56	7,952,172.80
IQVIA HOLDINGS INC	30,600	161.23	4,933,638.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,700	961.04	3,555,848.00
PERKINELMER INC	17,400	118.25	2,057,550.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	62,100	413.76	25,694,496.00
WATERS CORP	9,500	215.40	2,046,300.00
COSTAR GROUP INC	6,180	830.37	5,131,686.60
EQUIFAX INC	18,500	164.74	3,047,690.00
IHS MARKIT LTD	59,000	82.75	4,882,250.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	54,000	15.89	858,060.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	56.63	968,373.00
TRUNSION	29,000	87.71	2,543,590.00
VERISK ANALYTICS INC	24,100	189.15	4,558,515.00
CBRE GROUP INC	51,400	46.02	2,365,428.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	3.67	675,280.00
JONES LANG LASALLE INC	7,600	100.35	762,660.00
ALTICE USA INC-A	53,000	27.22	1,442,660.00
CABLE ONE INC	730	1,870.17	1,365,224.10
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	22,940	604.99	13,878,470.60
COMCAST CORP-CL A	710,900	43.77	31,116,093.00

	DISCOVERY INC - A	24,500	22.62	554,190.00	
	DISCOVERY INC - C	57,000	20.76	1,183,320.00	
	DISH NETWORK CORP-A	38,400	34.67	1,331,328.00	
	FOX CORP-CLASS A	52,000	25.74	1,338,480.00	
	FOX CORP-CLASS B	25,400	25.82	655,828.00	
	INTERPUBRIC GROUP	58,000	18.86	1,093,880.00	
	LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	139.04	556,160.00	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C	16,700	140.59	2,347,853.00	
	LIBERTY SIRIUS GROUP-C	25,800	35.95	927,510.00	
	LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	36.04	464,916.00	
	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	15.33	843,150.00	
	OMNICOM GROUP	34,500	54.85	1,892,325.00	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	5.98	1,046,500.00	
	VIACOMCBS INC-CLASS B	88,000	27.46	2,416,480.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	120,900	80.40	9,720,360.00	
	DISNEY (WALT) CO	282,500	130.53	36,874,725.00	
	ELECTRONIC ARTS	44,800	140.43	6,291,264.00	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	34,000	37.52	1,275,680.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	23,000	51.48	1,184,040.00	
	NETFLIX INC	68,670	482.68	33,145,635.60	
	ROKU INC	14,200	146.85	2,085,270.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	18,100	173.41	3,138,721.00	
	ALPHABET INC-CL A	46,770	1,504.63	70,371,545.10	
	ALPHABET INC-CL C	47,860	1,507.73	72,159,957.80	
	FACEBOOK INC-A	375,300	261.24	98,043,372.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	12,600	123.41	1,554,966.00	
	MATCH GROUP INC	35,595	118.80	4,228,686.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	58,000	34.68	2,011,440.00	
	SNAP INC-A	139,000	21.69	3,014,910.00	
	TWITTER INC	124,100	37.90	4,703,390.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	20,200	76.64	1,548,128.00	
小計	銘柄数：589			4,546,798,550.39	
				(484,461,385,544)	
	組入時価比率：68.8%			71.5%	
カナダドル	CAMECO CORP	69,000	13.84	954,960.00	

CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	187,000	27.03	5,054,610.00	
CENOVUS ENERGY INC	156,000	6.81	1,062,360.00	
ENBRIDGE INC	315,500	43.53	13,733,715.00	
IMPERIAL OIL	37,500	22.63	848,625.00	
INTER PIPELINE LTD	60,000	13.99	839,400.00	
KEYERA CORP	34,000	24.35	827,900.00	
PARKLAND CORP	21,700	40.53	879,501.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	88,000	35.29	3,105,520.00	
SUNCOR ENERGY INC	244,000	22.57	5,507,080.00	
TC ENERGY CORP	146,800	64.83	9,517,044.00	
NUTRIEN LTD	90,000	50.93	4,583,700.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	50.18	1,239,446.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	37,700	104.78	3,950,206.00	
B2GOLD CORP	153,000	8.90	1,361,700.00	
BARRICK GOLD	277,000	35.79	9,913,830.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	93,000	12.10	1,125,300.00	
FRANCO-NEVADA CORP	29,500	195.62	5,770,790.00	
KINROSS GOLD CORP	198,000	11.57	2,290,860.00	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	44,100	66.13	2,916,333.00	
LUNDIN MINING CORP	95,000	7.70	731,500.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	31,000	44.47	1,378,570.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	82,000	15.00	1,230,000.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	68,600	67.01	4,596,886.00	
YAMANA GOLD INC	138,000	7.80	1,076,400.00	
CAE INC	41,000	21.14	866,740.00	
WSP GLOBAL INC	17,700	86.79	1,536,183.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	16,000	82.50	1,320,000.00	
AIR CANADA	20,400	16.85	343,740.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	110,700	135.90	15,044,130.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,300	389.28	8,291,664.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,100	69.72	3,144,372.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	26.00	826,800.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	43,100	72.11	3,107,941.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	129.19	1,111,034.00	
	46,600	49.05	2,285,730.00	

DOLLARAMA INC			
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	134,200	45.43	6,096,706.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	35.77	930,020.00
LOBLAW COMPANIES	28,500	70.79	2,017,515.00
METRO INC	39,600	60.33	2,389,068.00
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	99.58	1,224,834.00
SAPUTO INC	41,000	35.34	1,448,940.00
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	23.14	1,180,140.00
CANOPY GROWTH CORP	33,000	22.82	753,060.00
CRONOS GROUP INC	25,000	7.49	187,250.00
BANK OF MONTREAL	99,100	78.03	7,732,773.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	189,900	57.68	10,953,432.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	69,600	97.17	6,763,032.00
NATIONAL BANK OF CANADA	52,300	66.41	3,473,243.00
ROYAL BANK OF CANADA	221,400	97.46	21,577,644.00
TORONTO DOMINION BANK	282,600	63.43	17,925,318.00
ONEX CORPORATION	13,200	65.23	861,036.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,140	414.27	1,715,077.80
GREAT-WEST LIFE CO INC	42,000	27.06	1,136,520.00
IA FINANCIAL CORP INC	18,300	49.17	899,811.00
INTACT FINANCIAL CORP	22,700	142.33	3,230,891.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	303,000	19.98	6,053,940.00
POWER CORPORATION OF CANADA	86,950	26.11	2,270,264.50
SUN LIFE FINANCIAL INC	92,300	56.71	5,234,333.00
CGI INC	38,400	91.65	3,519,360.00
SHOPIFY INC - CLASS A	16,400	1,308.36	21,457,104.00
BLACKBERRY LTD	71,000	6.37	452,270.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,200	1,518.58	4,859,456.00
OPEN TEXT CORP	41,700	57.79	2,409,843.00
BCE INC	25,600	56.76	1,453,056.00
TELUS CORP	58,600	24.24	1,420,464.00
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	54,500	55.79	3,040,555.00
EMERA INC	37,900	53.35	2,021,965.00
FORTIS INC	71,200	53.38	3,800,656.00
HYDRO ONE LTD	55,000	27.53	1,514,150.00

	ALTAGAS LTD	42,000	18.00	756,000.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	85,000	18.06	1,535,100.00	
	ATCO LTD CL1	13,000	40.59	527,670.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	32.89	667,667.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	209,800	44.59	9,354,982.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	19.20	645,120.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	33.15	497,250.00	
	TMX GROUP LTD	9,500	136.50	1,296,750.00	
	THOMSON REUTERS CORP	27,800	99.64	2,769,992.00	
	QUEBECOR INC-CL B	27,000	33.12	894,240.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,000	24.79	1,908,830.00	
小計	銘柄数：81			295,231,898.30	
				(23,718,930,709)	
	組入時価比率：3.4%			3.5%	
ユ-ロ	TENARIS SA	71,000	5.16	366,360.00	
	ENI SPA	403,000	8.17	3,296,137.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	9.52	771,768.00	
	NESTE OYJ	66,800	41.25	2,755,500.00	
	OMV AG	25,200	28.66	722,232.00	
	REPSOL SA	232,733	6.98	1,626,338.20	
	TOTAL SE	384,200	33.50	12,870,700.00	
	VOPAK	11,400	47.42	540,588.00	
	AIR LIQUIDE SA	73,800	139.95	10,328,310.00	
	AKZO NOBEL	30,800	83.42	2,569,336.00	
	ARKEMA	10,200	92.84	946,968.00	
	BASF SE	144,400	50.30	7,263,320.00	
	COVESTRO AG	26,900	37.40	1,006,060.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	24.82	819,060.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	37.82	397,110.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	27,300	130.55	3,564,015.00	
	LANXESS	12,000	48.07	576,840.00	
	SOLVAY SA	11,400	73.50	837,900.00	
	SYMRISE AG	19,700	112.90	2,224,130.00	
	UMICORE	31,000	38.76	1,201,560.00	
	CRH PLC	121,400	33.28	4,040,192.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	22,600	51.50	1,163,900.00	

SMURFIT KAPPA GROUP PLC	35,300	30.38	1,072,414.00
ARCELORMITTAL	108,000	10.06	1,086,696.00
THYSSENKRUPP AG	62,000	6.09	377,828.00
VOESTALPINE AG	20,000	20.96	419,200.00
STORA ENSO OYJ-R	86,000	11.38	978,680.00
UPM-KYMMENE OYJ	83,200	23.05	1,917,760.00
AIRBUS SE	91,800	72.11	6,619,698.00
DASSAULT AVIATION SA	330	797.00	263,010.00
LEONARDO SPA	64,000	5.98	383,232.00
MTU AERO ENGINES AG	8,400	150.80	1,266,720.00
SAFRAN SA	50,000	101.50	5,075,000.00
THALES SA	16,300	69.30	1,129,590.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	79,000	33.82	2,671,780.00
KINGSPAN GROUP PLC	24,500	64.45	1,579,025.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	42,918	21.27	912,865.86
BOUYGUES	34,800	32.74	1,139,352.00
EIFFAGE SA	12,100	79.22	958,562.00
FERROVIAL SA	78,084	22.58	1,763,136.72
HOCHTIEF AG	3,800	76.20	289,560.00
VINCI	80,800	80.38	6,494,704.00
LEGRAND SA	40,900	69.90	2,858,910.00
PRYSMIAN SPA	37,000	22.54	833,980.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	85,800	102.55	8,798,790.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	22.54	856,520.00
SIEMENS AG	118,900	116.22	13,818,558.00
ALSTOM	30,300	47.70	1,445,310.00
ANDRITZ AG	11,700	29.16	341,172.00
CNH INDUSTRIAL NV	154,000	6.52	1,005,312.00
GEA GROUP AG	24,200	30.29	733,018.00
KION GROUP AG	9,900	68.42	677,358.00
KNORR-BREMSE AG	7,100	100.06	710,426.00
KONE OYJ	54,000	70.58	3,811,320.00
WARTSILA OYJ	63,000	7.16	451,458.00
BRENNTAG AG	23,800	52.80	1,256,640.00
DEUTSCHE POST AG-REG	153,500	37.65	5,779,275.00

DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	42,000	8.62	362,292.00
ADP	4,700	88.00	413,600.00
AENA SME SA	10,700	120.00	1,284,000.00
ATLANTIA SPA	79,000	14.22	1,123,775.00
FRAPORT AG	6,300	36.54	230,202.00
GETLINK	72,000	13.21	951,120.00
CONTINENTAL AG	17,500	92.80	1,624,000.00
FAURECIA	10,500	36.93	387,765.00
MICHELIN (CGDE)	26,700	96.30	2,571,210.00
PIRELLI & C. SPA	53,000	3.71	197,107.00
VALEO SA	37,300	25.30	943,690.00
BAYER MOTOREN WERK	52,100	58.22	3,033,262.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	46.24	471,648.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	132,300	42.26	5,591,659.50
FERRARI NV	20,000	164.10	3,282,000.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	170,000	9.69	1,647,300.00
PEUGEOT CITROEN	88,000	15.09	1,328,360.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25,400	52.20	1,325,880.00
RENAULT SA	28,100	24.44	686,764.00
VOLKSWAGEN AG	5,100	150.60	768,060.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	28,900	138.98	4,016,522.00
SEB SA	3,800	145.20	551,760.00
ADIDAS AG	29,800	265.90	7,923,820.00
ESSILORLUXOTTICA	44,100	109.95	4,848,795.00
HERMES INTERNATIONAL	5,010	702.00	3,517,020.00
KERING SA	11,770	496.60	5,844,982.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	43,400	386.05	16,754,570.00
MONCLER SPA	28,100	32.88	923,928.00
PUMA SE	12,600	69.48	875,448.00
ACCOR SA	32,000	24.21	774,720.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	24,500	133.45	3,269,525.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	30.79	474,166.00
SODEXO	13,200	63.70	840,840.00
DELIVERY HERO SE	19,500	99.26	1,935,570.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	18,900	99.00	1,871,100.00

PROSUS NV	75,400	79.36	5,983,744.00
ZALANDO SE	23,100	66.24	1,530,144.00
INDITEX SA	169,000	23.68	4,001,920.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	95,000	13.75	1,306,250.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	24.35	202,105.00
COLRUYT SA	8,700	52.04	452,748.00
JERONIMO MARTINS	38,000	14.14	537,320.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	171,000	25.96	4,439,160.00
METRO AG	25,000	8.45	211,400.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	120,100	47.77	5,737,177.00
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	8.57	779,961.00
HEINEKEN HOLDING NV	17,500	69.40	1,214,500.00
HEINEKEN NV	40,400	77.90	3,147,160.00
PERNOD RICARD SA	33,500	142.85	4,785,475.00
REMY COINTREAU	4,000	134.00	536,000.00
DANONE	97,000	56.12	5,443,640.00
KERRY GROUP PLC-A	24,500	109.10	2,672,950.00
HENKEL AG & CO KGAA	16,300	74.30	1,211,090.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	27,400	86.22	2,362,428.00
BEIERSDORF AG	16,000	95.66	1,530,560.00
LOREAL-ORD	39,190	278.50	10,914,415.00
UNILEVER NV	226,900	49.50	11,231,550.00
BIOMERIEUX	6,900	138.00	952,200.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	91.85	551,100.00
DIASORIN SPA	4,000	156.10	624,400.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	142,200	44.25	6,292,350.00
SARTORIUS AG-VORZUG	5,390	344.60	1,857,394.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,900	40.92	977,988.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	33,300	72.70	2,420,910.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	67,300	38.77	2,609,221.00
ORPEA	8,700	107.25	933,075.00
GALAPAGOS NV	7,000	157.95	1,105,650.00
GRIFOLS SA	46,800	24.50	1,146,600.00
BAYER AG-REG	152,400	56.96	8,680,704.00
IPSEN	5,500	86.40	475,200.00

MERCK KGAA	20,000	114.40	2,288,000.00
ORION OYJ	16,500	39.11	645,315.00
RECORDATI SPA	16,800	45.07	757,176.00
SANOFI	176,300	85.46	15,066,598.00
UCB SA	19,300	102.40	1,976,320.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	8.23	576,100.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,056,000	2.52	2,668,512.00
BANCO SANTANDER SA	2,610,000	1.92	5,029,992.00
BANKINTER S.A.	94,000	4.69	440,954.00
BNP PARIBAS	176,000	36.66	6,452,160.00
CAIXABANK	530,000	2.01	1,065,830.00
COMMERZBANK AG	158,000	4.78	755,714.00
CREDIT AGRICOLE SA	184,000	8.78	1,616,992.00
ERSTE GROUP BANK AG	42,000	20.70	869,400.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	91,000	12.79	1,164,345.00
ING GROEP NV	600,000	6.94	4,165,800.00
INTESA SANPAOLO	2,590,000	1.85	4,795,644.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	38,100	50.44	1,921,764.00
MEDIOBANCA S.P.A.	89,000	7.13	634,926.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	15.90	319,590.00
SOCIETE GENERALE	127,000	14.06	1,786,382.00
UNICREDIT SPA	337,000	8.26	2,783,620.00
EURAZEO SE	5,953	44.06	262,289.18
EXOR NV	17,200	51.32	882,704.00
GROUPE BRUXELLES LAM	17,794	77.72	1,382,949.68
SOFINA SA	2,300	243.00	558,900.00
WENDEL	4,300	84.70	364,210.00
AEGON NV	293,000	2.48	728,691.00
AGEAS	28,900	37.86	1,094,154.00
ALLIANZ SE-REG	65,500	182.02	11,922,310.00
ASSICURAZIONI GENERALI	175,000	13.11	2,294,250.00
AXA	300,000	17.55	5,265,600.00
CNP ASSURANCES	28,000	11.42	319,760.00
HANNOVER RUECK SE	9,600	142.80	1,370,880.00

MAPFRE SA	163,000	1.64	267,320.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	22,800	234.80	5,353,440.00
NN GROUP NV	47,000	31.86	1,497,420.00
POSTE ITALIANE SPA	88,000	8.01	704,880.00
SAMPO OYJ-A SHS	72,100	32.20	2,321,620.00
SCOR SE	23,200	21.94	509,008.00
ADYEN NV	2,850	1,415.50	4,034,175.00
AMADEUS IT GROUP SA	67,000	46.30	3,102,100.00
ATOS SE	15,300	71.76	1,097,928.00
CAPGEMINI SA	24,600	111.35	2,739,210.00
EDENRED	38,200	43.34	1,655,588.00
NEXI SPA	60,000	14.81	888,600.00
WORLDLINE SA	20,800	72.24	1,502,592.00
DASSAULT SYSTEMES SA	20,900	150.75	3,150,675.00
NEMETSCHEK SE	9,200	61.85	569,020.00
SAP SE	162,600	135.24	21,990,024.00
TEAMVIEWER AG	20,600	44.05	907,430.00
NOKIA OYJ	878,000	4.21	3,697,258.00
INGENICO GROUP	9,500	134.85	1,281,075.00
ASML HOLDING NV	66,560	314.00	20,899,840.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	199,000	21.74	4,327,255.00
STMICROELECTRONICS NV	101,000	24.73	2,497,730.00
ALTICE EUROPE N.V.	99,000	4.06	402,039.00
CELLNEX TELECOM SA	48,505	53.50	2,595,017.50
DEUTSCHE TELEKOM-REG	519,000	15.34	7,961,460.00
ELISA OYJ	22,100	50.74	1,121,354.00
ILIAD SA	2,400	168.35	404,040.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	38,000	8.50	323,190.00
KONINKLIJKE KPN NV	560,000	2.20	1,233,120.00
ORANGE SA	310,000	9.90	3,070,860.00
PROXIMUS	26,000	17.47	454,350.00
TELECOM ITALIA SPA	1,170,000	0.37	442,962.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.36	323,840.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.40	360,000.00
TELEFONICA SA	762,500	3.63	2,768,637.50

UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	42.90	720,720.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	94,000	8.90	836,788.00	
ELIA GROUP SA/NV	4,800	91.00	436,800.00	
ENDESA S.A.	50,000	23.96	1,198,000.00	
ENEL SPA	1,268,000	7.88	9,998,180.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	423,459	4.35	1,842,470.10	
FORTUM OYJ	72,000	17.68	1,272,960.00	
IBERDROLA SA	926,000	10.97	10,158,220.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	16.51	1,155,700.00	
TERNA SPA	222,000	6.30	1,399,932.00	
VERBUND AG	11,000	45.40	499,400.00	
ENAGAS SA	39,000	21.61	842,790.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	49,000	16.37	802,130.00	
SNAM SPA	320,000	4.44	1,422,720.00	
E.ON SE	355,000	9.98	3,545,740.00	
ENGIE	290,000	11.75	3,407,500.00	
RWE AG	93,100	34.28	3,191,468.00	
SUEZ	52,000	11.75	611,000.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	87,000	19.99	1,739,565.00	
AMUNDI SA	10,000	65.05	650,500.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	314,000	8.06	2,533,666.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	29,400	154.60	4,545,240.00	
NATIXIS	158,000	2.48	391,840.00	
UNIPER SE	31,100	28.52	886,972.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,950	655.20	1,277,640.00	
QIAGEN N.V. -TEND	35,400	40.00	1,416,000.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	285.40	1,170,140.00	
BUREAU VERITAS SA	47,000	19.17	901,225.00	
RANDSTAD NV	18,400	44.44	817,696.00	
TELEPERFORMANCE	9,000	259.80	2,338,200.00	
WOLTERS KLUWER	42,000	69.54	2,920,680.00	
AROUNDTOWN SA	185,000	5.10	944,240.00	
DEUTSCHE WOHNEN SE	52,500	43.40	2,278,500.00	
LEG IMMOBILIEN AG	11,000	124.48	1,369,280.00	
VONOVIA SE	79,800	58.32	4,653,936.00	

	JC DECAUX SA	15,000	15.70	235,500.00	
	PUBLICIS GROUPE	32,400	29.53	956,772.00	
	SES FDR	56,000	6.27	351,568.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	33.90	227,130.00	
	BOLLORE	138,000	3.11	429,180.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	69.08	994,752.00	
	VIVENDI SA	130,000	23.94	3,112,200.00	
	SCOUT24 AG	17,100	76.80	1,313,280.00	
小計	銘柄数：240			593,651,244.24	
				(74,918,787,023)	
	組入時価比率：10.6%			11.0%	
英債券	BP PLC	3,158,000	2.92	9,241,887.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	641,000	11.71	7,508,674.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	577,000	11.31	6,528,178.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	19,300	59.54	1,149,122.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	23.37	705,774.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	191,000	18.79	3,589,272.00	
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	11.05	651,950.00	
	BHP GROUP PLC	328,000	18.16	5,956,480.00	
	EVRAZ PLC	76,000	3.46	262,960.00	
	GLENCORE PLC	1,590,000	1.70	2,711,268.00	
	RIO TINTO PLC-REG	175,800	47.05	8,272,269.00	
	MONDI PLC	75,000	15.29	1,146,750.00	
	BAE SYSTEMS PLC	502,000	5.34	2,680,680.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	277,000	2.57	712,167.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	730,000	1.02	750,075.00	
	DCC PLC	16,000	68.56	1,096,960.00	
	SMITHS GROUP PLC	61,000	14.20	866,505.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,600	106.65	1,237,140.00	
	ASHTAD GROUP PLC	69,200	26.90	1,861,480.00	
	BUNZLE	50,000	23.84	1,192,000.00	
	FERGUSON PLC	34,600	71.00	2,456,600.00	
	RENTOKIL INTIAL PLC	285,000	5.29	1,509,360.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	159,000	5.11	813,762.00	
	PERSIMMON PLC	48,000	25.34	1,216,320.00	
		500,000	1.20	601,250.00	

TAYLOR WIMPEY PLC				
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	19,500	45.95	896,025.00	
BURBERRY GROUP PLC	66,000	13.99	923,670.00	
COMPASS GROUP PLC	277,000	11.95	3,310,150.00	
GVC HOLDINGS PLC	87,000	7.69	669,726.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	28,500	41.48	1,182,180.00	
WHITBREAD PLC	31,650	24.44	773,526.00	
OCADO GROUP PLC	72,000	23.31	1,678,320.00	
NEXT PLC	19,900	59.50	1,184,050.00	
JD SPORTS FASHION PLC	76,000	6.93	526,984.00	
KINGFISHER PLC	308,000	2.68	826,056.00	
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	1.95	722,610.00	
SAINSBURY	299,000	1.89	567,651.50	
TESCO PLC	1,520,000	2.28	3,465,600.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	21.09	717,060.00	
DIAGEO PLC	366,900	26.03	9,550,407.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	54,100	19.60	1,060,360.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	357,700	25.26	9,035,502.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	149,000	12.74	1,899,005.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	110,700	74.38	8,233,866.00	
UNILEVER PLC	183,200	45.41	8,319,112.00	
SMITH & NEPHEW PLC	137,000	15.66	2,146,105.00	
NMC HEALTH PLC	13,300	0.24	3,192.00	
ASTRAZENECA PLC	205,200	83.81	17,197,812.00	
GLAXOSMITHKLINE PLC	780,000	15.35	11,979,240.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	24,900	23.40	582,660.00	
BARCLAYS PLC	2,740,000	1.09	2,992,080.00	
HSBC HOLDINGS PLC	3,156,000	3.41	10,771,428.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,050,000	0.28	3,198,975.00	
NATWEST GROUP PLC	770,000	1.15	891,275.00	
STANDARD CHARTERED PLC	438,000	4.21	1,847,922.00	
M&G PLC	440,000	1.79	790,680.00	
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	26.88	827,904.00	
AVIVA PLC	604,000	2.88	1,744,352.00	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	3.13	687,441.00	

	LEGAL & GENERAL	940,000	2.26	2,125,340.00	
	PRUDENTIAL PLC	410,000	12.56	5,151,650.00	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	162,000	4.48	726,084.00	
	AVEVA GROUP PLC	11,200	43.64	488,768.00	
	SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	7.40	1,296,400.00	
	HALMA PLC	59,000	22.43	1,323,370.00	
	BT GROUP PLC	1,370,000	1.08	1,480,285.00	
	VODAFONE GROUP PLC	4,190,000	1.18	4,972,692.00	
	SSE PLC	165,000	13.02	2,148,300.00	
	NATIONAL GRID PLC	547,000	8.91	4,878,146.00	
	SEVERN TRENT PLC	37,000	25.08	927,960.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	106,000	8.94	948,064.00	
	3I GROUP PLC	155,000	9.22	1,430,340.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	52,000	17.70	920,660.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	49,300	86.36	4,257,548.00	
	SCHRODERS PLC	19,700	30.25	595,925.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	81,000	10.04	813,645.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.66	974,292.00	
	EXPERIAN PLC	140,000	27.74	3,883,600.00	
	INTERTEK GROUP PLC	25,600	58.46	1,496,576.00	
	RELX PLC	299,000	17.22	5,148,780.00	
	INFORMA PLC	248,000	4.12	1,022,008.00	
	ITV PLC	640,000	0.62	398,592.00	
	PEARSON	126,000	6.10	768,852.00	
	WPP PLC	200,000	6.25	1,250,000.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	143,000	5.55	794,794.00	
小計	銘柄数：85			226,144,480.50	
				(31,560,723,698)	
	組入時価比率：4.5%			4.7%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	32,000	18.17	581,600.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	795.00	969,900.00	
	GIVAUDAN-REG	1,458	3,747.00	5,463,126.00	
	SIKA AG-REG	22,000	207.40	4,562,800.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	81,200	43.97	3,570,364.00	
	GEBERIT AG-REG	5,670	517.00	2,931,390.00	
		286,000	23.85	6,821,100.00	

ABB LTD				
SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	232.60	697,800.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,100	235.30	1,435,330.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	165.15	1,387,260.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	81,400	59.90	4,875,860.00	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	202.60	952,220.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	38.50	284,900.00	
BARRY CALLEBAUT AG	460	1,947.00	895,620.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	177	7,560.00	1,338,120.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	16	80,500.00	1,288,000.00	
NESTLE SA-REG	464,000	108.70	50,436,800.00	
ALCON INC	76,500	55.82	4,270,230.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	8,858	216.20	1,915,099.60	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,600	922.80	1,476,480.00	
NOVARTIS AG-REG	336,100	77.25	25,963,725.00	
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	109,480	310.70	34,015,436.00	
VIFOR PHARMA AG	7,600	130.95	995,220.00	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	5,400	99.00	534,600.00	
BALOISE HOLDING AG	7,400	144.40	1,068,560.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,810	353.70	1,701,297.00	
SWISS RE LTD	46,200	73.08	3,376,296.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	23,520	344.10	8,093,232.00	
TEMENOS AG-REG	10,400	136.35	1,418,040.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	24,900	67.00	1,668,300.00	
SWISSCOM AG-REG	4,030	505.00	2,035,150.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	385,000	10.43	4,015,550.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	35,800	42.94	1,537,252.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,990	905.00	2,705,950.00	
UBS GROUP AG	569,000	11.21	6,381,335.00	
LONZA AG-REG	11,570	555.40	6,425,978.00	
ADECCO GROUP AG-REG	24,900	47.25	1,176,525.00	
SGS SA-REG	920	2,360.00	2,171,200.00	
SWISS PRIME SITE-REG	11,400	85.15	970,710.00	
小計銘柄数：39			202,408,355.60	
			(23,718,211,109)	

	組入時価比率：3.4%			3.5%
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	28,800	224.10	6,454,080.00
	BOLIDEN AB	44,000	243.80	10,727,200.00
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	100,000	109.15	10,915,000.00
	ASSA ABLOY AB-B	159,000	195.35	31,060,650.00
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	51,000	234.80	11,974,800.00
	SKANSKA AB-B SHS	51,000	182.95	9,330,450.00
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	189.40	4,924,400.00
	ALFA LAVAL AB	51,000	222.30	11,337,300.00
	ATLAS COPCO AB-A	103,800	392.60	40,751,880.00
	ATLAS COPCO AB-B	62,700	341.60	21,418,320.00
	EPIROC AB - A	103,000	127.90	13,173,700.00
	EPIROC AB - B	58,000	123.20	7,145,600.00
	SANDVIK AB	178,000	171.75	30,571,500.00
	SKF AB-B SHARES	58,000	170.95	9,915,100.00
	VOLVO AB-B SHS	234,000	159.25	37,264,500.00
	SECURITAS AB-B SHS	45,000	129.30	5,818,500.00
	ELECTROLUX AB-B	34,000	178.50	6,069,000.00
	HUSQVARNA AB-B SHS	58,000	85.96	4,985,680.00
	EVOLUTION GAMING GROUP	21,000	607.20	12,751,200.00
	HENNES&MAURITZ AB-B	127,000	143.80	18,262,600.00
	ICA GRUPPEN AB	13,800	427.40	5,898,120.00
	SWEDISH MATCH AB	26,000	675.00	17,550,000.00
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	92,700	290.00	26,883,000.00
	NORDEA BANK ABP	515,000	69.79	35,941,850.00
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	250,000	85.72	21,430,000.00
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	243,000	87.68	21,306,240.00
	SWEDBANK AB	138,000	146.20	20,175,600.00
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	226.40	5,660,000.00
	INVESTOR AB-B SHS	71,500	536.20	38,338,300.00
	KINNEVIK AB - B	39,000	321.60	12,542,400.00
LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	429.40	5,410,440.00	
ERICSSON LM-B	463,000	100.55	46,554,650.00	
HEXAGON AB-B SHS	42,300	588.60	24,897,780.00	
TELIA CO AB	381,000	34.11	12,995,910.00	

	TELE 2 AB-B SHS	78,000	123.25	9,613,500.00	
	EQT AB	35,000	207.00	7,245,000.00	
小計	銘柄数：36			617,294,250.00	
				(7,574,200,447)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	158,000	145.70	23,020,600.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	386.00	11,425,600.00	
	NORSK HYDRO	218,000	27.97	6,097,460.00	
	MOWI ASA	69,000	183.30	12,647,700.00	
	ORKLA ASA	115,000	88.96	10,230,400.00	
	DNB ASA	145,000	145.00	21,025,000.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	188.20	5,834,200.00	
	TELENOR ASA	116,000	147.00	17,052,000.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	322.60	4,161,540.00	
小計	銘柄数：9			111,494,500.00	
				(1,336,819,055)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	16,700	710.80	11,870,360.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	361.90	12,196,030.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	31,600	928.80	29,350,080.00	
	DSV PANALPINA A S	32,700	923.80	30,208,260.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	460	8,315.00	3,824,900.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	8,994.00	9,353,760.00	
	PANDORA A/S	16,000	450.00	7,200,000.00	
	CARLSBERG B	17,300	881.20	15,244,760.00	
	AMBU A/S-B	24,000	214.00	5,136,000.00	
	COLOPLAST-B	18,200	1,030.00	18,746,000.00	
	DEMANT A/S	16,000	201.80	3,228,800.00	
	GN STORE NORD A/S	19,000	404.40	7,683,600.00	
	GENMAB A/S	10,000	2,307.00	23,070,000.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	221.90	2,329,950.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	276,500	415.25	114,816,625.00	
DANSKE BANK AS	109,000	104.05	11,341,450.00		
TRYG A/S	19,900	192.10	3,822,790.00		

	ORSTED A/S	30,000	889.60	26,688,000.00	
小計	銘柄数：18			336,111,365.00	
				(5,697,087,636)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	29.84	1,193,600.00	
	OIL SEARCH LTD	280,000	3.14	879,200.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	265,000	5.83	1,544,950.00	
	SANTOS LTD.	265,000	5.80	1,537,000.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	20.78	353,260.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	152,000	20.45	3,108,400.00	
	ORICA LTD	59,000	18.26	1,077,340.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	67,000	30.50	2,043,500.00	
	BHP GROUP LIMITED	462,000	40.01	18,484,620.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	88,000	12.07	1,062,160.00	
	EVOLUTION MINING LTD	272,000	6.09	1,656,480.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	259,000	17.98	4,656,820.00	
	NEWCREST MINING	125,000	34.16	4,270,000.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	124,000	14.24	1,765,760.00	
	RIO TINTO LTD	57,300	101.15	5,795,895.00	
	SOUTH32 LTD	780,000	2.19	1,708,200.00	
	CIMIC GROUP LTD	18,000	23.50	423,000.00	
	BRAMBLES LTD	251,000	11.07	2,778,570.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	108,000	3.68	397,440.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	4.56	1,390,800.00	
	SYDNEY AIRPORT	168,000	5.31	892,080.00	
	SYDNEY AIRPORT-RIGHTS	32,621	0.73	23,813.33	
	TRANSURBAN GROUP	434,000	13.77	5,976,180.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	88,000	28.28	2,488,640.00	
	CROWN RESORTS LTD	55,000	9.53	524,150.00	
	TABCORP HOLDINGS	340,000	3.59	1,220,600.00	
	WESFARMERS LIMITED	175,900	47.61	8,374,599.00	
	COLES GROUP LTD	213,000	19.12	4,072,560.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	195,000	40.27	7,852,650.00	
	COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	8.81	678,370.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	12.84	1,425,240.00	

	COCHLEAR LTD	10,300	199.77	2,057,631.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	29,500	67.67	1,996,265.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	69,000	34.03	2,348,070.00	
	CSL LIMITED	70,500	279.34	19,693,470.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	440,000	18.68	8,219,200.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	276,300	71.76	19,827,288.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	500,000	18.22	9,110,000.00	
	WESTPAC BANKING CORP	563,000	18.04	10,156,520.00	
	AMP LIMITED	530,000	1.56	826,800.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	361,000	5.10	1,841,100.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	2.86	1,287,000.00	
	QBE INSURANCE	218,000	10.98	2,393,640.00	
	SUNCORP GROUP LTD	190,000	8.81	1,673,900.00	
	AFTERPAY LTD	32,200	75.80	2,440,760.00	
	COMPUTERSHARE LTD	76,000	14.11	1,072,360.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,000	19.93	418,530.00	
	TELSTRA CORP LTD	650,000	3.11	2,021,500.00	
	TPG TELECOM LTD	52,000	7.45	387,400.00	
	AUSNET SERVICES	330,000	1.83	605,550.00	
	APA GROUP	180,000	11.29	2,032,200.00	
	AGL ENERGY LTD	105,000	15.32	1,608,600.00	
	ASX LTD	30,700	85.43	2,622,701.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	53,000	126.18	6,687,540.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	65.36	1,254,912.00	
	REA GROUP LTD	8,800	116.00	1,020,800.00	
	SEEK LTD	48,000	19.55	938,400.00	
	小計銘柄数：57			194,198,014.33	
				(14,869,741,957)	
	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	6.20	1,196,600.00	
	A2 MILK CO LTD	117,000	20.95	2,451,150.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	87,000	34.30	2,984,100.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	12.39	718,620.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.92	1,510,440.00	

	MERCURY NZ LTD	100,000	4.78	478,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	4.59	922,590.00	
小計	銘柄数：7			10,261,500.00	
				(714,713,475)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	425,040	52.00	22,102,080.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	6.60	1,455,300.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	212,000	94.00	19,928,000.00	
	MTR CORP	243,000	40.35	9,805,050.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	335,000	58.95	19,748,250.00	
	SANDS CHINA LTD	384,000	32.90	12,633,600.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	9.77	2,637,900.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	14.80	3,374,400.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	249,000	27.80	6,922,200.00	
	WH GROUP LIMITED	1,440,000	6.85	9,864,000.00	
	BANK OF EAST ASIA	220,060	17.76	3,908,265.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	564,000	22.50	12,690,000.00	
	HANG SENG BANK	119,000	124.90	14,863,100.00	
	AIA GROUP LTD	1,888,000	75.10	141,788,800.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	89.05	4,274,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	11.62	6,967,352.00	
	PCCW LTD	750,000	4.92	3,690,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	41.55	4,445,850.00	
	CLP HLDGS	250,000	76.00	19,000,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	44.35	9,978,750.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,640,365	11.20	18,372,088.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	188,100	368.40	69,296,040.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	409,040	43.00	17,588,720.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	20.35	6,308,500.00	
	HENDERSON LAND	229,443	30.10	6,906,234.30	
	KERRY PROPERTIES	114,000	19.40	2,211,600.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	234,916	40.20	9,443,623.20	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	9.55	4,584,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	207,000	99.25	20,544,750.00	

	SWIRE PACIFIC-A	75,000	40.90	3,067,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	19.52	3,376,960.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	244,000	32.80	8,003,200.00	
小計	銘柄数：32			499,780,513.10	
				(6,871,982,055)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.39	844,110.00	
	KEPPEL CORP.	232,000	4.82	1,118,240.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	440,000	0.95	418,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	192,600	3.79	729,954.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	850,000	0.72	612,000.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	19.03	266,420.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	289,000	4.83	1,395,870.00	
	DBS GROUP HLDGS	284,000	21.07	5,983,880.00	
	OCBC-ORD	524,000	8.95	4,689,800.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	187,000	20.07	3,753,090.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	20.25	911,250.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,290,000	2.44	3,147,600.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	8.71	1,123,590.00	
	CAPITALAND LIMITED	430,000	2.81	1,208,300.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	8.42	589,400.00	
	UOL GROUP LIMITED	60,000	6.69	401,400.00	
小計	銘柄数：16			27,192,904.00	
				(2,114,792,144)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
新シケル	ICL GROUP LTD	125,000	12.49	1,561,250.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	482.00	1,735,200.00	
	BANK HAPOALIM BM	183,000	20.70	3,788,100.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	238,000	17.32	4,122,160.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	10.42	1,792,240.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	68.90	1,584,700.00	
	NICE LTD	10,100	756.00	7,635,600.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	184.50	1,199,250.00	
小計	銘柄数：8			23,418,500.00	

				(732,999,050)	
		組入時価比率：0.1%		0.1%	
	合計			678,290,373,902	(678,290,373,902)

(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8月17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	1,110,400.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,500	3,319,290.00	
		AMERICAN TOWER CORP	69,200	17,308,304.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	215,000	1,614,650.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,900	3,351,795.00	
		BOSTON PROPERTIES	22,600	1,953,318.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	1,410,880.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	64,800	10,668,024.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	40,800	6,255,456.00	
		DUKE REALTY CORP	56,600	2,144,574.00	
		EQUINIX INC	13,320	10,149,973.20	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,500	1,733,630.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	56,900	3,094,791.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,700	2,344,905.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	2,157,147.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	908,868.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	81,000	2,187,810.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	1,226,250.00	
		INVITATION HOMES INC	85,000	2,436,950.00	
		IRON MOUNTAIN INC	43,100	1,281,794.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,591,940.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,600	2,021,536.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	27,900	998,820.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	1,137,705.00			

	PROLOGIS INC	115,200	11,787,264.00	
	PUBLIC STORAGE	24,500	4,905,880.00	
	REALTY INCOME CORP	52,400	3,196,924.00	
	REGENCY CENTERS CORP	26,200	1,123,456.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	17,770	5,387,330.90	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	3,265,822.00	
	SUN COMMUNITIES INC	14,300	2,094,807.00	
	UDR INC	46,300	1,621,426.00	
	VENTAS INC	57,400	2,330,440.00	
	VEREIT INC	160,000	1,073,600.00	
	VICI PROPERTIES INC	76,000	1,742,680.00	
	VORNADO REALTY TRUST	27,000	960,660.00	
	WELLTOWER INC	63,100	3,580,925.00	
	WEYERHAEUSER CO	115,000	3,261,400.00	
	WP CAREY INC	27,400	1,941,290.00	
小計	銘柄数：39	2,099,190	130,682,715.10	
			(13,924,243,293)	
	組入時価比率：2.0%		84.0%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	697,171.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	230,400.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	341,440.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	227,700.00	
小計	銘柄数：4	63,900	1,496,711.00	
			(120,245,761)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	COVIVIO	8,500	530,825.00	
	GECINA SA	7,100	812,240.00	
	ICADE	5,200	294,060.00	
	KLEPIERRE	32,300	493,544.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,400	918,274.00	
小計	銘柄数：5	74,500	3,048,943.00	
			(384,776,606)	
	組入時価比率：0.1%		2.3%	
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	468,864.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	632,700.00	

小計	SEGRO PLC	176,000	1,695,232.00
	銘柄数：3	415,000	2,796,796.00 (390,320,849)
	組入時価比率：0.1%		2.4%
豪ドル	DEXUS	171,000	1,446,660.00
	GOODMAN GROUP	254,000	4,676,140.00
	GPT GROUP	330,000	1,254,000.00
	LENDLEASE GROUP	111,000	1,278,720.00
	MIRVAC GROUP	660,000	1,386,000.00
	SCENTRE GROUP	790,000	1,643,200.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	350,000	1,221,500.00
	VICINITY CENTRES	470,000	641,550.00
小計	銘柄数：8	3,136,000	13,547,770.00 (1,037,352,748)
	組入時価比率：0.1%		6.3%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,830,500.00
	LINK REIT	330,000	20,674,500.00
小計	銘柄数：2	800,000	24,505,000.00 (336,943,750)
	組入時価比率：0.0%		2.0%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	440,800	1,516,352.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	439,972	712,754.64
	CAPITALAND MALL TRUST	390,000	733,200.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	706,700.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	420,000	890,400.00
	SUNTEC REIT	300,000	411,000.00
	小計	銘柄数：6	2,360,772
	組入時価比率：0.1%		2.3%
合計			16,580,431,531 (16,580,431,531)

(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 8月17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	8,560,605,452	-	8,776,872,717	216,267,265
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	406,026,466	-	404,852,000	1,174,466
米ドル	406,026,466	-	404,852,000	1,174,466
合計	-	-	-	215,092,799

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	4,568,662
コール・ローン	2,523,676,262
国債証券	584,667,482,748

(2020年 8月17日現在)

派生商品評価勘定	1,644,742
未収入金	454,903,960
未収利息	5,244,742,717
前払費用	310,829,760
その他未収収益	20,786,743
流動資産合計	593,228,635,594
資産合計	593,228,635,594
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,757,471
未払金	1,695,502,118
未払解約金	1,114,171,127
未払利息	3,088
その他未払費用	9,834,239
流動負債合計	2,821,268,043
負債合計	2,821,268,043
純資産の部	
元本等	
元本	237,628,103,033
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	352,779,264,518
元本等合計	590,407,367,551
純資産合計	590,407,367,551
負債純資産合計	593,228,635,594

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在

1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.4846円
(10,000口当たり純資産額)	(24,846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	144,750,394,139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	152,555,240,205円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</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>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

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 8月17日現在	
期首	2020年 2月18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	254,018,982,974円
同期中における追加設定元本額	17,702,932,848円
同期中における一部解約元本額	34,093,812,789円
期末元本額	237,628,103,033円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	79,236,315円
バランスセレクト50	79,020,319円
バランスセレクト70	67,461,298円
野村外国債券インデックスファンド	289,569,099円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,521,400,822円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,083,052,227円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,447,518,544円
野村資産設計ファンド2015	20,133,303円
野村資産設計ファンド2020	20,454,877円
野村資産設計ファンド2025	35,824,473円
野村資産設計ファンド2030	34,749,467円
野村資産設計ファンド2035	23,913,308円
野村資産設計ファンド2040	44,067,613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）	99,009,240,285円
のむらップ・ファンド（保守型）	5,582,154,868円
のむらップ・ファンド（普通型）	12,068,115,800円
のむらップ・ファンド（積極型）	2,506,735,374円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	587,633,974円
野村資産設計ファンド2045	5,688,659円
野村インデックスファンド・外国債券	802,573,789円
マイ・ロード	8,659,113,930円
ネクストコア	273,452,949円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	154,668,917円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	6,182,781,903円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,160,297,665円
野村資産設計ファンド2050	7,202,687円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,516,487円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,748,130円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,234,801円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	827,716円
のむラップ・ファンド(やや保守型)	520,216,239円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	378,526,820円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,969,993円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,331,792円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,447,048円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,411,089円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,509,658円
野村6資産均等バランス	929,710,120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)	7,159,327,218円
世界6資産分散ファンド	74,603,739円
野村資産設計ファンド2060	1,912,299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	2,336,754,897円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,557,285,905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)	9,005,076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)	1,309,421,459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)	294,339,381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)	1,487,634,707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)	1,224,180,185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)	2,869,478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)	8,274,811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)	225,438円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,070,101,811円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	13,464,690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)	68,916,748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)	16,036,519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)	157,802,890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)	171,630,650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)	1,680,748,599円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	101,552,552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)	647,693,778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)	1,027,338,141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)	2,314,741円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,641,669円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	6,295,144円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,247,381円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	578,004,934円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,022,762,903円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,668,600,767円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,058,591,467円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	16,910,030,445円
マイバランスDC30	1,665,974,147円
マイバランスDC50	1,149,151,925円
マイバランスDC70	727,100,852円
野村DC外国債券インデックスファンド	6,389,884,654円
野村DC運用戦略ファンド	4,328,220,542円

野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	429,690,381円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	147,104,663円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	227,040,911円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	107,376,085円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	9,998,525円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	24,206,213円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	8,989,958円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,991,452円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,287,570円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,381,718円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	57,488,719円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	37,874,022円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	17,021,815円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	19,702,899円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	493,202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8月17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8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	50,500,000.00	55,449,393.90	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	45,837,043.48	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	48,937,022.31	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	94,390,215.14	
		US TREASURY BOND	10,800,000.00	15,142,780.44	
		US TREASURY BOND	46,200,000.00	64,088,062.50	
		US TREASURY BOND	49,300,000.00	67,926,156.25	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	38,156,250.00	
		US TREASURY BOND	100,000.00	154,585.93	
		US TREASURY BOND	13,600,000.00	17,766,062.16	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,970,156.20	
		US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,629,334.94	

US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,532,812.50	
US TREASURY N/B	15,500,000.00	15,805,760.75	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,435,897.98	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,299,252.34	
US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,755,546.87	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	31,060,248.48	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,925,234.28	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,207,694.50	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,673,730.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,022,226.50	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,775,734.19	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,735,186.88	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,870,640.29	
US TREASURY N/B	80,800,000.00	83,460,711.68	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,526,000.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,352,186.80	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,340,878.82	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,716,090.88	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,966,812.16	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,592,968.75	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,000,851.27	
US TREASURY N/B	500,000.00	513,984.35	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,345,245.98	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,689,185.04	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	26,043,187.50	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,045,093.20	
US TREASURY N/B	200,000.00	206,171.86	
US TREASURY N/B	900,000.00	926,156.25	
US TREASURY N/B	33,400,000.00	34,377,210.52	
US TREASURY N/B	16,400,000.00	17,000,905.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,007.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,617.18	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,033,828.10	
US TREASURY N/B	900,000.00	926,472.60	
US TREASURY N/B	19,100,000.00	19,769,991.71	

US TREASURY N/B	900,000.00	930,515.58	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,560,937.50	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,850,264.96	
US TREASURY N/B	10,200,000.00	10,673,343.24	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	49,759,865.99	
US TREASURY N/B	400,000.00	418,312.48	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,681,250.00	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,190,398.08	
US TREASURY N/B	400,000.00	413,906.24	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,589,452.00	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,319,778.64	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,575,905.56	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,435,382.49	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	44,208,187.50	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,949,413.90	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,293,421.33	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,506,247.36	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	12,340,218.16	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	46,127,812.50	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,782,187.04	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,629,686.00	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	45,966,324.90	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,402,578.06	
US TREASURY N/B	800,000.00	871,062.48	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,816,875.00	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	22,684,663.54	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,905,812.50	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,082,327.84	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	45,982,562.50	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,901,500.00	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	37,082,950.56	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,483,281.25	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,207,108.53	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,112,117.14	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	36,225,468.75	

US TREASURY N/B	34,500,000.00	38,685,819.45	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,749,343.75	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,587,515.42	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,859,343.36	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	29,273,904.90	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	21,817,499.52	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	55,322,138.11	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,136,875.00	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,571,530.82	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,927,687.50	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,466,554.16	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,686,250.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	6,009,500.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,251,250.00	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,196,093.00	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,594,202.56	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,018,592.90	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	42,779,685.60	
US TREASURY N/B	11,200,000.00	12,546,624.16	
US TREASURY N/B	500,000.00	581,289.05	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,115,562.50	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,443,937.44	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,153,437.40	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,601,000.00	
US TREASURY N/B	18,000,000.00	17,886,092.40	
US TREASURY N/B	30,200,000.00	44,568,592.24	
US TREASURY N/B	15,450,000.00	23,492,448.06	
US TREASURY N/B	200,000.00	325,671.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	156,921.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	140,843.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	153,796.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	158,507.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	156,523.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	161,390.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	157,289.06	

US TREASURY N/B	200,000.00	296,843.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	155,617.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	165,304.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	158,460.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	147,101.56	
US TREASURY N/B	300,000.00	406,031.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	135,585.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	133,093.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	256,406.24	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,747,244.49	
US TREASURY N/B	100,000.00	145,789.06	
US TREASURY N/B	8,100,000.00	11,846,882.61	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	21,477,124.24	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	31,324,921.30	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	49,324,920.03	
US TREASURY N/B	39,900,000.00	49,126,875.00	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	29,339,156.25	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	23,008,398.00	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,974,765.44	
US TREASURY N/B	51,500,000.00	63,650,781.25	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	34,901,904.84	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	40,817,812.50	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	18,820,546.52	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,306,687.50	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	14,834,250.00	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	12,120,515.16	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	12,945,975.85	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	7,114,101.18	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	14,362,851.30	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	3,389,881.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	134,476.56	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	10,041,281.04	
US TREASURY N/B	300,000.00	368,085.93	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,907,343.60	
小計	銘柄数：151	2,121,210,000.00	2,424,169,438.03

			(258,295,253,622)	
	組入時価比率：43.7%		44.3%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	7,700,000.00	8,043,728.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,600,000.00	11,745,348.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,005,680.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,221.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	10,556,728.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	311,148.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,609,811.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,156,518.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	533,855.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,353,384.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,676,430.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,028,079.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	318,948.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,250,000.00	10,897,257.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	207,416.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	111,426.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,559,955.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,145,310.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	9,173,694.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	6,219,954.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	10,593,584.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	15,245,390.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,819,623.00	
CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	494,108.00		
CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	157,140.00		
小計	銘柄数：25	111,840,000.00	138,265,736.10	
			(11,108,269,238)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	84,700,000.00	87,676,103.90	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,867,615.36	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	315,438.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	59,460,414.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	47,848,400.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	52,589,682.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	125,073,002.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	53,926,026.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	83,500,000.00	95,434,655.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,439,700.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	76,780,251.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,800,000.00	43,203,082.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	61,200,000.00	68,206,176.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	49,069,450.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	87,100,000.00	95,713,319.00	
	銘柄数 : 15	808,500,000.00	912,603,314.26	
	組入時価比率 : 0.7%		(4,426,126,074)	0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	737,618.00	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	860,220.00	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	661,500.00	
	BELGIUM KINGDOM	9,100,000.00	9,843,870.40	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,973,080.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,490,400.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,043,917.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,808,672.50	
	BELGIUM KINGDOM	6,000,000.00	7,687,860.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,579,440.70	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,159,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,087,495.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,300,900.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,676,506.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	2,794,929.64	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	115,770.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	601,705.00	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	128,694.60	
	BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	6,023,746.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	7,094,897.20	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,630,546.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	5,275,890.80	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,853,685.60	

BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,601,054.90
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,658,210.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,821,610.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,700,000.00	10,766,040.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,650,000.00	20,369,940.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,412,379.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,056,700.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	17,253,984.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,288,019.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,112,437.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,200,157.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,947,420.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	507,420.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	977,076.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,738,798.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,604,860.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,473,448.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,416,592.64
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,399,305.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,198,354.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,495,000.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,050,690.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,321,204.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,623,640.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,170,921.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,625,040.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	9,873,015.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	17,269,647.85
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,562,170.88
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,800,000.00	12,247,414.08
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	5,147,340.00
BUNDESobligation	100,000.00	100,740.00
BUNDESobligation	3,700,000.00	3,739,553.00
BUNDESobligation	750,000.00	761,227.50
BUNDESobligation	1,000,000.00	1,018,610.00

BUNDESobligation	2,000,000.00	2,055,840.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	412,228.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,183,560.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	731,689.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	411,723.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,200,000.00	9,758,900.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,791,508.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	23,900,000.00	29,597,043.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,847,135.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,800,000.00	11,692,512.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,650,071.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,844,018.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,863,854.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,800,000.00	22,125,584.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,038,130.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	739,900.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	30,262,428.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	215,682.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	26,707,226.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	648,960.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,417,246.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,200,000.00	31,654,272.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,120,384.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,600,000.00	14,825,316.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	14,377,137.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	7,057,667.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	10,402,464.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,430,000.00	2,506,099.31	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,431,942.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,200,000.00	18,629,632.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,950,000.00	17,484,572.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,700,000.00	1,717,204.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,300,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	17,343,810.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,900,000.00	6,070,038.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	10,050,000.00	10,115,526.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,679,924.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	20,397,447.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	6,326,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,945,904.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	407,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,129,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,196,912.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000.00	34,869,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,903,230.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,233,768.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	569,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	24,008,930.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,902,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	318,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,597,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,925,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,092,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,290,401.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	836,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,155,127.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,712,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,237,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,982,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,174,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,399,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	24,472,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,562,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	41,312,830.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	23,918,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	528,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,565,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,599,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	22,513,260.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,055,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	950,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	604,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,733,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	246,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	18,225,090.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	13,804,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,048,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,712,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,968,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	10,053,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,624,637.18	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	504,987.65	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	104,675.90	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,619.40	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	407,397.20	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	767,130.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,416,480.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,317.90	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,114,728.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,121,959.71	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,569,560.00	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	882,330.40	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	232,587.80	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,069,708.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	618,482.08	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	393,405.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,009,253.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,639,650.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,676,289.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,995.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,600,000.00	10,628,915.52	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,842,574.32	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,540,584.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,901,169.00	

FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,867,723.80	
FRANCE (GOVT OF)	7,700,000.00	8,431,115.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,168,188.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,602,727.20	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,132,276.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,500,000.00	10,747,927.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	12,233,949.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	117,330.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	128,306.29	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	14,858,051.80	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,551,036.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	529,515.25	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,700,000.00	1,778,269.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	9,019,826.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,400,000.00	3,435,795.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,000,000.00	23,387,188.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,592,790.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	31,199,850.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,297,951.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,500,000.00	26,189,260.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,474,300.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	41,898,670.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,681,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,723,398.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	15,861,096.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	34,433,064.78	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,300,000.00	17,403,395.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	505,229.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	13,306,982.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,550,000.00	47,746,049.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,900,000.00	10,228,426.11	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,900,000.00	13,017,511.02	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,087,157.05	
IRISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,360,265.60	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,226,060.16	

IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	667,621.80	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,783,292.00	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,299,696.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,897,225.65	
IRISH TSY 1.7% 2037	700,000.00	870,196.60	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,972,472.12	
IRISH TSY 2.4% 2030	3,700,000.00	4,614,499.40	
IRISH TSY 2% 2045	3,100,000.00	4,262,273.70	
IRISH TSY 2022	9,000,000.00	9,112,491.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,964,107.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,512,434.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	105,494.98	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	221,180.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,700,000.00	6,824,610.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	427,824.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,061.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	8,700,000.00	9,600,258.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,562,139.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	2,017,230.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,713,085.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,800,560.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,094,300.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	3,584,280.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	9,500,000.00	12,751,344.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,200,000.00	3,697,763.96	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	551,468.35	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	2,718,535.95	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,500,000.00	12,873,509.25	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,593,800.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	731,036.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,429,120.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,314.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	218,407.92	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	915,300.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	161,260.87	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,328,145.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	766,536.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,419,199.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,050,240.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,155,444.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,156,739.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	8,130,480.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	6,430,171.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	673,366.04	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,439,332.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,100,000.00	9,371,290.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,259,346.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	1,039,459.50	
	REPUBLIC OF IRELAND	4,450,000.00	4,971,274.78	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,803,076.80	
	SPANISH GOVERNMENT	31,800,000.00	51,468,300.00	
	SPANISH GOVERNMENT	2,500,000.00	3,868,300.00	
小計	銘柄数：250	1,469,100,000.00	1,913,230,531.89 (241,449,693,124)	
	組入時価比率：40.9%		41.3%	
英ポンド	UK TREASURY	470,000.00	488,743.60	
	UK TREASURY	1,450,000.00	1,540,349.50	
	UK TREASURY	400,000.00	414,664.00	
	UK TREASURY	7,100,000.00	7,123,643.00	
	UK TREASURY	14,000,000.00	14,333,760.00	
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,177,319.00	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,662,448.00	
	UK TREASURY	7,450,000.00	8,297,586.50	
	UK TREASURY	9,950,000.00	12,230,241.50	
	UK TREASURY	200,000.00	206,140.00	
	UK TREASURY	200,000.00	220,594.00	
	UK TREASURY	160,000.00	174,254.40	
	UK TREASURY	400,000.00	432,600.00	
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,555,882.90	
	UK TREASURY	200,000.00	224,612.00	

	UK TREASURY	7,900,000.00	11,695,634.00	
	UK TREASURY	6,000,000.00	8,748,600.00	
	UK TREASURY	5,550,000.00	8,026,965.00	
	UK TREASURY	16,300,000.00	25,131,340.00	
	UK TREASURY	2,600,000.00	4,019,340.00	
	UK TREASURY	100,000.00	170,900.00	
	UK TREASURY	600,000.00	982,980.00	
	UK TREASURY	500,000.00	832,900.00	
	UK TREASURY	400,000.00	437,720.00	
	UK TREASURY	570,000.00	1,008,330.00	
	UK TREASURY	18,440,000.00	29,492,936.00	
	UK TREASURY	6,300,000.00	11,448,360.00	
	UK TREASURY	8,200,000.00	9,582,520.00	
	UK TREASURY	16,100,000.00	19,968,830.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	10,175,165.00	
	UK TREASURY	6,750,000.00	12,406,500.00	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,249,200.00	
	UK TREASURY	700,000.00	921,900.00	
	UK TREASURY	100,000.00	167,270.00	
	UK TREASURY	200,000.00	425,080.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	27,450,000.00	41,883,210.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,800,000.00	14,096,400.00	
小計	銘柄数：37	192,220,000.00	273,954,918.40 (38,233,148,411)	
	組入時価比率：6.5%		6.5%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	36,050,000.00	38,516,541.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,362,015.70	
	SWEDISH GOVERNMENT	32,250,000.00	36,431,212.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,886,044.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,913,042.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,309,437.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	16,377,690.00	
小計	銘柄数：7	129,800,000.00	145,795,982.20 (1,788,916,701)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークロー	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	10,782,555.00	

ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	38,900,000.00	42,544,930.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,977,535.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,950,510.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,296,000.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,913,160.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	23,978,900.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,857,734.00	
	小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.2%	100,100,000.00	108,301,324.00 (1,298,532,874) 0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	14,400,000.00	15,043,032.00	
	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	407,480.00	
	KINGDOM OF DENMARK	22,770,000.00	24,316,083.00	
	KINGDOM OF DENMARK	29,300,000.00	32,779,375.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,728,350.00	
	KINGDOM OF DENMARK	21,400,000.00	22,983,600.00	
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	71,498,383.80	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.5%	142,070,000.00	183,756,303.80 (3,114,669,349) 0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	45,400,000.00	47,007,160.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	33,600,000.00	36,187,045.44	
	POLAND GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	24,608,100.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,700,000.00	15,526,895.00	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：0.6%	114,700,000.00	123,329,200.44 (3,539,548,052) 0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	10,031,183.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,640,000.00	10,640,921.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	83,564.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	6,154,896.78	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,842,600.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,200,000.00	17,198,328.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,442,159.62	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,360,686.22	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,664,334.40	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,784,700.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,423,511.51	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,116,094.33	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	15,483,860.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,500,000.00	13,178,015.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,404,938.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	10,811,039.47	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,166,504.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	5,411,258.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	896,490.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	479,404.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,696,550.00	
小計	銘柄数：21	152,500,000.00	178,271,041.53	
			(13,650,213,649)	
	組入時価比率：2.3%		2.3%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,426,880.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	409,810.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,538,480.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	310,590.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,600,000.00	3,845,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,529,895.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,096,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,198,714.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	761,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,605,120.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	570,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	352,740.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,854,080.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,537,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,435,874.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,050,000.00	2,654,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,345,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,200,625.00	
小計	銘柄数：18	28,700,000.00	32,673,418.00	
			(2,541,011,717)	

	組入時価比率：0.4%		0.4%
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,135,981.99
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	432,056.44
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	3,075,463.30
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,984,621.04
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	478,352.72
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,359,661.16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	511,812.15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,744,117.54
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	520,413.65
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	14,046,297.75
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,671,294.90
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,319,908.58
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,264,039.44
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	654,248.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,724,405.76
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	5,058,092.38
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,569,207.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,404,744.76
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,243,355.29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	311,422.07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	14,793,922.66
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	5,008,821.84
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	451,793.64
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	879,589.76
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,025,172.72
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,685,919.80
MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,843,695.31	
MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	360,364.71	
小計	銘柄数：28	104,280,000.00	115,558,777.56 (2,939,815,301)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,600,000.00	2,805,955.62
	ISRAEL FIXED BOND	6,900,000.00	6,988,669.83
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,130,887.00
		5,000,000.00	5,537,825.50

	ISRAEL FIXED BOND			
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,214,164.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,634,596.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,357,126.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,796,106.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,487,168.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,681,195.00	
	ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,067,083.60	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	8,873,068.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	7,342,596.00	
小計	銘柄数：13	61,500,000.00	72,916,442.05	
			(2,282,284,636)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
合計			584,667,482,748	
			(584,667,482,748)	

(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 8月17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	1,445,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	10,227,000	
		US TREASURY N/B	5,500,000	
		US TREASURY N/B	6,400,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	7,586,000	
		US TREASURY N/B	8,000,000	
		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	23,000,000	
		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	2,655,000
US TREASURY N/B	29,000,000
US TREASURY N/B	7,875,000
US TREASURY N/B	8,400,000
US TREASURY N/B	1,700,000
US TREASURY N/B	1,300,000
US TREASURY N/B	12,500,000
US TREASURY N/B	25,000,000
US TREASURY N/B	8,525,000
US TREASURY N/B	20,600,000
US TREASURY N/B	5,000,000
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	650,000
US TREASURY N/B	19,600,000
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	1,098,000
US TREASURY N/B	8,814,000
US TREASURY N/B	72,000
US TREASURY N/B	25,000,000
US TREASURY N/B	5,000,000
US TREASURY N/B	36,000,000
US TREASURY N/B	7,369,000
US TREASURY N/B	6,069,000
US TREASURY N/B	6,826,000
US TREASURY N/B	19,700,000
US TREASURY N/B	3,341,000
US TREASURY N/B	33,000,000
US TREASURY N/B	35,000,000
US TREASURY BOND	38,000,000
US TREASURY N/B	30,000,000
US TREASURY N/B	2,000,000
US TREASURY N/B	1,000,000
US TREASURY N/B	4,186,000
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	1,300,000	
		US TREASURY N/B	25,000,000	
	ユーロ	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,300,000	

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 8月17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	1,717,865,141	-	1,717,739,000	126,141
米ドル	811,315,808	-	809,704,000	1,611,808
ユーロ	781,035,018	-	782,440,000	1,404,982
英ポンド	125,514,315	-	125,595,000	80,685
売建	358,311,412	-	358,298,000	13,412
米ドル	159,969,075	-	159,810,000	159,075
ユーロ	163,941,973	-	164,060,000	118,027
ズロチ	34,400,364	-	34,428,000	27,636
合計	-	-	-	112,729

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	102,610,142
コール・ローン	12,001,367
国債証券	21,229,728,462
派生商品評価勘定	53,639
未収利息	226,174,408
前払費用	7,802,889
流動資産合計	21,578,370,907
資産合計	21,578,370,907
負債の部	
流動負債	
未払解約金	37,005,476
未払利息	14
その他未払費用	206,000
流動負債合計	37,211,490
負債合計	37,211,490
純資産の部	
元本等	
元本	10,651,629,461
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,889,529,956
元本等合計	21,541,159,417
純資産合計	21,541,159,417
負債純資産合計	21,578,370,907

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0223円
(10,000口当たり純資産額)	(20,223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 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</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>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>国債証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 8月17日現在	
期首	2020年 2月18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	11,410,857,442円
同期中における追加設定元本額	2,452,128,148円
同期中における一部解約元本額	3,211,356,129円
期末元本額	10,651,629,461円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	699,930,500円
ネクストコア	21,737,982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	805,353,245円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,478,863円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,291,913円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,783,296円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,489,874円
インデックス・ブレンド(タイプ)	8,056,976円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	965,855,521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)	1,753,018,283円
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	254,358,097円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	374,999,921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)	6,720,024円
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,441,780円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	579,184,792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)	322,400,782円
野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	4,483,979,769円
野村DC運用戦略ファンド	316,775,926円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	33,771,917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8月17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8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ARGENT-GLOBAL	640,000.00	483,669.44	
		ARGENT-GLOBAL	420,000.00	315,037.92	
		ARGENT-GLOBAL	2,300,000.00	1,020,728.50	
		BRAZIL GLOBAL	650,000.00	810,062.50	
		BRAZIL GLOBAL	670,000.00	936,117.30	
		BRAZIL GLOBAL	900,000.00	1,163,740.50	

COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	304,913.75	
COLOMBIA GLOBAL	1,220,000.00	1,782,432.20	
CROATIA	1,100,000.00	1,228,997.00	
CROATIA	1,000,000.00	1,167,640.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,300,000.00	1,339,000.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000.00	2,473,224.50	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	1,053,796.50	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,200,000.00	1,316,622.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	2,048,323.50	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,706,250.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,689,288.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,600,000.00	2,955,667.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	500,000.00	513,812.50	
HUNGARY	1,100,000.00	1,219,350.00	
HUNGARY	1,250,000.00	1,439,850.00	
HUNGARY	1,600,000.00	1,851,705.60	
INDONESIA GLOBAL	1,600,000.00	1,848,772.48	
MEXICO GLOBAL	1,080,000.00	1,480,744.80	
PANAMA GLOBAL	500,000.00	640,530.00	
PANAMA GLOBAL	250,000.00	393,702.50	
PANAMA GLOBAL	1,350,000.00	2,052,735.75	
PERU GLOBAL	900,000.00	1,159,780.50	
PERU GLOBAL	670,000.00	1,060,640.15	
PHILIPPINES GLOBAL	1,400,000.00	1,560,482.00	
PHILIPPINES GLOBAL	1,250,000.00	2,089,231.25	
PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	1,245,280.32	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	724,989.15	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	398,965.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,650,000.00	1,276,014.75	
REPUBLIC OF ARGENTINA	600,000.00	285,687.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000.00	1,919,579.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	1,043,625.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	1,043,188.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,500,000.00	681,090.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000.00	948,769.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,150,000.00	965,984.25	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,300,000.00	570,375.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	200,000.00	205,229.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,100,000.00	2,240,017.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,111,095.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000.00	871,256.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,587,390.00	

REPUBLIC OF COLOMBIA	1,320,000.00	1,774,080.00
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,500,000.00	1,955,250.00
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,200,000.00	2,716,571.00
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,200,000.00	1,522,746.00
REPUBLIC OF HUNGARY	600,000.00	1,074,283.20
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,057,766.10
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,458,355.73
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,748,784.45
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	809,356.17
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	453,538.48
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	664,227.18
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	345,127.32
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,573,559.00
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	446,048.00
REPUBLIC OF INDONESIA	1,150,000.00	1,854,061.51
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,612,376.76
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	986,708.08
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,578,799.90
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,073,519.44
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,465,474.60
REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000.00	1,902,600.00
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,816,155.00
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	552,853.04
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	772,551.50
REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000.00	1,952,611.50
REPUBLIC OF PANAMA	200,000.00	218,875.00
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	1,046,436.00
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	1,054,000.00
REPUBLIC OF PERU	300,000.00	350,568.00
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	551,530.00
REPUBLIC OF PERU	1,500,000.00	2,524,207.50
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	554,600.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	990,000.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,900,000.00	2,237,810.50
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,210,988.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,087,856.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,100,000.00	1,357,981.02
REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000.00	2,427,500.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	750,000.00	794,745.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,350,000.00	1,460,882.25
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	819,600.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,200,000.00	1,152,007.20
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	785,214.40

REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	738,094.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	645,127.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	493,412.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,651,939.20	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	595,924.80	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,708,770.30	
REPUBLIC OF TURKEY	300,000.00	281,682.60	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	923,084.10	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	594,637.20	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	356,205.60	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,178,294.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000.00	2,190,717.80	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	812,773.80	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,044,461.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,700,000.00	2,769,033.60	
REPUBLIC OF TURKEY	950,000.00	867,492.50	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,019,910.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000.00	1,836,715.20	
REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000.00	1,862,065.80	
REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000.00	1,524,750.00	
ROMANIA	200,000.00	216,269.20	
ROMANIA	800,000.00	868,080.00	
ROMANIA	400,000.00	444,864.00	
ROMANIA	800,000.00	1,104,686.40	
ROMANIA	600,000.00	754,698.00	
RUSSIA	1,032,500.00	1,195,356.22	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,057,203.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,228,616.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,626,248.40	
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	1,822,043.20	
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	1,859,563.20	
RUSSIAN FEDERATION	2,200,000.00	2,799,464.80	
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	2,264,286.40	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,466,832.00	
RUSSIAN FEDERATION	4,000,000.00	5,650,400.00	
TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,461,787.50	
TURKEY GLOBAL	2,400,000.00	2,465,280.00	
TURKEY GLOBAL	850,000.00	1,114,603.30	
UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	623,871.60	
UKRAINE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,684,800.00	
UKRAINE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,403,316.60	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	209,000.00	216,538.63	

	UKRAINE GOVERNMENT REGS	709,000.00	738,671.65
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	734,438.60
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,257,174.00
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,242,240.00
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,570,796.50
	UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,154,747.00
	UNITED MEXICAN STATES	1,750,000.00	1,895,608.75
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,294,560.00
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,443,403.00
	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,775,000.00
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	755,464.50
	UNITED MEXICAN STATES	2,200,000.00	2,470,347.00
	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000.00	2,730,962.45
	UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,697,692.50
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	2,118,625.00
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,881,551.50
	UNITED MEXICAN STATES	1,400,000.00	1,505,427.00
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,882,418.50
	UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,656,015.00
小計	銘柄数：152	185,780,500.00	199,246,630.34 (21,229,728,462)
	組入時価比率：98.6%		100.0%
合計			21,229,728,462 (21,229,728,462)

(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 8月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	34,679,139	-	34,625,500	53,639
米ドル	34,679,139	-	34,625,500	53,639
合計	34,679,139	-	34,625,500	53,639

(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 8月17日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	87,513,212
コール・ローン	9,177,198
国債証券	7,290,297,355
派生商品評価勘定	15,335
未収利息	73,713,096
前払費用	15,403,991
流動資産合計	7,476,120,187
資産合計	7,476,120,187
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,473
未払解約金	9,693,123
未払利息	11
その他未払費用	341,200
流動負債合計	10,038,807
負債合計	10,038,807
純資産の部	
元本等	
元本	5,627,921,871
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,838,159,509
元本等合計	7,466,081,380
純資産合計	7,466,081,380
負債純資産合計	7,476,120,187

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17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	1.3266円
(10,000口当たり純資産額)	(13,266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 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17日現在	
期首	2020年 2月18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	5,640,261,826円
同期中における追加設定元本額	1,560,386,329円
同期中における一部解約元本額	1,572,726,284円
期末元本額	5,627,921,871円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	20,296,488円
野村資産設計ファンド2020	20,631,008円
野村資産設計ファンド2025	36,646,713円
野村資産設計ファンド2030	35,547,012円
野村資産設計ファンド2035	24,465,457円
野村資産設計ファンド2040	45,080,707円
野村資産設計ファンド2045	5,819,242円
野村インデックスファンド・新興国債券	916,238,429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	289,570,686円
野村資産設計ファンド2050	7,325,276円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,679,118円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,789,310円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,287,746円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	864,750円
世界6資産分散ファンド	139,672,816円
野村資産設計ファンド2060	1,927,894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)	3,229,860,520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)	361,264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	398,017,514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	4,083,553円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,340,816円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,405,261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8月17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8月17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	8,902,178.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	11,363,598.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	3,400,000.00	3,574,964.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	11,155,800.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000.00	13,038,689.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	8,098,606.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,850,000.00	15,425,299.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,300,000.00	13,451,746.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,600,000.00	7,543,338.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	4,804,674.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,682,179.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,600,000.00	10,378,394.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,700,000.00	7,467,016.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	9,699,775.00	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	17,800,000.00	19,560,242.00	
		小計	銘柄数：15 組入時価比率：9.6%	132,050,000.00	148,146,498.60 (718,510,518) 9.9%
	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	3,300,000.00	3,172,768.83	
LETRA TESOURO NACIONAL		4,900,000.00	4,590,931.52		
LETRA TESOURO NACIONAL		2,800,000.00	2,454,202.24		
LETRA TESOURO NACIONAL		4,000,000.00	3,370,272.40		

小計	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000.00	6,962,122.15	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000.00	4,817,659.80	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000.00	3,781,323.52	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	2,976,985.00	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	60,000.00	722,713.08	
	銘柄数：9	16,651,000.00	32,848,978.54	(645,153,938)
	組入時価比率：8.6%		8.8%	
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	111,215,920.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	120,000,000.00	127,750,572.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	300,000,000.00	353,849,700.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	195,000,000.00	237,925,876.50	
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	309,089,400.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	215,000,000.00	322,537,152.00	
	銘柄数：6	1,170,000,000.00	1,462,368,620.50	(195,226,210)
	組入時価比率：2.6%		2.7%	
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,160,000,000.00	2,214,320,760.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,810,000,000.00	6,071,326,300.00	
	TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	1,167,868,915.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	943,297,290.00	
	TITULOS DE TESORERIA	800,000,000.00	917,206,480.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,600,000,000.00	1,684,019,360.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,400,000,000.00	1,492,854,160.00	
	銘柄数：7	12,620,000,000.00	14,490,893,265.00	(407,194,100)
	組入時価比率：5.5%		5.6%	
ソル	BONOS DE TESORERIA	300,000.00	351,780.81	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	710,762.52	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	704,942.64	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	753,154.78	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	708,158.57	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	920,684.94	
	PERU BONO SOBERANO	1,300,000.00	1,628,279.25	
	PERU BONO SOBERANO	620,000.00	750,149.84	
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,338,514.21	

小計	銘柄数：9 組入時価比率：3.1%	6,620,000.00	7,866,427.56 (234,576,869) 3.2%
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	4,070,360.00
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.1%	4,000,000.00	4,070,360.00 (10,216,603) 0.1%
ドミニカペソ	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	8,009,520.00
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.2%	8,000,000.00	8,009,520.00 (14,577,326) 0.2%
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	300,000.00	289,800.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	250,000.00	237,687.50
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,161,600.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	790,000.00	717,715.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,348,200.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,270,000.00	1,936,310.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	467,220.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	947,940.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	817,530.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,142,700.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,046,400.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	592,200.00
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,659,618.00
小計	銘柄数：13 組入時価比率：2.4%	13,860,000.00	12,364,920.50 (178,920,399) 2.5%
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	20,400,000.00	20,448,845.76
	CZECH REPUBLIC	23,600,000.00	23,961,226.32
	CZECH REPUBLIC	12,500,000.00	12,007,717.50
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	13,213,147.20
	CZECH REPUBLIC	6,500,000.00	7,285,850.00
小計	銘柄数：5 組入時価比率：5.0%	76,200,000.00	76,916,786.78 (372,277,248) 5.1%
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,241,000.00

小計	HUNGARY GOVERNMENT BOND	17,000,000.00	19,025,550.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	93,000,000.00	95,059,950.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	89,115,180.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	72,739,600.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	45,000,000.00	47,289,618.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	75,453,210.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	91,684,600.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	88,953,936.20	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	77,785,050.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	64,193,010.00	
	銘柄数：11	658,000,000.00	731,540,704.20	(266,500,278)
組入時価比率：3.6%			3.7%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,700,000.00	1,760,180.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,325,113.78	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	3,241,997.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,307,981.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,217,523.70	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	2,023,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	894,840.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,300,000.00	3,740,055.00	
小計	銘柄数：8	19,700,000.00	21,510,891.08	(617,362,573)
組入時価比率：8.3%			8.5%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	20,672,828.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	22,500,000.00	23,809,500.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	12,746,131.20	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	30,661,700.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	14,000,000.00	14,777,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,300,000.00	40,663,549.88	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	41,000,000.00	44,536,065.50	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	30,442,500.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000.00	54,275,635.80	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	20,313,810.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,745,450.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	22,505,950.00	

小計	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	31,906,495.55	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	31,454,500.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	11,004,826.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,000,000.00	20,865,715.20	
	銘柄数：16 組入時価比率：8.3%	381,200,000.00	421,381,657.13 (619,431,035) 8.5%	
レイ	ROMANIA	500,000.00	506,130.00	
	ROMANIA	900,000.00	904,189.50	
	ROMANIA	1,000,000.00	1,007,200.00	
	ROMANIA	550,000.00	586,135.00	
	ROMANIA	500,000.00	497,210.00	
	ROMANIA	1,000,000.00	1,038,425.00	
	ROMANIA	920,000.00	967,127.00	
	ROMANIA	500,000.00	530,702.50	
	ROMANIA	760,000.00	859,167.08	
	ROMANIA	800,000.00	865,768.00	
	ROMANIA	600,000.00	572,694.00	
	小計	銘柄数：11 組入時価比率：2.9%	8,030,000.00	8,334,748.08 (217,536,924) 3.0%
	リング	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	324,042.33
MALAYSIA GOVERNMENT		2,000,000.00	2,212,232.60	
MALAYSIA GOVERNMENT		800,000.00	884,332.16	
MALAYSIA GOVERNMENT		1,000,000.00	1,195,881.80	
MALAYSIAN GOVERNMENT		1,300,000.00	1,330,711.59	
MALAYSIAN GOVERNMENT		1,800,000.00	1,888,094.52	
MALAYSIAN GOVERNMENT		1,200,000.00	1,263,625.56	
MALAYSIAN GOVERNMENT		2,600,000.00	2,808,017.68	
MALAYSIAN GOVERNMENT		1,000,000.00	1,090,414.00	
MALAYSIAN GOVERNMENT		600,000.00	656,057.70	
MALAYSIAN GOVERNMENT		1,400,000.00	1,535,983.96	
MALAYSIAN GOVERNMENT		2,900,000.00	3,169,890.82	
MALAYSIAN GOVERNMENT		1,900,000.00	2,113,221.23	
小計		銘柄数：13	18,800,000.00	20,472,505.95 (520,820,551)

	組入時価比率：7.0%		7.1%	
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,509,908.88	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,391,233.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,175,116.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	16,700,000.00	18,125,518.68	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,173,982.30	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,900,000.00	24,580,052.99	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,613,515.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,700,000.00	18,922,820.43	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,600,000.00	8,573,028.76	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	13,229,360.22	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,800,000.00	16,201,895.12	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	7,301,305.80	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	10,218,740.78	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,026,269.80	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	15,513,832.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	2,316,685.77	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	15,651,616.89	
	小計	銘柄数：17	174,000,000.00	192,524,883.12
組入時価比率：8.8%			9.0%	
フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	12,648,100.00	
	銘柄数：1	10,000,000.00	12,648,100.00	(27,572,858)
小計	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	5,380,000,000.00	5,629,632,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,700,000,000.00	2,758,050,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,730,000,000.00	7,347,814,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000.00	9,578,800,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,469,960,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,927,457,800.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,250,000,000.00	6,465,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	4,860,500,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	12,230,000,000.00	13,972,775,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,400,000,000.00	7,028,480,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,386,252,582.00	

小計	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,545,750,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,835,840,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,725,040,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,271,040,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,688,320,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,680,000,000.00	6,215,624,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,425,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,400,000,000.00	3,433,320,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,739,000,000.00	
	銘柄数：20	89,760,000,000.00	96,303,655,382.00	(703,016,684)
組入時価比率：9.4%			9.6%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	6,468,389.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,800,000.00	14,817,940.48	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,000,000.00	17,640,888.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,460,000.00	3,683,960.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,000,000.00	6,128,514.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,439,077.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,194,786.88	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000.00	9,009,280.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	5,814,740.96	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	2,835,749.59	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,000,000.00	7,843,350.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,100,000.00	3,970,662.63	
	銘柄数：12	95,910,000.00	84,847,340.04	(520,114,194)
組入時価比率：7.0%			7.1%	
オフショア人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	4,586,917.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,517,500.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	8,000,000.00	8,518,886.40	
	銘柄数：3	22,500,000.00	23,623,303.90	(362,853,947)
組入時価比率：4.9%			5.0%	
合計			7,290,297,355	(7,290,297,355)

(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 8月17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	3,200,673	-	3,196,200	4,473
米ドル	3,200,673	-	3,196,200	4,473
売建	7,792,755	-	7,777,420	15,335
米ドル	7,792,755	-	7,777,420	15,335
合計	-	-	-	10,862

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2020年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	945,776,998
投資証券	35,384,947,230
未収入金	39,665,802
未収配当金	251,980,092
差入委託証拠金	294,819,000

(2020年 8月17日現在)

流動資産合計	36,917,189,122
資産合計	36,917,189,122
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	34,270,450
未払金	239,728,590
未払解約金	51,588,598
未払利息	1,157
流動負債合計	325,588,795
負債合計	325,588,795
純資産の部	
元本等	
元本	17,097,326,176
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	19,494,274,151
元本等合計	36,591,600,327
純資産合計	36,591,600,327
負債純資産合計	36,917,189,122

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。 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 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p>
2. 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>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額

1口当たり純資産額	2,1402円
(10,000口当たり純資産額)	(21,402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 2020年 2月18日
至 2020年 8月17日

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17日現在

期首	2020年 2月18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	16,782,818,171円
同期中における追加設定元本額	4,532,534,010円
同期中における一部解約元本額	4,218,026,005円
期末元本額	17,097,326,176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)	2,057,387,938円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,697,273,055円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	845,895,896円
野村資産設計ファンド2015	18,096,781円
野村資産設計ファンド2020	18,389,861円
野村資産設計ファンド2025	21,577,836円
野村資産設計ファンド2030	20,930,364円
野村資産設計ファンド2035	21,607,466円
野村資産設計ファンド2040	39,815,736円
野村資産設計ファンド2045	3,426,382円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,291,620,167円
ネクストコア	14,316,335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	1,148,223,533円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	2,560,297,446円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	448,191,657円
野村資産設計ファンド2050	5,195,163円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,323,874円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,335,971円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,579,502円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,660,121円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,695,110円
野村6資産均等バランス	1,086,370,339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)	94,420,282円
野村資産設計ファンド2060	1,718,703円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	126,183,884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)	61,214,358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)	131,995,617円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,706,997,689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)	377,566,659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)	225,451円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)	19,690,854円
野村DC運用戦略ファンド	226,213,567円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	18,052,479円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	5,843,207円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,828,950円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	5,252,400円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	2,404,393円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,067,160円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	996,675円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	443,315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8月17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8月17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	656	66,649,600	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	982	90,736,800	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	894	127,484,400	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,334	868,434,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法 人 投資証券	4,910	351,556,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,617	605,750,400	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,672	1,057,260,800	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,812	1,208,404,000	
		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	2,618	498,205,400	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	2,011	772,224,000	
		G L P 投資法人 投資証券	11,539	2,019,325,000	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,751	583,083,000	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	6,072	2,158,596,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	611	277,394,000	
		O n e リート投資法人 投資証券	626	153,933,400	
イオンリート投資法人 投資証券	4,070	448,921,000			

ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,231	429,723,000	
日本リート投資法人 投資証券	1,303	446,929,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	25,782	345,220,980	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,803	825,029,700	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	888	93,151,200	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,476	302,432,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	856	98,782,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	773	75,135,600	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,977	1,758,383,500	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	702	43,664,400	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,751	691,684,400	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	4,123	170,898,350	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	376	36,660,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,150	635,950,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	648	38,491,200	
投資法人みらい 投資証券	4,334	152,340,100	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	869	81,686,000	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	797	366,221,500	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,095	175,747,500	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	615	53,689,500	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,206	103,836,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,267	199,552,500	

日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,886	2,296,626,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,013	2,163,007,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,585	1,111,202,500	
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,996	1,199,400,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,498	731,914,000	
プレミア投資法人 投資証券	3,625	425,937,500	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,691	349,022,700	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,787	267,273,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,582	952,602,000	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,868	363,949,200	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,780	438,461,400	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,332	433,566,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,499	283,636,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,622	753,038,400	
福岡リート投資法人 投資証券	2,075	269,542,500	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,241	718,539,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,329	237,024,800	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	855	492,480,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,813	210,308,000	
スターツプロシード投資法人 投資証券	625	125,062,500	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,726	1,610,151,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,928	575,942,400	
大和証券リビング投資法人 投資証券	5,063	531,108,700	

	券			
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,724	431,984,000	
小計	銘柄数：62 組入時価比率：96.7%	239,340	35,384,947,230 100.0%	
合計			35,384,947,230	

(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 8月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	1,200,404,000	-	1,166,210,000	34,270,450
合計	1,200,404,000	-	1,166,210,000	34,270,450

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	63,265,496
コール・ローン	204,035,164
投資証券	27,675,916,919
派生商品評価勘定	3,805,867
未収入金	1,567,436
未収配当金	60,798,679
差入委託証拠金	92,830,666
流動資産合計	28,102,220,227
資産合計	28,102,220,227
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	666,240

(2020年 8月17日現在)

未払金	199,914,425
未払解約金	5,246,761
未払利息	249
その他未払費用	212,300
流動負債合計	206,039,975
負債合計	206,039,975
純資産の部	
元本等	
元本	13,270,363,351
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	14,625,816,901
元本等合計	27,896,180,252
純資産合計	27,896,180,252
負債純資産合計	28,102,220,227

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.1021円
(10,000口当たり純資産額)	(21,021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 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
1. 金融商品に対する取組方針
<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク
<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p>
<p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p>
<p>これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p>
<p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</p>
<p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制
<p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</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>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17日現在	
期首	2020年 2月18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	12,554,478,050円
同期中における追加設定元本額	4,280,447,898円
同期中における一部解約元本額	3,564,562,597円
期末元本額	13,270,363,351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)	2,112,526,124円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,769,561,793円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	868,443,445円
野村資産設計ファンド2015	18,581,813円
野村資産設計ファンド2020	18,883,072円
野村資産設計ファンド2025	22,156,161円
野村資産設計ファンド2030	21,491,314円
野村資産設計ファンド2035	22,186,520円
野村資産設計ファンド2040	40,882,842円
野村資産設計ファンド2045	3,518,229円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,580,767,301円
ネクストコア	11,369,461円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	371,149,853円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	458,311,469円
野村資産設計ファンド2050	5,333,840円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,345,706円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,589,852円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,503,668円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,110,309円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,986,029円
野村6資産均等バランス	1,115,485,946円
野村資産設計ファンド2060	1,764,901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	1,881,156,228円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	1,144,893,053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)	505,589,215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)	63,384,336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)	231,495円
野村DC運用戦略ファンド	180,916,205円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	13,876,664円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	5,998,988円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,904,329円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	5,393,171円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	2,468,835円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,122,601円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,023,387円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	455,196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8月17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8月17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	263,697.00	
		AGREE REALTY CORP	12,400	827,824.00	
		ALEXANDERS INC	500	129,550.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	29,110	4,955,104.20	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	11,200	304,192.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	32,000	1,084,480.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	25,000	186,250.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	59,100	1,660,710.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	46,000	1,750,760.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	34,300	1,255,723.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	48,800	478,728.00	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	107,000	36,380.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,560	5,616.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	32,460	4,968,003.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	31,752.00	

BOSTON PROPERTIES	33,120	2,862,561.60	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,000	15,780.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	38,300	430,875.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	67,700	841,511.00	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	12,600	150,318.00	
BRT APARTMENTS CORP	2,400	25,728.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	22,530	1,986,695.40	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	22,300	419,463.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	40,000	8,448.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	16,000	15,065.60	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	73,872.00	
CITY OFFICE REIT INC	10,700	96,086.00	
CLIPPER REALTY INC	2,400	17,904.00	
COLONY CAPITAL INC	112,000	301,280.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	26,600	321,062.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,800	226,608.00	
CORECIVIC INC	27,600	272,412.00	
COREPOINT LODGING INC	8,900	53,934.00	
CORESITE REALTY CORP	9,210	1,127,396.10	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	25,600	650,496.00	
COUSINS PROPERTIES INC	34,000	1,066,240.00	
CUBESMART	44,200	1,368,432.00	
CYRUSONE INC	26,640	2,185,012.80	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	47,000	256,150.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	61,820	9,478,242.40	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	53,000	219,420.00	
DOUGLAS EMMETT INC	38,000	1,096,680.00	
DUKE REALTY CORP	85,100	3,224,439.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	6,800.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	17,300	411,221.00	
EASTGROUP PROPERTIES	9,070	1,208,124.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	34,600	225,246.00	
EPR PROPERTIES	17,900	584,435.00	
EQUINIX INC	20,390	15,537,383.90	

EQUITY COMMONWEALTH	28,000	854,840.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	41,700	2,728,014.00	
EQUITY RESIDENTIAL	80,700	4,389,273.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,600	360,500.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	15,100	3,309,165.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	29,810	3,106,500.10	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	37,400.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	16,060	1,314,992.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	29,100	1,224,528.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	16,000	396,960.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	122,500.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	11,300	110,853.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	47,600	1,782,144.00	
GEO GROUP INC/THE	27,600	308,016.00	
GETTY REALTY CORP	7,900	235,420.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,300	154,048.00	
GLADSTONE LAND CORP	4,200	66,360.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,200	121,808.00	
GLOBAL NET LEASE INC	20,800	366,704.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	31,100	859,293.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	50,300	1,292,710.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	124,300	3,357,343.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,800	53,118.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23,700	901,548.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	163,200	1,836,000.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	35,700	842,163.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	22,200	259,296.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	15,200	324,216.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	4,810	576,767.10	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,700	192,321.00	
INVITATION HOMES INC	125,500	3,598,085.00	
IRON MOUNTAIN INC	66,600	1,980,684.00	
JBG SMITH PROPERTIES	27,400	757,610.00	
KILROY REALTY CORP	24,400	1,418,372.00	

KIMCO REALTY CORP	98,600	1,181,228.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	19,000	218,310.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	62,300	720,188.00	
LIFE STORAGE INC	10,900	1,112,127.00	
LTC PROPERTIES INC	8,800	327,712.00	
MACERICH CO /THE	27,342	218,736.00	
MACK-CALI REALTY CORP	20,900	275,044.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	343,515	257,636.25	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	122,100	2,341,878.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,410	3,033,452.60	
MONMOUTH REIT-CLASS A	22,500	326,475.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	39,900	1,428,420.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	14,000	459,200.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	10,200	650,964.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,000	82,800.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	4,900	202,419.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	11,200	275,856.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	52,100	1,623,957.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,435	63,135.30	
PARAMOUNT GROUP INC	43,000	313,470.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	53,100	502,326.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,700	354,321.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	13,570.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	47,200	859,040.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	28,800	465,696.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	47,668.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	10,600	75,154.00	
PRIME US REIT	90,000	69,300.00	
PROLOGIS INC	170,090	17,403,608.80	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,570	598,167.30	
PUBLIC STORAGE	34,650	6,938,316.00	
QTS REALTY TRUST INC CL A	13,700	920,366.00	
REALTY INCOME CORP	79,200	4,831,992.00	
REGENCY CENTERS CORP	38,900	1,668,032.00	

RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	26,300	314,285.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	50,000	341,500.00	
RETAIL VALUE INC	3,221	42,356.15	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	28,200	1,290,714.00	
RLJ LODGING TRUST	37,300	360,691.00	
RPT REALTY	19,000	123,310.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,600	471,114.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	48,000	714,720.00	
SAFEHOLD INC	3,100	166,439.00	
SAUL CENTERS INC	2,700	83,592.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	8,000	101,760.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	37,000	310,800.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	70,500	4,806,690.00	
SITE CENTERS CORP	34,000	274,040.00	
SL GREEN REALTY CORP	17,600	833,888.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	23,300	833,674.00	
STAG INDUSTRIAL INC	34,500	1,124,700.00	
STORE CAPITAL CORP	51,200	1,293,312.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	24,000	148,320.00	
SUN COMMUNITIES INC	22,690	3,323,858.10	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	48,500	403,035.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	22,000	141,020.00	
TAUBMAN CENTERS INC	14,200	544,286.00	
TERRENO REALTY CORP	15,500	905,355.00	
UDR INC	67,600	2,367,352.00	
UMH PROPERTIES INC	8,400	113,148.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,940	211,297.80	
URBAN EDGE PROPERTIES	24,900	271,908.00	
URSTADT BIDDLE-CL A	6,900	72,381.00	
VENTAS INC	86,100	3,495,660.00	
VEREIT INC	248,000	1,664,080.00	
VICI PROPERTIES INC	107,400	2,462,682.00	
VORNADO REALTY TRUST	36,500	1,298,670.00	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	42,000	29,555.40	
WASHINGTON REAL ESTATE INV	18,600	419,244.00	

小計	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	27,400	518,682.00	
	WELLTOWER INC	96,300	5,465,025.00	
	WHITESTONE REIT	9,600	65,760.00	
	WP CAREY INC	39,500	2,798,575.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	26,300	241,434.00	
	銘柄数：157	5,798,253	194,253,121.70	
	組入時価比率：74.2%		(20,697,670,117)	74.8%
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,700	535,670.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	138,400.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,600	173,152.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19,300	903,047.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	33,600	428,736.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,000	148,050.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	10,900	142,899.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	12,200	169,824.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	15,700	174,270.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,800	135,456.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	24,900	358,560.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,400	488,320.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	33,200	343,288.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	15,000	195,000.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	11,400	202,008.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,000	73,400.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,600	70,932.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	7,200	249,840.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20,600	234,428.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	35,400	549,408.00	
	SLATE OFFICE REIT	5,900	22,892.00	
	SLATE RETAIL REIT	4,300	39,775.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	17,000	351,900.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	15,000	180,900.00	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	10,000	58,800.00		

	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	9,200	163,852.00	
小計	銘柄数：26	378,900	6,532,807.00	
			(524,845,714)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
ユーロ	AEDIFICA	6,160	609,840.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	35,800	452,154.00	
	ALTAREA	840	104,664.00	
	BEFIMMO S.C.A.	5,200	203,580.00	
	COFINIMMO	5,720	708,136.00	
	COVIVIO	11,030	688,823.50	
	EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA	8,800	90,992.00	
	GECINA SA	12,700	1,452,880.00	
	HAMBORNER REIT AG	16,000	137,232.00	
	HIBERNIA REIT PLC	156,000	184,704.00	
	ICADE	6,420	363,051.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,000	31,400.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	55,900	406,393.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	5,300	119,250.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	100,000	150,000.00	
	KLEPIERRE	47,900	731,912.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,000	66,220.00	
	MERCIALYS	5,200	32,318.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	84,500	646,425.00	
	MONTEA	2,570	250,061.00	
	NSI NV	3,700	112,480.00	
	RETAIL ESTATES	2,600	144,560.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	31,600	1,355,956.00	
	VASTNED RETAIL NV	4,600	115,000.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,400	849,219.00	
	WERELDHAVE NV	10,000	73,400.00	
小計	銘柄数：26	671,940	10,080,650.50	
			(1,272,178,093)	
	組入時価比率：4.6%		4.6%	
英ポンド	AEW UK REIT PLC	32,000	25,792.00	
	ASSURA PLC	618,000	501,816.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	37,300	387,920.00	

	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	190,000	131,670.00
	BRITISH LAND	219,000	802,197.00
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	200,000	257,200.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	9,300	6,937.80
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	146,000	160,600.00
	DERWENT LONDON PLC	24,200	681,472.00
	ELITE COMMERCIAL REIT	60,000	40,200.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	146,000	97,820.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	58,100	348,600.00
	HAMMERSON PLC	181,000	92,129.00
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	3,267.84
	LAND SECURITIES GROUP PLC	173,000	986,100.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	206,000	496,460.00
	LXI REIT PLC	123,000	132,840.00
	NEWRIVER REIT PLC	63,000	38,934.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	131,000	89,997.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	298,000	454,748.00
	RDI REIT PLC	56,000	48,720.00
	REGIONAL REIT LTD	100,000	81,000.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	47,700	368,721.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	110,000	37,290.00
	SEGRO PLC	274,900	2,647,836.80
	SHAFTESBURY PLC	50,400	260,820.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	80,000	85,600.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	386,000	607,564.00
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	198,000	133,650.00
	UNITE GROUP PLC	92,500	869,500.00
	WORKSPACE GROUP PLC	30,400	174,192.00
小計	銘柄数：31	4,524,800	11,051,594.44
			(1,542,360,520)
	組入時価比率：5.5%		5.6%
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	86,000	233,920.00
	APN INDUSTRIA REIT	30,000	73,200.00
	ARENA REIT	63,000	153,090.00
	BWP TRUST	119,000	479,570.00

	CENTURIA OFFICE REIT	88,000	171,600.00	
	CHARTER HALL GROUP	107,000	1,194,120.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	96,000	457,920.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	110,000	357,500.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	68,000	174,760.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	430,000	384,850.00	
	DEXUS	253,000	2,140,380.00	
	GDI PROPERTY GROUP	130,000	137,150.00	
	GOODMAN GROUP	375,300	6,909,273.00	
	GPT GROUP	445,000	1,691,000.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	68,000	219,640.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	40,000	118,000.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	65,000	306,150.00	
	MIRVAC GROUP	898,000	1,885,800.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	219,000	402,960.00	
	RURAL FUNDS GROUP	80,000	174,400.00	
	SCENTRE GROUP	1,201,000	2,498,080.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	247,000	528,580.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	548,000	1,912,520.00	
	VICINITY CENTRES	900,000	1,228,500.00	
	WAYPOINT REIT LTD	161,000	418,600.00	
小計	銘柄数：25	6,827,300	24,251,563.00	
			(1,856,942,178)	
	組入時価比率：6.7%		6.7%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	180,000	221,400.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	250,000	568,750.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	360,000	351,000.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	250,000	417,500.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	80,000	215,200.00	
小計	銘柄数：5	1,120,000	1,773,850.00	
			(123,548,652)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
香港ドル	CHAMPION REIT	460,000	1,872,200.00	
	FORTUNE REIT	320,000	2,134,400.00	
	LINK REIT	474,900	29,752,485.00	

小計	PROSPERITY REIT	260,000	639,600.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	240,000	885,600.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	340,000	1,230,800.00
	銘柄数：6	2,094,900	36,515,085.00 (502,082,418)
	組入時価比率：1.8%		1.8%
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	91,000	107,380.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	209,860	136,409.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	687,760	2,365,894.40
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	429,956	380,511.06
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	659,964	1,069,141.68
	CAPITALAND MALL TRUST	661,000	1,242,680.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	181,136	211,929.12
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	200,000	206,000.00
	ESR REIT	509,760	196,257.60
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	200,000	100,000.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	120,000	71,400.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	169,596	395,158.68
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000	60,900.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	545,746	725,842.18
	KEPPEL DC REIT	281,211	821,136.12
	KEPPEL REIT	443,000	482,870.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	160,000	100,800.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	350,000	42,350.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	497,716	950,637.56
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	354,000	1,100,940.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	697,000	1,477,640.00
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	460,000	402,500.00
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	610,216	225,779.92
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	91,000	322,140.00
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,764	80,213.86
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	103,000	79,825.00
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	161,306	66,135.46	
SPH REIT	210,000	180,600.00	

小計	STARHILL GLOBAL REIT	330,000	146,850.00	
	SUNTEC REIT	532,000	728,840.00	
	銘柄数：30	10,305,991	14,478,761.64	(1,126,013,292)
	組入時価比率：4.0%			4.1%
ウォン	LOTTE REIT CO LTD	20,000	103,800,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,546	43,269,060.00	
小計	銘柄数：2	26,546	147,069,060.00	(13,236,215)
	組入時価比率：0.0%			0.0%
新シェケル	REIT 1 LTD	40,000	544,400.00	
	銘柄数：1	40,000	544,400.00	(17,039,720)
小計	組入時価比率：0.1%			0.1%
合計			27,675,916,919	(27,675,916,919)

(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 8月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	180,932,555	-	184,463,622	3,531,067
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	189,760,640	-	189,369,200	391,440
米ドル	145,272,480	-	144,894,400	378,080
カナダドル	3,233,320	-	3,213,200	20,120
ユーロ	10,097,920	-	10,096,000	1,920
英ポンド	11,165,920	-	11,164,000	1,920
豪ドル	13,761,720	-	13,780,800	19,080

シンガポールドル	6,229,280	-	6,220,800	8,480
合計	-	-	-	3,139,627

(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。

野村マネー マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2020年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,006,061,351
地方債証券	790,866,071
特殊債券	802,235,012
社債券	571,341,652
未収利息	1,915,379
前払費用	1,875,125
流動資産合計	3,174,294,590
資産合計	3,174,294,590
負債の部	
流動負債	
未払解約金	14,022,000
未払利息	1,231
流動負債合計	14,023,231
負債合計	14,023,231
純資産の部	
元本等	
元本	3,097,537,311
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	62,734,048
元本等合計	3,160,271,359

(2020年 8月17日現在)

純資産合計	3,160,271,359
負債純資産合計	3,174,294,590

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17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	1.0203円
(10,000口当たり純資産額)	(10,203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 2020年 2月18日 至 2020年 8月17日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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	
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 8月17日現在	
期首	2020年 2月18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	7,847,419,034円
同期中における追加設定元本額	979,451,606円
同期中における一部解約元本額	5,729,333,329円
期末元本額	3,097,537,311円
期末元本額の内訳*	
野村世界業種別投資シリーズ(マネープール・ファンド)	199,303,709円
ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド)	102,650,304円
野村グローバルC B 投信(マネープールファンド)年2回決算型	836,392円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネープールファンド)年2回決算型	1,861,159円
ネクストコア	2,282,012円
野村世界高金利通貨投信	151,953,753円
野村新世界高金利通貨投信	982,608円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826円
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260円

野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,261円
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,607円
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260円
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村アジアC B投信(毎月分配型)	982,608円
野村グローバルC B投信(円コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(円コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543円

ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	984,252円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672円
野村テンプレトン・トータル・リターン Aコース	983,381円
野村テンプレトン・トータル・リターン Bコース	98,261円
野村テンプレトン・トータル・リターン Cコース	983,381円
野村テンプレトン・トータル・リターン Dコース	983,381円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,262円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円

野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801円
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029円
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547円
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547円
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	966円
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	177,539円
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	398,357円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	123,377円
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	626,503円
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	23,859円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	27,600円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型	149,947円
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092円
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	3,114円
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	132,547円
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	100,946円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	18,851円
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型	373,897円
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	41,054円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	14,308円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	63,772円
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741円
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451円
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451円
ノムラ THE USA Aコース	981,258円
ノムラ THE USA Bコース	981,258円
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117円
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117円
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809円
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808円

野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807円
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803円
野村新興国高配当株トリプルウイング ブラジルリアル毎月分配型	9,803円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801円
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801円
グローバル・ストック Aコース	97,953円
グローバル・ストック Bコース	979,528円
グローバル・ストック Cコース	97,953円
グローバル・ストック Dコース	979,528円
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795円
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797円
(年3%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型)	98,001円
(年6%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型)	98,001円
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421円
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169円

第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897円
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981円
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729円
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981円
第7回 野村短期公社債ファンド	686,093円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831円
第10回 野村短期公社債ファンド	391,715円
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757円
第12回 野村短期公社債ファンド	6,664,982円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	287,434,434円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	2,050,866,611円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Lプライス(適格機関投資家専用)	61,746,546円
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134円
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Aコース	9,818円
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Bコース	9,818円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405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8月17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8月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	日本円	東京都 公募第687回	100,000,000	100,097,000	
		神奈川県 公募(5年)第66回	200,000,000	200,070,752	
		共同発行市場地方債 公募第90回	100,000,000	100,115,860	
		共同発行市場地方債 公募第92回	190,000,000	190,541,257	
		北九州市 公募(5年)平成27年度第1回	200,000,000	200,041,202	
	小計	銘柄数:5 組入時価比率:25.0%	790,000,000	790,866,071	36.5%
合計			790,866,071		
特殊債券	日本円	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第115回	22,000,000	22,008,266	
		日本政策金融公庫債券 政府保証第32回	120,000,000	120,025,520	
		農林債券 利付第783回い号	110,000,000	110,012,571	
		しんきん中金債券 利付第313回	190,000,000	190,153,712	
		商工債券 利付(3年)第211回	200,000,000	200,012,887	

		中日本高速道路 第62回	100,000,000	100,020,856	
		西日本高速道路 第44回	60,000,000	60,001,200	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：25.4%	802,000,000	802,235,012	37.1%
	合計			802,235,012	
社債券	日本円	関西電力 第484回	100,000,000	100,170,640	
		関西電力 第485回	100,000,000	100,425,542	
		東北電力 第456回	170,000,000	170,540,338	
		九州電力 第433回	200,000,000	200,205,132	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：18.1%	570,000,000	571,341,652	26.4%
	合計			571,341,652	
合計				2,164,442,735	

(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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ネクストコア

2020年9月30日現在

資産総額	2,505,301,835円
負債総額	719,665,525円
純資産総額（ - ）	1,785,636,310円
発行済口数	1,702,409,194口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0489円

（参考）国内株式マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	505,922,190,203円
負債総額	50,957,102,808円
純資産総額（ - ）	454,965,087,395円
発行済口数	270,880,440,393口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6796円

（参考）国内債券マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	29,978,532,702円
負債総額	141,902,534円
純資産総額（ - ）	29,836,630,168円
発行済口数	21,829,252,258口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3668円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	701,033,646,075円
負債総額	4,958,161,433円
純資産総額（ - ）	696,075,484,642円
発行済口数	231,449,229,089口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0075円

（参考）外国債券マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	596,625,524,856円
負債総額	815,655,869円
純資産総額（ - ）	595,809,868,987円
発行済口数	240,898,074,685口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4733円

（参考）新興国株式マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	44,520,089,188円
負債総額	275,590,993円
純資産総額（ - ）	44,244,498,195円
発行済口数	34,924,688,086口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2669円

（参考）新興国債券マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	20,948,259,831円
負債総額	427,508,499円
純資産総額（ - ）	20,520,751,332円
発行済口数	10,503,707,440口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9537円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	7,563,042,297円
負債総額	18,942,903円
純資産総額（ - ）	7,544,099,394円
発行済口数	5,855,228,766口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2884円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	39,080,863,223円
負債総額	1,350,249,596円
純資産総額（ - ）	37,730,613,627円
発行済口数	17,103,251,287口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2060円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	27,734,769,883円
負債総額	45,842,941円
純資産総額（ - ）	27,688,926,942円
発行済口数	13,636,196,943口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0305円

（参考）野村マネー マザーファンド

2020年9月30日現在

資産総額	3,060,603,191円
負債総額	2,291円
純資産総額（ - ）	3,060,600,900円
発行済口数	2,999,950,400口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0202円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2020年9月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

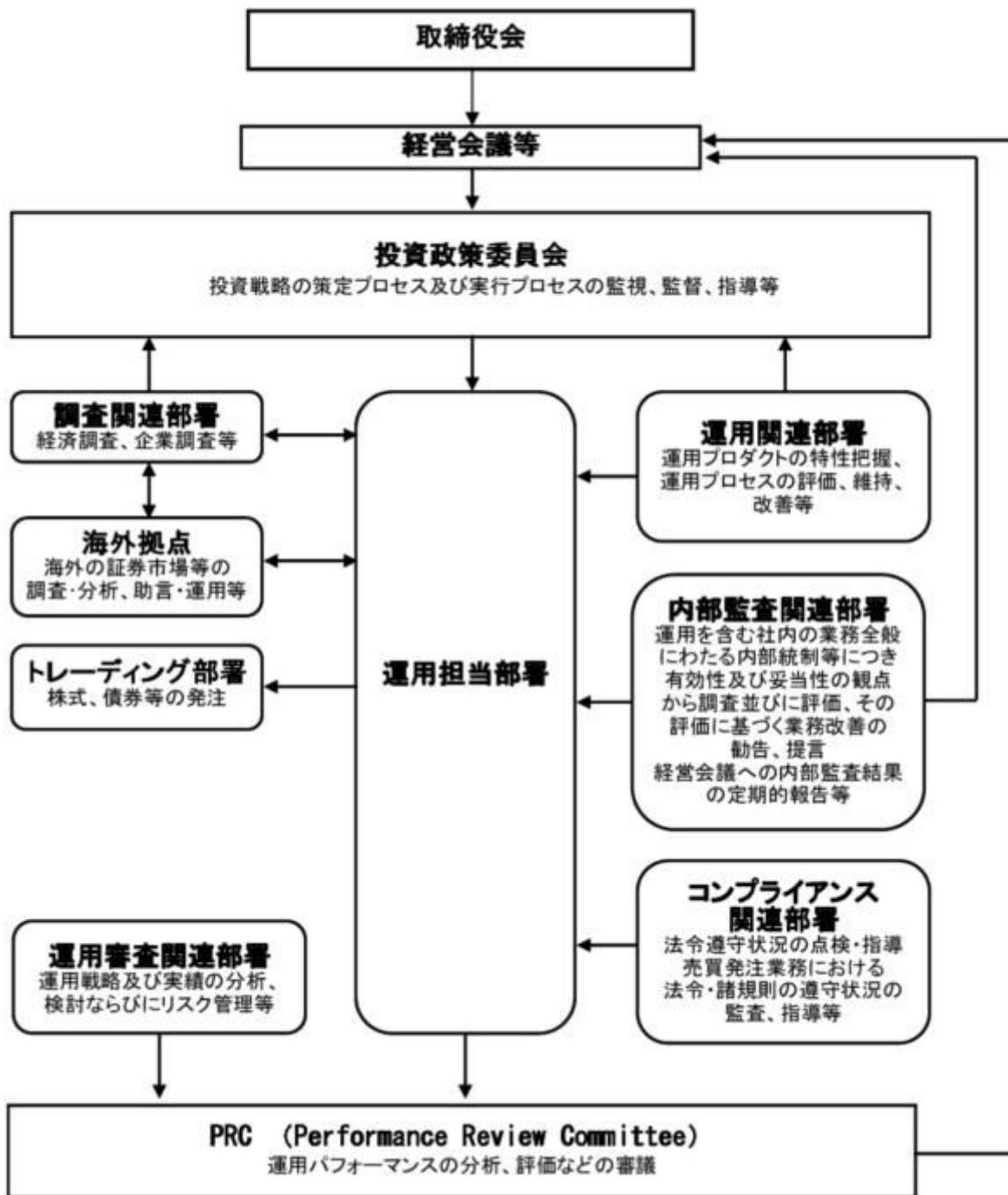
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年8月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	995	31,243,464
単位型株式投資信託	190	843,872
追加型公社債投資信託	14	5,773,710
単位型公社債投資信託	466	1,610,601
合計	1,665	39,471,646

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	当事業年度
		(2019年3月31日)	(2020年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		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			
建物	2	320	295
器具備品	2	393	349
無形固定資産			
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		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,014		54,360
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10

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

(2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (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
經常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
						別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826

当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位:百万円)

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

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

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

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

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

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

貸借対照表関係

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

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

損益計算書関係

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

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

基準日 2019年3月31日
効力発生日 2019年6月28日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

ます。

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2019年3月31日)

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

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2020年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2020年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。

税効果会計関係

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	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国源泉税	0.3%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.2%
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	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託 の募集の取扱 及び売上の取 扱ならびに投 資信託に係る 事務代行の委 託等 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払(*2)	34,646	未払手数料	6,410

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

* 2020年8月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社S B I証券	48,323百万円	
a uカブコム証券株式会社	7,196百万円	
ぐんぎん証券株式会社	3,000百万円	
七十七証券株式会社	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	
F F G証券株式会社	3,000百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社愛知銀行	18,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
株式会社大分銀行	19,598百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	

株式会社熊本銀行	33,847百万円
株式会社佐賀銀行	16,062百万円
株式会社七十七銀行	24,658百万円
株式会社十八親和銀行	36,878百万円
株式会社十六銀行	36,839百万円
株式会社常陽銀行	85,113百万円
株式会社第四銀行	32,776百万円
株式会社但馬銀行	5,481百万円
株式会社千葉銀行	145,069百万円
株式会社きらぼし銀行	43,734百万円
株式会社南都銀行	37,900百万円
株式会社百五銀行	20,000百万円
株式会社広島銀行	54,573百万円
株式会社福井銀行	17,965百万円
株式会社福岡銀行	82,329百万円
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円
株式会社琉球銀行	56,967百万円

* 2020年8月末現在

株式会社第四銀行は、2021年1月1日付をもって株式会社北越銀行と合併し、株式会社第四北越銀行（資本金：32,776百万円）となる予定です。

2【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 5月 8日	有価証券届出書
2020年 5月 8日	有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

2020年6月10日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2020年10月1日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 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」に掲げられているネクストコアの2020年2月18日から2020年8月17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、ネクストコアの2020年8月17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。