

【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】	2021年5月14日提出
【計算期間】	のむラップ・ファンド（保守型） 第11期 のむラップ・ファンド（やや保守型） 第5期 のむラップ・ファンド（普通型） 第11期 のむラップ・ファンド（やや積極型） 第5期 のむラップ・ファンド（積極型） 第11期 (自 2020年2月19日至 2021年2月18日)
【ファンド名】	のむラップ・ファンド（保守型） のむラップ・ファンド（やや保守型） のむラップ・ファンド（普通型） のむラップ・ファンド（やや積極型） のむラップ・ファンド（積極型）
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【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】

- ◆「のむラップ・ファンド」は、リスク水準が異なるスイッチング可能なファンドで構成されています。
- ◆国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象^{※1}とし、以下の投資方針に基づき分散投資を行ないます。

保守型 ^{※2}	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
やや保守型 ^{※2}	安定した収益の確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。
普通型 ^{※2}	信託財産の成長と安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
やや積極型 ^{※2}	信託財産の成長と安定した収益の確保を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。
積極型 ^{※2}	信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。

- ◆各資産への分散投資を行なうにあたっては、ファンドの投資助言会社である野村證券株式会社^{※3}が、独自に開発したモデルを用い最適化した結果を踏まえ、各ファンドごとに投資配分比率を決定します。

- ※1 各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 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」、「世界REITインデックス 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。
- ※2 「保守型」、「やや保守型」、「普通型」、「やや積極型」、「積極型」の名称は、各ファンド間の相対的なリスク量を表すものです。また、いずれの名称も、元本を確保することを意味するものではありません。
- ※3 野村證券株式会社は金融商品取引法に基づき、投資運用業および投資助言・代理業の登録を行なっています。

■信託金の限度額■

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

<商品分類>

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

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

（のむラップ・ファンド（保守型））

(のむラップ・ファンド（やや保守型）)

(のむラップ・ファンド（普通型）)

(のむラップ・ファンド（やや積極型）)

(のむラップ・ファンド（積極型）)

《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
追加型	内 外	不動産投信
		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	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券、 不動産投信) 資産配分変更型))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型 資産配分変更型				

各ファンドは、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ずファンドをいう。
- (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)MRP(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MRP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。

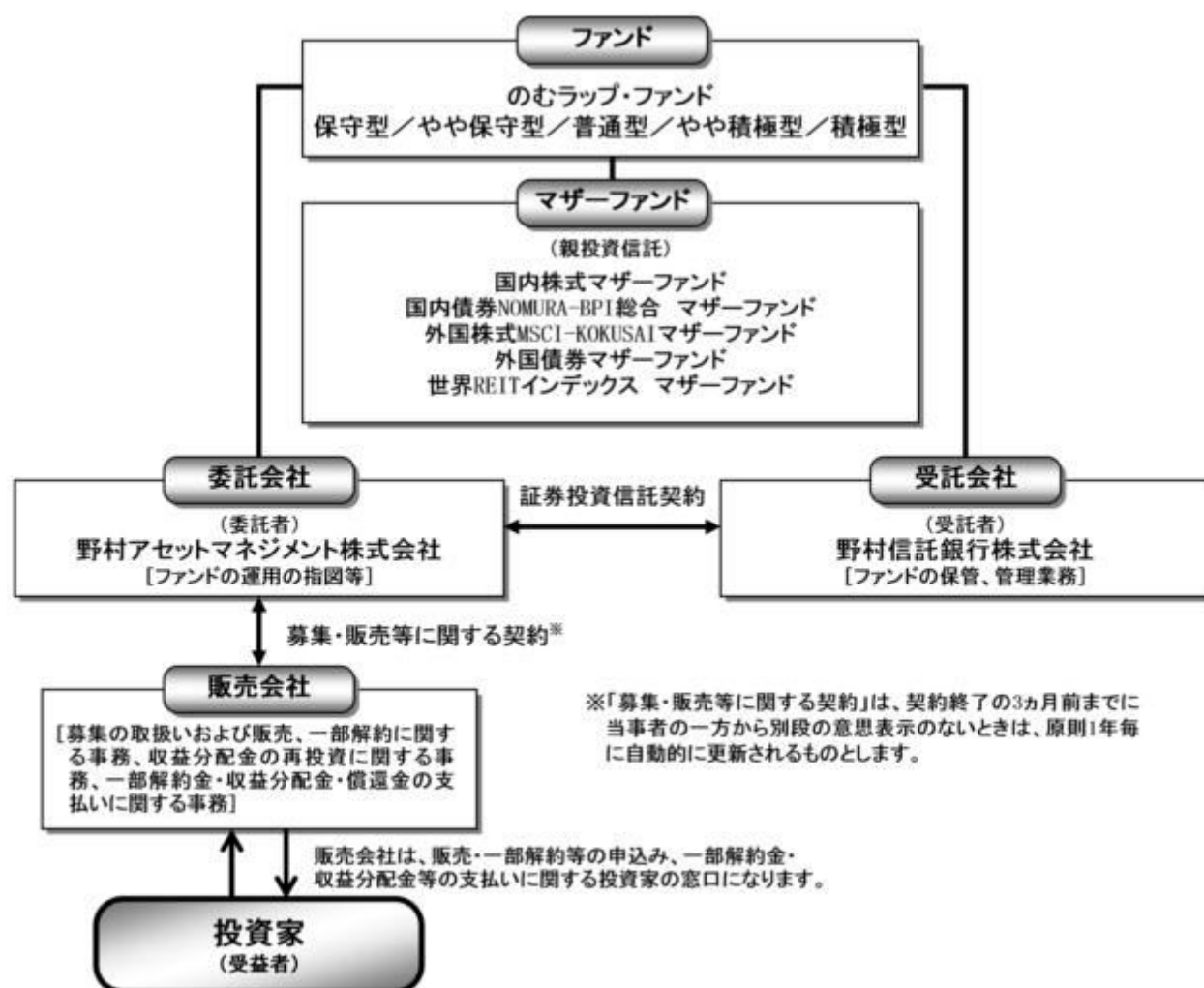
- (2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組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】

2010年3月15日 「保守型」「普通型」「積極型」につき信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

2016年11月11日 「やや保守型」「やや積極型」につき信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

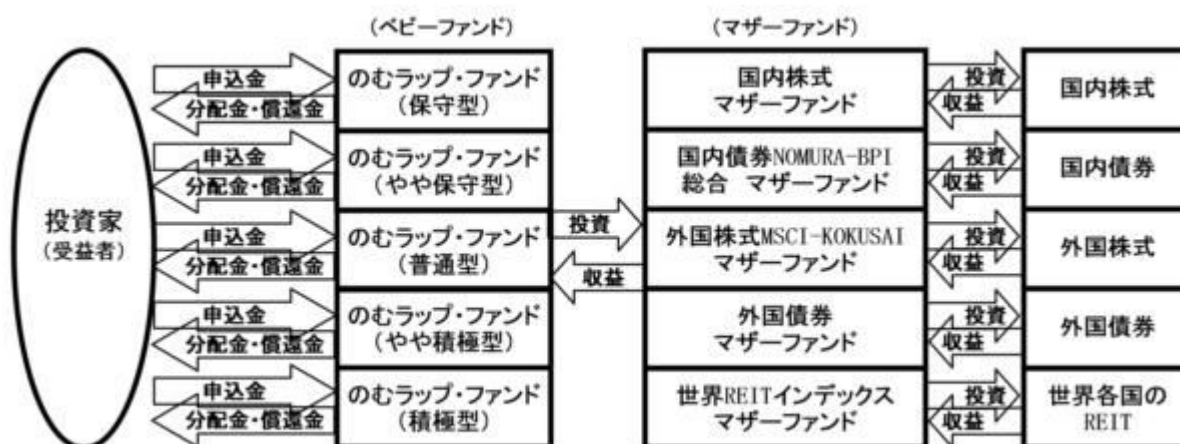
(3) 【ファンドの仕組み】



《ファミリーファンド方式について》

各ファンドは「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 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」、「世界REITインデックス マザーファンド」を親投資信託（マザーファンド）とする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。



＊マザーファンドの運用の方針等については、「第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）各マザーファンドの概要」をご参照ください。

＊販売会社との契約によっては、分配金は税引き後無手数料で再投資されます。

■委託会社の概況(2021年3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] マザーファンドへの投資を通じて、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）に実質的に投資します。

◆運用にあたっては、「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 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」、「世界REITインデック

ス マザーファンド」に投資を行ないます。

保守型	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目的として運用を行ないます。
やや保守型	安定した収益の確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。
普通型	信託財産の成長と安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
やや積極型	信託財産の成長と安定した収益の確保を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。
積極型	信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。

- [2] 各マザーファンドへの投資配分比率は、ファンドの投資助言会社である野村證券株式会社、独自に開発したモデルを用い、各資産の期待リターンや推定リスク、各資産間の相関係数等をもとに最適化した結果を踏まえ決定します。

◆一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

- [3] 各ファンドにおける、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「世界REITインデックス マザーファンド」の各受益証券への投資比率の合計は、信託財産の純資産総額に対して以下のとおりとします。

保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
原則50%以内	原則60%以内	原則75%以内	原則85%以内	制限なし

◆各ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は、上記制限のもと、下記を上限の目処とします。

	保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
国内株式マザーファンド	20%	25%	30%	35%	40%
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	80%	70%	60%	50%	40%
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	30%	35%	45%	50%	60%
外国債券マザーファンド	50%	50%	50%	50%	50%
世界REITインデックスマザーファンド	20%	25%	30%	35%	40%

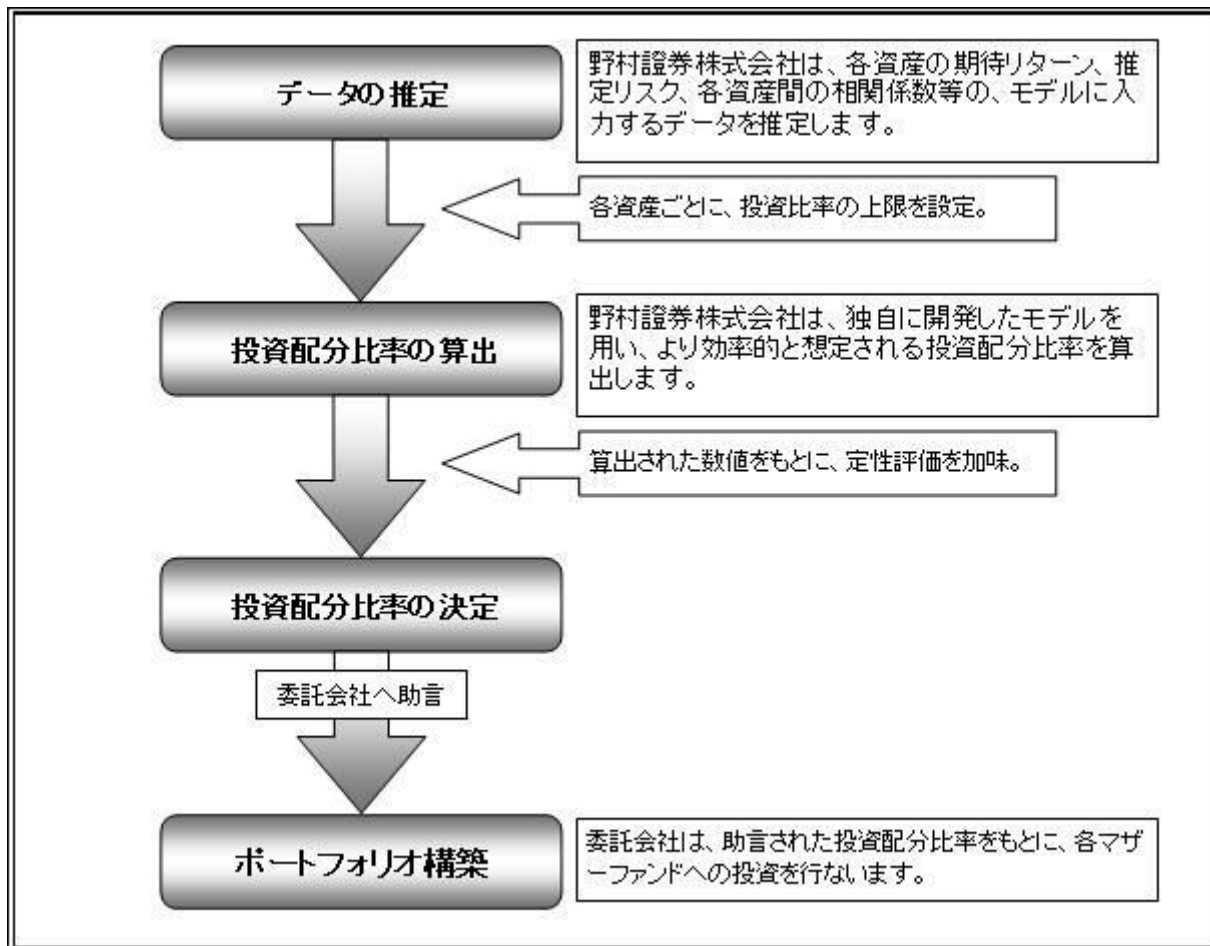
※上記の各マザーファンドへの投資比率の上限の目処は、今後変更される場合があります。また、一時的に上限の目処を超える場合があります。

- [4] 投資配分比率の見直しを定期的に行なうことを基本とします。

◆市況見通しの変化等によっては、適宜リバランスや投資配分比率の見直しを行なう場合があります。

- [5] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

■ポートフォリオ構築プロセス■



※上記のポートフォリオ構築プロセスは、今後変更となる場合があります。

■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〕

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

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

東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所（以下「**㈱東京証券取引所**」といいます。）の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価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。

㈱東京証券取引所は、TOPIXの算出若しくは公表の方法の変更、TOPIX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なう権利を有しています。

〔国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド〕

- ・主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

「NOMURA-BPI総合」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債券の市場全体の動向を表す投資収益指標で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

NOMURA-BPI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〕

- ・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。

※配当再投資・GROSS（税込）の指数とします。

- ・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。同指数の著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

[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。

[世界REITインデックス マザーファンド]

- ・世界各国のREITを主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（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いません。

「S&P先進国REIT指数（配当込み、円換算ベース）」は、S&P先進国REIT指数（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指数です。

■各マザーファンドが対象とする指数等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）」

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

■国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンドについて■

「NOMURA-BPI総合」

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

■外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて■

「MSCI」

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

■世界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指数の一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックする能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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】

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）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す。

◆各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 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」、「世界REITインデックス マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）に投資を行います。

※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。

■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NOMURA-BPI総合 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。
世界REITインデックス マザーファンド	世界各国のREITを主要投資対象とします。

◆なお、デリバティブの直接利用は行ないません。

<各ファンドに共通>

①投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限るものとします。）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. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ハ. 金銭債権（イ及びロに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

②有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託者は、信託金を、主として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の受益証券、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンドの受益証券、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドの受益証券、外国債券マザーファンドの受益証券、世界REITインデックス マザーファンドの受益証券のほか、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くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（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および短期社債等を除きます。）
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行なうことができるものとします。

③金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記②に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

(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

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

(3) 投資制限

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

（国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド） 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動

する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

② 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 株式への投資は行ないません。

② 外貨建資産への投資は行ないません。

③ 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

④ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

③ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ④ 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。
- ⑤ スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。
- ⑥ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑦ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑧ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ⑨ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債[※]への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

※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。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑪ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国債券マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

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

（世界REITインデックス マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、S&P先進国REIT指数（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。

2. 運用方法

（1）投資対象

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。

※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。

（2）投資態度

- ① 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。
- ② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
- ③ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

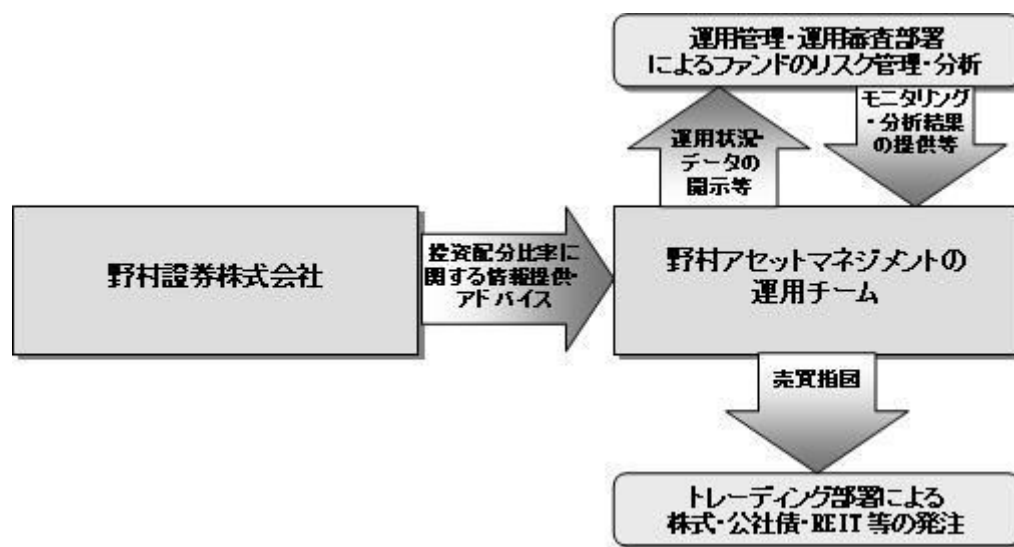
（3）投資制限

- ① 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ 株式への直接投資は行ないません。
- ④ 不動産投信指数先物取引は約款第15条の2の範囲で行ないます。
- ⑤ 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（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（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。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

⑦ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（３）【運用体制】

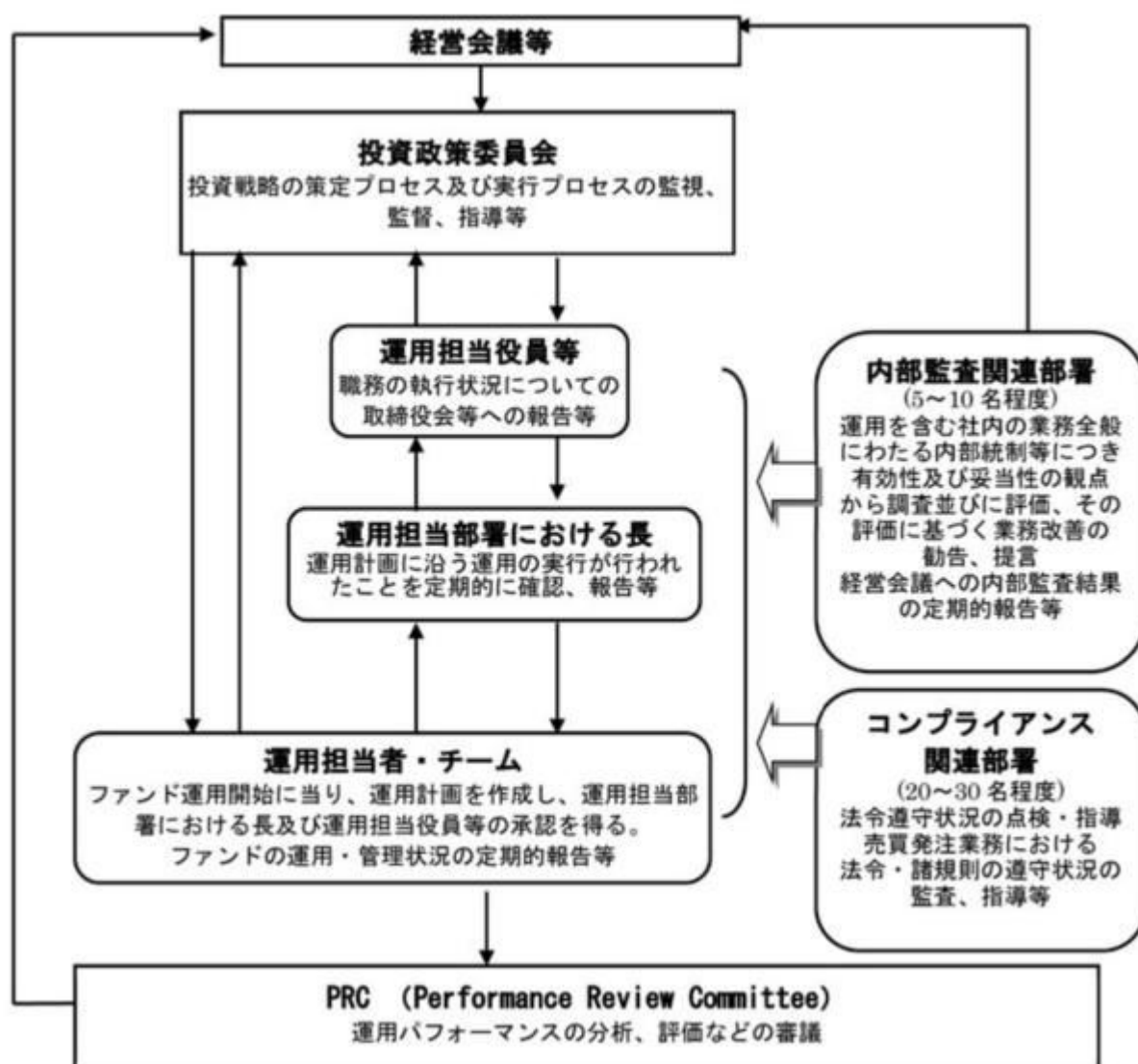
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※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ないます。

- ① 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、上記①の範囲内で、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。
- ③ 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行な

います。

※利子・配当等収益とは、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

※売買益とは、売買損益に評価損益を加減した利益金額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。

なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

※毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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

◆ファンドの決算日

原則として毎年2月18日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

◆分配金のお支払い

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

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、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。

（５）【投資制限】

＜各ファンドに共通＞

①外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への直接投資は行ないません。

②デリバティブの使用(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

デリバティブの直接利用は行ないません。

③株式への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

株式への直接投資は行ないません。

④公社債の借入れ(約款第19条)

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

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

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

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

(iv) 上記(i)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

⑤資金の借入れ(約款第25条)

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

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

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

(iv) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。（運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限）

3【投資リスク】

＜基準価額の変動要因＞

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

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

【株価変動リスク】

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

【REITの価格変動リスク】

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

【債券価格変動リスク】

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

【為替変動リスク】

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

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

《その他の留意点》

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
- 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- 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。
- ファンドで使用するモデルは、委託会社が信頼できると判断したデータ等の評価に基づき採用しておりますが、今後の運用成果を保証するものではありません。また、今後使用するモデルが変更となる場合があります。
- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

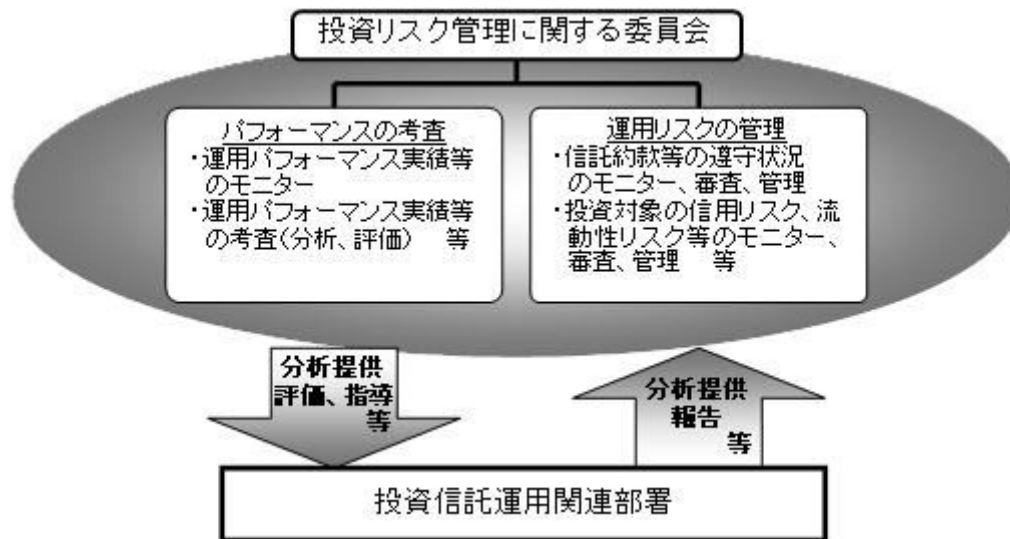
《委託会社におけるリスクマネジメント体制》**リスク管理関連の委員会****◆パフォーマンスの考査**

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

◆運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



※投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較（2016年4月末～2021年3月末：月次）

■ 保守型

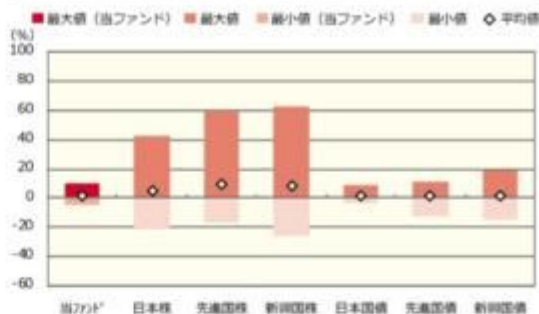
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



	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 (%)	10.2	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 4.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.3	△ 4.0	△ 12.3	△ 15.0
平均値 (%)	1.3	5.2	8.9	7.7	1.1	1.3	1.9

- * 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。2016年4月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2016年4月から2021年3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。

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 (%)	10.2	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 4.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.3	△ 4.0	△ 12.3	△ 15.0
平均値 (%)	1.3	5.2	8.9	7.7	1.1	1.3	1.9

- * 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。
- * 2016年4月から2021年3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。

■ やや保守型

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



	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 (%)	16.7	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 6.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.3	△ 4.0	△ 12.3	△ 15.0
平均値 (%)	2.6	5.2	8.9	7.7	1.1	1.3	1.9

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年11月から2021年3月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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 (%)	16.7	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 6.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.3	△ 4.0	△ 12.3	△ 15.0
平均値 (%)	2.6	5.2	8.9	7.7	1.1	1.3	1.9

- * 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。
- * 2016年4月から2021年3月の5年間（当ファンドは2017年11月から2021年3月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

■普通型

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



2016年4月 2017年3月 2018年3月 2019年3月 2020年3月 2021年3月

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 (%)	24.6	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 11.4	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.3	△ 4.0	△ 12.3	△ 15.0
平均値 (%)	2.8	5.2	8.9	7.7	1.1	1.3	1.9

- * 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。2016年4月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2016年4月から2021年3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。
- * 2016年4月から2021年3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。

■やや積極型

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



2016年4月 2017年3月 2018年3月 2019年3月 2020年3月 2021年3月

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 (%)	30.7	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 9.4	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.3	△ 4.0	△ 12.3	△ 15.0
平均値 (%)	3.9	5.2	8.9	7.7	1.1	1.3	1.9

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年11月から2021年3月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 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。
- * 2016年4月から2021年3月の5年間（当ファンドは2017年11月から2021年3月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

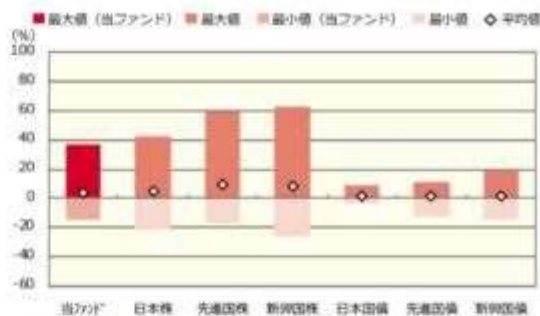
積極型

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



2016年4月 2017年3月 2018年3月 2019年3月 2020年3月 2021年3月

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 (%)	36.7	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 14.6	△ 22.0	△ 17.5	△ 26.3	△ 4.0	△ 12.3	△ 15.0
平均値 (%)	4.1	5.2	8.9	7.7	1.1	1.3	1.9

* 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。2016年4月末を10,000として指数化しております。

* 年間騰落率は、2016年4月から2021年3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。
 * 2016年4月から2021年3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-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・カバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバリ・ディバーシファイド（円ベース）

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所に所有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
 - MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではありません。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・カバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバリ・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・カバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバリ・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイス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、その他の情報は強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、JPMC）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、JPMC やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「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）についての提供、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, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

- ①各ファンドにつき、取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%(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1.0%)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ください。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせくだ
さい。
- ②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、各ファンドについて、ファンドの計算期間を通じて毎日、当該ファンドの純資産総額
に下記の信託報酬率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

ファンド	信託報酬率	<委託会社>	<販売会社>	<受託会社>
保守型	年1.188% (税抜年1.08%)	年0.70%	年0.35%	年0.03%
やや保守型	年1.2705% (税抜年1.155%)	年0.75%	年0.375%	年0.03%
普通型	年1.353% (税抜年1.23%)	年0.80%	年0.40%	年0.03%
やや積極型	年1.4355% (税抜年1.305%)	年0.85%	年0.425%	年0.03%
積極型	年1.518% (税抜年1.38%)	年0.90%	年0.45%	年0.03%

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

- ◆投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬から、毎年2月および8月ならびに信託契約終了の
とき支払うものとし、その報酬額は、各ファンドの日々の平均純資産総額に、次の率を乗じて得た額とし
ます。

ファンド	率
保守型	年0.35%
やや保守型	年0.375%
普通型	年0.40%
やや積極型	年0.425%
積極型	年0.45%

《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】

- ①ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息はファンドから支払われます。
- ②ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。
- ③ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。
- ④監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときにファンドから支払われます。
- ⑤ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額[※]をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口当たりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

＜収益分配金に対する課税＞

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

なお、配当控除は適用されません。

＜換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税＞

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

《損益通算について》

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(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■

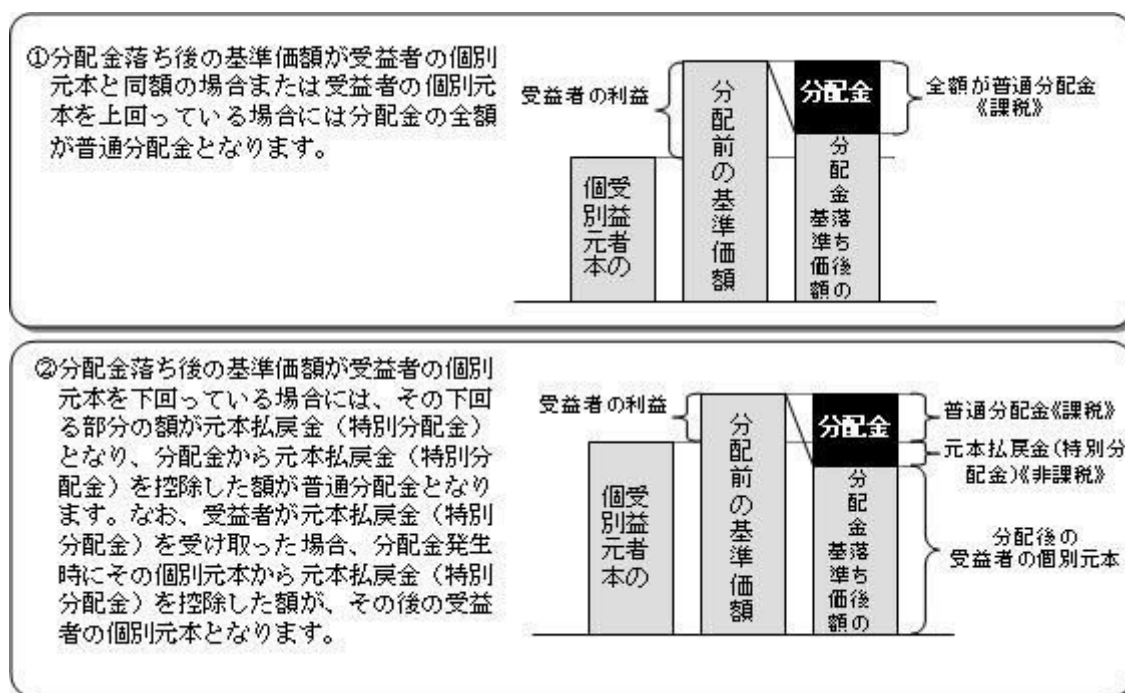
◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

◆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（2021年3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2021年3月31日現在の運用状況であります。

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

（1）【投資状況】

のむラップ・ファンド（保守型）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	42,197,970,145	98.98
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	431,426,947	1.01
合計（純資産総額）		42,629,397,092	100.00

のむラップ・ファンド（やや保守型）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,260,759,816	98.83

現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	50,413,664	1.16
合計（純資産総額）		4,311,173,480	100.00

のむラップ・ファンド（普通型）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	108,589,287,897	98.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,197,926,110	1.09
合計（純資産総額）		109,787,214,007	100.00

のむラップ・ファンド（やや積極型）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,769,253,335	98.75
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	60,009,884	1.24
合計（純資産総額）		4,829,263,219	100.00

のむラップ・ファンド（積極型）

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	42,396,879,550	98.81
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	509,942,359	1.18
合計（純資産総額）		42,906,821,909	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	404,389,953,700	96.99
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	12,538,720,079	3.00
合計（純資産総額）		416,928,673,779	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	11,821,700,000	2.83

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	590,339,899,350	80.22
地方債証券	日本	50,873,297,349	6.91
特殊債券	日本	63,369,110,347	8.61
社債券	日本	27,858,685,550	3.78
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	3,388,861,160	0.46
合計（純資産総額）		735,829,853,756	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	637,322,181,845	68.70
	カナダ	32,007,240,079	3.45
	ドイツ	28,216,956,817	3.04
	イタリア	7,362,843,137	0.79
	フランス	32,220,466,392	3.47
	オランダ	13,090,504,321	1.41
	スペイン	7,107,206,740	0.76
	ベルギー	2,571,649,391	0.27
	オーストリア	555,573,984	0.05
	ルクセンブルグ	364,810,948	0.03
	フィンランド	3,017,967,534	0.32
	アイルランド	2,145,117,634	0.23
	ポルトガル	468,486,621	0.05
	イギリス	42,469,387,046	4.57
	スイス	27,558,293,022	2.97
	スウェーデン	10,827,128,050	1.16
	ノルウェー	1,879,901,395	0.20
	デンマーク	7,011,995,740	0.75
	オーストラリア	19,500,444,223	2.10
	ニュージーランド	766,238,813	0.08
	香港	9,247,951,369	0.99
	シンガポール	2,904,994,012	0.31
	イスラエル	937,058,248	0.10
	小計	889,554,397,361	95.89
投資証券	アメリカ	16,959,169,738	1.82
	カナダ	108,187,621	0.01
	フランス	491,711,085	0.05
	イギリス	498,023,489	0.05
	オーストラリア	1,380,866,906	0.14

	香港	416,876,000	0.04
	シンガポール	436,056,176	0.04
	小計	20,290,891,015	2.18
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	17,802,962,725	1.91
合計（純資産総額）		927,648,251,101	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	12,893,134,369	1.38
	買建	カナダ	625,274,496	0.06
	買建	ドイツ	1,924,902,848	0.20
	買建	イギリス	850,531,078	0.09
	買建	スイス	542,273,694	0.05
	買建	オーストラリア	410,390,310	0.04

（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	253,168,924,521	43.45
	カナダ	11,590,769,687	1.98
	メキシコ	4,581,651,998	0.78
	ドイツ	40,089,723,771	6.88
	イタリア	58,761,545,906	10.08
	フランス	58,593,627,535	10.05
	オランダ	9,411,680,585	1.61
	スペイン	37,423,465,774	6.42
	ベルギー	14,220,784,120	2.44
	オーストリア	8,192,179,436	1.40
	フィンランド	2,723,935,547	0.46
	アイルランド	8,105,929,666	1.39
	イギリス	38,756,501,747	6.65
	スウェーデン	1,882,219,911	0.32
	ノルウェー	1,468,223,851	0.25
	デンマーク	2,895,478,925	0.49
	ポーランド	3,709,806,600	0.63
	オーストラリア	13,360,925,923	2.29
	シンガポール	2,533,618,071	0.43
	マレーシア	2,809,970,565	0.48
	イスラエル	2,569,621,116	0.44

	小計	576,850,585,255	99.01
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	5,740,409,894	0.98
合計（純資産総額）		582,590,995,149	100.00

（参考）世界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	7,683,204,910	9.46
	アメリカ	54,182,758,317	66.73
	カナダ	1,409,025,786	1.73
	ドイツ	195,647,280	0.24
	イタリア	12,396,652	0.01
	フランス	1,714,918,573	2.11
	オランダ	146,063,745	0.17
	スペイン	339,503,582	0.41
	ベルギー	946,101,167	1.16
	アイルランド	90,756,599	0.11
	シンガポール	42,392,680	0.05
	イギリス	4,259,825,903	5.24
	オーストラリア	5,131,059,229	6.31
	ニュージーランド	328,560,896	0.40
	香港	1,281,087,360	1.57
	シンガポール	2,733,682,146	3.36
	韓国	103,684,643	0.12
	イスラエル	43,073,982	0.05
	小計	80,643,743,450	99.31
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	552,195,404	0.68
合計（純資産総額）		81,195,938,854	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	56,126,000	0.06
株価指数先物取引	買建	アメリカ	365,754,839	0.45

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

のむラップ・ファンド（保守型）

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA－BPI 総 合 マザーファンド	13,035,131,169	1.3231	17,247,049,045	1.3248	17,268,941,772	40.50
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	5,625,299,683	2.4718	13,904,696,952	2.5111	14,125,690,033	33.13
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	2,253,976,097	2.0095	4,529,364,967	2.0408	4,599,914,418	10.79
4	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックス マ ザーファンド	1,569,569,910	1.8197	2,856,267,561	1.9797	3,107,277,550	7.28
5	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSA Iマザーファンド	819,498,259	3.6020	2,951,832,729	3.7781	3,096,146,372	7.26

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	98.98
合 計	98.98

のむラップ・ファンド（やや保守型）

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	559,019,985	2.4725	1,382,219,646	2.5111	1,403,755,084	32.56
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA－BPI 総 合 マザーファンド	890,461,251	1.3231	1,178,215,954	1.3248	1,179,683,065	27.36
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSA Iマザーファンド	174,692,702	3.6032	629,466,361	3.7781	660,006,497	15.30
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	282,882,664	2.0098	568,537,579	2.0408	577,306,940	13.39
5	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックス マ ザーファンド	222,260,055	1.8194	404,379,945	1.9797	440,008,230	10.20

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	98.83
合 計	98.83

のむラップ・ファンド（普通型）

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	13,654,218,287	2.4728	33,764,428,841	2.5111	34,287,107,540	31.23
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド	7,413,821,765	3.6034	26,715,339,357	3.7781	28,010,160,010	25.51
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	8,302,019,992	2.0099	16,686,800,452	2.0408	16,942,762,399	15.43
4	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックス マ ザーファンド	7,867,909,791	1.8194	14,314,875,074	1.9797	15,576,101,013	14.18
5	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA－BPI総 合 マザーファンド	10,396,404,692	1.3231	13,755,834,206	1.3248	13,773,156,935	12.54

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	98.90
合 計	98.90

のむラップ・ファンド（やや積極型）

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド	487,897,427	3.6048	1,758,793,348	3.7781	1,843,325,268	38.16
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	464,839,877	2.4732	1,149,688,092	2.5111	1,167,259,415	24.17
3	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックス マ ザーファンド	353,719,696	1.8195	643,623,165	1.9797	700,258,882	14.50
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	328,306,100	2.0093	659,682,872	2.0408	670,007,088	13.87
5	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA－BPI総 合 マザーファンド	293,178,353	1.3230	387,900,050	1.3248	388,402,682	8.04

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	98.75
合 計	98.75

のむラップ・ファンド（積極型）

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド	5,874,675,457	3.6042	21,173,642,095	3.7781	22,195,111,344	51.72
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	2,978,739,657	2.4734	7,367,660,708	2.5111	7,479,913,152	17.43

3	日本	親投資信託 受益証券	世界REITインデックス マ ザーファンド	3,012,356,568	1.8194	5,480,779,318	1.9797	5,963,562,297	13.89
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	2,372,993,226	2.0101	4,770,050,680	2.0408	4,842,804,575	11.28
5	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA－BPI 総 合 マザーファンド	1,445,869,703	1.3231	1,913,042,449	1.3248	1,915,488,182	4.46

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	98.81
合 計	98.81

（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	1,529,200	6,660.02	10,184,502,584	8,616.00	13,175,587,200	3.16
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,175,200	4,764.18	5,598,864,336	9,330.00	10,964,616,000	2.62
3	日本	株式	ソニー	電気機器	945,600	7,121.85	6,734,421,360	11,595.00	10,964,232,000	2.62
4	日本	株式	キーエンス	電気機器	148,200	41,631.82	6,169,835,724	50,270.00	7,450,014,000	1.78
5	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,184,000	424.54	4,323,515,360	591.70	6,025,872,800	1.44
6	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,033,200	3,337.68	3,448,490,976	5,401.00	5,580,313,200	1.33
7	日本	株式	任天堂	その他製品	86,400	43,774.54	3,782,120,256	61,810.00	5,340,384,000	1.28
8	日本	株式	信越化学工業	化学	273,400	12,708.70	3,474,558,580	18,610.00	5,087,974,000	1.22
9	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,255,900	3,763.46	4,726,529,414	3,985.00	5,004,761,500	1.20
10	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,732,400	2,420.41	4,193,118,284	2,842.00	4,923,480,800	1.18
11	日本	株式	日本電産	電気機器	363,300	6,409.60	2,328,607,680	13,435.00	4,880,935,500	1.17
12	日本	株式	ダイキン工業	機械	192,300	14,261.11	2,742,411,453	22,320.00	4,292,136,000	1.02
13	日本	株式	第一三共	医薬品	1,295,800	2,569.66	3,329,765,428	3,225.00	4,178,955,000	1.00
14	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	88,400	22,847.58	2,019,726,072	46,790.00	4,136,236,000	0.99
15	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,030,300	2,825.43	2,911,040,529	4,007.00	4,128,412,100	0.99
16	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,187,800	3,162.25	3,756,120,550	3,395.00	4,032,581,000	0.96
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,188,500	2,618.43	3,112,004,055	3,319.00	3,944,631,500	0.94
18	日本	株式	村田製作所	電気機器	443,400	6,130.01	2,718,046,434	8,842.00	3,920,542,800	0.94
19	日本	株式	HOYA	精密機器	297,000	9,806.20	2,912,441,400	13,005.00	3,862,485,000	0.92
20	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,039,800	2,250.48	2,340,049,104	3,587.00	3,729,762,600	0.89
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	725,700	3,288.09	2,386,166,913	5,004.00	3,631,402,800	0.87
22	日本	株式	ファナック	電気機器	132,500	17,890.40	2,370,478,000	26,185.00	3,469,512,500	0.83
23	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,023,000	1,236.92	2,502,289,160	1,599.00	3,234,777,000	0.77
24	日本	株式	SMC	機械	44,200	51,254.31	2,265,440,502	64,310.00	2,842,502,000	0.68
25	日本	株式	三菱商事	卸売業	905,100	2,415.57	2,186,332,407	3,130.00	2,832,963,000	0.67
26	日本	株式	三井物産	卸売業	1,207,000	1,640.13	1,979,636,910	2,302.00	2,778,514,000	0.66

27	日本	株式	花王	化学	361,400	8,432.46	3,047,491,044	7,313.00	2,642,918,200	0.63
28	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	493,500	4,513.32	2,227,323,420	5,265.00	2,598,277,500	0.62
29	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	581,600	3,463.44	2,014,336,704	4,463.00	2,595,680,800	0.62
30	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	153,400	14,317.72	2,196,338,248	16,625.00	2,550,275,000	0.61

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	0.16
		建設業	2.33
		食料品	3.23
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.15
		医薬品	5.34
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.80
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.61
		機械	5.49
		電気機器	16.94
		輸送用機器	7.13
		精密機器	2.46
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	1.32
		陸運業	3.31
		海運業	0.22
		空運業	0.44
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	8.94
		卸売業	4.64
		小売業	4.55
		銀行業	5.00
		証券、商品先物取引業	0.76
		保険業	1.79
		その他金融業	1.08
		不動産業	1.96
		サービス業	5.41
合 計			96.99

（参考）国内債券NOMURA－B P I 総合 マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 5回	8,500,000,000	100.59	8,550,375,000	100.46	8,539,355,000	0.1	2023/3/20	1.16
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 42回	8,350,000,000	100.95	8,429,935,000	100.94	8,429,074,500	0.1	2026/3/20	1.14
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 60回	7,900,000,000	100.74	7,958,494,000	100.18	7,914,852,000	0.1	2030/9/20	1.07
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 51回	7,700,000,000	101.43	7,810,465,000	100.86	7,766,759,000	0.1	2028/6/20	1.05
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 41回	7,300,000,000	102.36	7,472,870,000	101.89	7,438,481,000	0.3	2025/12/20	1.01
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 61回	6,900,000,000	99.69	6,878,647,000	100.09	6,906,624,000	0.1	2030/12/20	0.93
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 48回	6,800,000,000	101.65	6,912,678,000	100.94	6,863,988,000	0.1	2027/9/20	0.93
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 34回	6,600,000,000	103.07	6,802,950,000	102.37	6,756,816,000	0.6	2024/6/20	0.91
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 52回	6,600,000,000	101.47	6,697,657,000	100.82	6,654,252,000	0.1	2028/9/20	0.90
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 3回	6,200,000,000	100.62	6,238,440,000	100.33	6,220,522,000	0.1	2022/9/20	0.84
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 50回	6,150,000,000	101.40	6,236,220,000	100.94	6,207,933,000	0.1	2028/3/20	0.84
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 29回	6,000,000,000	102.98	6,179,135,000	102.08	6,124,860,000	0.8	2023/6/20	0.83
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 32回	5,900,000,000	102.64	6,055,780,000	102.02	6,019,180,000	0.6	2023/12/20	0.81
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 43回	5,900,000,000	101.40	5,983,005,000	100.96	5,957,171,000	0.1	2026/6/20	0.80
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年) 第1 55回	5,350,000,000	111.00	5,938,998,000	110.10	5,890,403,500	1	2035/12/20	0.80
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 44回	5,800,000,000	101.50	5,887,058,000	100.96	5,855,738,000	0.1	2026/9/20	0.79
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年) 第1 56回	5,650,000,000	101.16	5,715,621,000	101.35	5,726,783,500	0.4	2036/3/20	0.77
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 9回	5,600,000,000	100.82	5,646,320,000	100.70	5,639,200,000	0.1	2024/3/20	0.76
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第14 3回	5,570,000,000	100.97	5,624,520,700	100.87	5,618,793,200	0.1	2025/3/20	0.76
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 59回	5,600,000,000	100.62	5,634,845,000	100.32	5,617,920,000	0.1	2030/6/20	0.76

21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第13 8回	5,500,000,000	100.81	5,544,842,000	100.66	5,536,795,000	0.1	2023/12/20	0.75
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 58回	5,470,000,000	100.93	5,521,335,100	100.40	5,491,934,700	0.1	2030/3/20	0.74
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 47回	5,400,000,000	101.67	5,490,218,000	100.96	5,452,218,000	0.1	2027/6/20	0.74
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 28回	5,250,000,000	102.19	5,365,395,000	101.43	5,325,547,500	0.6	2023/3/20	0.72
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 53回	5,100,000,000	101.40	5,171,502,000	100.77	5,139,372,000	0.1	2028/12/20	0.69
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 55回	5,100,000,000	101.15	5,158,905,000	100.61	5,131,365,000	0.1	2029/6/20	0.69
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 39回	5,000,000,000	102.73	5,136,630,000	102.18	5,109,150,000	0.4	2025/6/20	0.69
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 38回	5,000,000,000	102.58	5,129,264,000	102.07	5,103,600,000	0.4	2025/3/20	0.69
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 45回	5,000,000,000	101.59	5,079,650,000	100.97	5,048,800,000	0.1	2026/12/20	0.68
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 46回	4,900,000,000	101.68	4,982,712,000	100.95	4,946,942,000	0.1	2027/3/20	0.67

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.22
地方債証券	6.91
特殊債券	8.61
社債券	3.78
合 計	99.53

(参考) 外国株式MSC I－KOKUSA Iマザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	2,817,400	7,716.48	21,740,430,474	13,274.12	37,398,531,045	4.03
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,190,200	18,466.42	21,978,742,606	25,668.11	30,550,188,688	3.29
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	70,670	232,737.88	16,447,586,212	338,251.15	23,904,209,187	2.57
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	398,400	19,659.88	7,832,496,909	31,884.48	12,702,776,832	1.36

5	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	49,820	134,182.73	6,684,983,818	226,564.69	11,287,453,040	1.21
6	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	49,200	134,269.08	6,606,039,129	227,568.83	11,196,386,603	1.20
7	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	125,660	17,511.69	2,200,520,136	70,369.49	8,842,630,139	0.95
8	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	505,100	10,557.30	5,332,495,058	17,102.48	8,638,463,052	0.93
9	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	436,200	14,910.42	6,503,926,425	18,268.25	7,968,613,747	0.85
10	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	280,400	18,719.95	5,249,075,074	23,459.44	6,578,029,500	0.70
11	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	157,200	28,801.20	4,527,549,662	41,356.82	6,501,293,299	0.70
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	227,200	20,673.98	4,697,129,483	28,584.21	6,494,333,625	0.70
13	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	300,000	11,537.08	3,461,126,730	20,540.02	6,162,007,890	0.66
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	410,900	12,990.71	5,337,883,315	14,995.66	6,161,720,598	0.66
15	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	178,400	22,671.19	4,044,540,973	33,746.62	6,020,397,400	0.64
16	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	477,400	11,797.85	5,632,294,783	12,442.65	5,940,122,542	0.64
17	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	102,580	33,198.60	3,405,513,178	57,001.25	5,847,189,015	0.63
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	147,400	28,866.52	4,254,925,844	39,656.32	5,845,341,863	0.63
19	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,290,000	2,492.08	3,214,785,909	4,316.58	5,568,391,941	0.60
20	アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	情報技術サービス	184,500	12,196.92	2,250,331,869	26,187.34	4,831,564,857	0.52
21	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	679,100	6,081.30	4,129,811,034	7,059.97	4,794,430,177	0.51
22	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	70,390	33,511.76	2,358,893,068	67,015.74	4,717,237,939	0.50
23	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	756,600	4,053.09	3,066,570,239	6,086.83	4,605,299,966	0.49
24	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	685,700	6,091.26	4,176,779,862	6,486.49	4,447,792,296	0.47
25	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	700,700	4,148.30	2,906,716,403	6,276.14	4,397,698,235	0.47
26	アメリカ	株式	NETFLIX INC	娯楽	73,210	42,789.41	3,132,613,072	56,837.40	4,161,066,559	0.44
27	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	116,400	36,335.50	4,229,452,957	35,687.18	4,153,988,043	0.44
28	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	79,490	37,280.48	2,963,425,785	51,531.07	4,096,205,279	0.44
29	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	1,181,000	3,315.76	3,915,917,874	3,402.11	4,017,901,712	0.43
30	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	700,200	4,457.18	3,120,920,657	5,731.45	4,013,165,981	0.43

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	4.26
		メディア	1.15
		娯楽	1.55
		不動産管理・開発	0.42
		エネルギー設備・サービス	0.15
		石油・ガス・消耗燃料	3.18
		化学	2.19
		建設資材	0.27
		容器・包装	0.29
		金属・鉱業	1.54
		紙製品・林産品	0.12
		航空宇宙・防衛	1.51
		建設関連製品	0.60
		建設・土木	0.26
		電気設備	0.90
		コングロマリット	1.25
		機械	1.85
		商社・流通業	0.30
		商業サービス・用品	0.40
		航空貨物・物流サービス	0.64
		旅客航空輸送業	0.06
		海運業	0.07
		陸運・鉄道	1.11
		運送インフラ	0.13
		自動車部品	0.29
		自動車	1.73
		家庭用耐久財	0.39
		レジャー用品	0.07
		繊維・アパレル・贅沢品	1.43
		ホテル・レストラン・レジャー	1.68
		販売	0.08
		インターネット販売・通信販売	3.36
		複合小売り	0.51
		専門小売り	1.71
		食品・生活必需品小売り	1.32
		飲料	1.63
		食品	1.62
		タバコ	0.70
		家庭用品	1.20
		パーソナル用品	0.63
		ヘルスケア機器・用品	2.97
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.98

		バイオテクノロジー	1.71
		医薬品	4.58
		銀行	6.22
		各種金融サービス	0.95
		保険	3.22
		情報技術サービス	4.53
		ソフトウェア	6.75
		通信機器	0.69
		コンピュータ・周辺機器	4.33
		電子装置・機器・部品	0.55
		半導体・半導体製造装置	4.42
		各種電気通信サービス	1.53
		無線通信サービス	0.28
		電力	1.85
		ガス	0.14
		総合公益事業	0.85
		水道	0.10
		消費者金融	0.44
		資本市場	3.09
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
		ヘルスケア・テクノロジー	0.15
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.96
		専門サービス	0.67
投資証券	—	—	2.18
合 計			98.08

（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 N/B	63,700,000	15,945.87	10,157,524,611	14,827.78	9,445,300,796	5.375	2031/2/15	1.62
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	62,100,000	14,472.89	8,987,669,738	13,781.66	8,558,413,719	6	2026/2/15	1.46
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	73,300,000	11,407.55	8,361,740,307	11,358.15	8,325,526,928	1.5	2023/2/28	1.42
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	48,000,000	15,354.36	7,370,097,552	14,131.09	6,782,924,659	5.25	2028/11/15	1.16
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	15,466.53	7,145,537,975	14,251.31	6,584,108,665	5.5	2028/8/15	1.13
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,600,000	12,182.39	6,164,292,441	11,802.72	5,972,178,016	2.25	2025/11/15	1.02
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	13,750.09	7,081,298,688	11,323.55	5,831,631,952	2.5	2046/2/15	1.00
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,900,000	11,532.78	5,870,187,609	11,397.07	5,801,111,312	1.75	2023/1/31	0.99
9	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	27,800,000	20,246.20	5,628,444,712	20,649.88	5,740,667,196	5.75	2032/7/30	0.98

10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,100,000	11,950.01	5,628,459,095	11,727.47	5,523,640,665	2.75	2023/7/31	0.94
11	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000	16,877.82	5,046,470,187	18,159.02	5,429,546,980	5.25	2029/11/1	0.93
12	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,969.94	5,445,750,563	15,631.16	5,330,227,265	3.5	2026/4/25	0.91
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	12,045.76	5,432,640,522	11,793.20	5,318,737,230	2.375	2024/8/15	0.91
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,550,000	20,949.72	5,352,653,460	20,576.18	5,257,214,389	3.25	2045/5/25	0.90
15	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	25,000,000	24,242.62	6,060,656,875	20,881.94	5,220,487,327	3.25	2044/1/22	0.89
16	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	19,540.32	5,275,887,923	19,046.16	5,142,464,296	5.5	2029/4/25	0.88
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	12,041.44	5,129,654,203	11,797.53	5,025,749,644	2.75	2023/11/15	0.86
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,872.78	5,105,296,152	11,668.66	5,017,523,880	2.25	2023/12/31	0.86
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,951.48	5,103,286,194	11,701.52	4,996,552,358	2.125	2024/9/30	0.85
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	40,600,000	12,945.15	5,255,731,438	12,185.88	4,947,468,912	2.875	2028/5/15	0.84
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	13,250.60	5,141,234,012	12,657.69	4,911,187,228	6.25	2023/8/15	0.84
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	33,660,000	14,479.38	4,873,760,176	14,185.84	4,774,954,417	5.5	2022/11/1	0.81
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	13,676.42	5,456,892,007	11,338.26	4,523,965,972	2.5	2045/2/15	0.77
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	12,486.01	4,744,684,631	11,846.83	4,501,797,165	2.375	2027/5/15	0.77
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,400,000	22,043.39	4,496,852,101	21,540.19	4,394,199,408	5.75	2032/10/25	0.75
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,100,000	14,843.99	5,210,242,877	12,380.49	4,345,552,399	3	2044/11/15	0.74
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	12,452.43	4,296,088,597	12,065.65	4,162,652,563	2.875	2025/4/30	0.71
28	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	22,500,000	17,619.80	3,964,455,440	18,229.11	4,101,550,200	6.5	2027/11/1	0.70
29	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	25,492.58	4,700,833,232	21,850.66	4,029,262,889	3.5	2045/1/22	0.69
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,200,000	12,032.79	4,115,215,249	11,756.01	4,020,558,199	2.25	2024/11/15	0.69

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.01
合 計	99.01

(参考) 世界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	360,200	10,872.40	3,916,240,373	11,819.39	4,257,347,736	5.24
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	43,500	79,373.47	3,452,746,259	74,711.53	3,249,951,833	4.00
3	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	137,100	15,300.79	2,097,738,505	15,636.68	2,143,788,883	2.64
4	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	159,800	10,269.45	1,641,059,644	12,774.82	2,041,417,339	2.51
5	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	74,000	24,453.62	1,809,568,235	27,348.69	2,023,803,156	2.49
6	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	203,400	6,763.53	1,375,702,720	8,074.08	1,642,267,933	2.02
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	68,100	17,997.37	1,225,621,476	20,743.73	1,412,648,197	1.73
8	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	166,700	6,681.34	1,113,780,795	8,063.00	1,344,103,650	1.65
9	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	181,800	6,463.38	1,175,043,408	7,098.72	1,290,548,241	1.58
10	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	818,000	1,493.17	1,221,414,696	1,521.85	1,244,876,899	1.53
11	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	62,000	18,440.29	1,143,298,405	18,407.75	1,141,280,605	1.40
12	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	182,100	5,286.40	962,653,896	6,058.05	1,103,171,124	1.35
13	香港	投資証券	LINK REIT	1,015,000	989.79	1,004,640,998	1,033.82	1,049,331,360	1.29
14	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	276,900	3,262.35	903,347,434	3,570.39	988,643,068	1.21
15	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	31,600	26,273.69	830,248,831	30,790.66	972,985,020	1.19
16	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	64,400	12,396.72	798,349,098	14,724.43	948,253,292	1.16
17	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	261,900	3,229.41	845,782,662	3,540.50	927,258,469	1.14
18	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	55,600	14,472.01	804,643,823	16,312.01	906,947,834	1.11
19	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	54,400	15,671.83	852,548,040	16,586.57	902,309,528	1.11
20	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	181,700	4,287.79	779,092,951	4,702.96	854,527,977	1.05
21	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	579,000	1,461.40	846,155,232	1,437.05	832,052,645	1.02
22	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	260,900	2,810.92	733,370,828	3,123.12	814,824,382	1.00
23	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	68,900	10,323.70	711,303,447	11,404.23	785,751,936	0.96
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	145,000	4,287.05	621,622,258	4,915.52	712,750,980	0.87
25	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	85,200	7,412.03	631,505,339	7,826.08	666,782,859	0.82
26	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	281,600	2,364.08	665,726,459	2,350.37	661,865,121	0.81
27	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	343,000	1,631.86	559,729,832	1,915.28	656,942,069	0.80
28	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	67,700	7,856.84	531,908,135	8,984.75	608,267,981	0.74
29	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	2,529,000	245.48	620,838,140	237.05	599,503,496	0.73
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	82,200	6,625.99	544,656,666	7,165.15	588,975,429	0.72

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.31
合 計	99.31

②【投資不動産物件】

のむラップ・ファンド（保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（普通型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA－B P I総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAI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）世界REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

のむラップ・ファンド（保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（普通型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

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

種類	取引所	名称	買建／ 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(2021年06月限)	買建	605	日本円	11,624,126,775	11,821,700,000	2.83

（参考）国内債券NOMURA－B P I 総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式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(2021 年06月限)	買建	590	米ドル	116,575,522.5	12,906,076,094	116,458,625	12,893,134,369	1.38
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2021年06 月限)	買建	32	カナダド ル	7,149,636	627,595,051	7,123,200	625,274,496	0.06
	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(2021年06月 限)	買建	383	ユーロ	14,520,980	1,884,823,204	14,829,760	1,924,902,848	0.20
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200株価指数先 物(2021年06月限)	買建	29	豪ドル	4,929,100	415,818,876	4,864,750	410,390,310	0.04
	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(2021年06月限)	買建	83	英ポンド	5,574,230	848,565,032	5,587,145	850,531,078	0.09
	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 (2021年06月限)	買建	42	スイスフ ラン	4,521,690	531,072,489	4,617,060	542,273,694	0.05

（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）世界R E I T インデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地域	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数 先物取引	日本	大阪取引 所	REIT指数先物 (2021年06月限)	買建	28	日本円	52,962,280	52,962,280	56,126,000	56,126,000	0.06
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(2021年06 月限)	買建	92	米ドル	3,283,640	363,531,784	3,303,720	365,754,839	0.45

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

2021年3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2計算期間	(2012年 2月20日)	6,058	6,058	0.9918	0.9918
第3計算期間	(2013年 2月18日)	5,672	5,677	1.1314	1.1324
第4計算期間	(2014年 2月18日)	9,827	9,835	1.2452	1.2462
第5計算期間	(2015年 2月18日)	14,449	14,460	1.3886	1.3896
第6計算期間	(2016年 2月18日)	21,912	21,929	1.3443	1.3453
第7計算期間	(2017年 2月20日)	30,711	30,733	1.3697	1.3707
第8計算期間	(2018年 2月19日)	35,454	35,480	1.4018	1.4028
第9計算期間	(2019年 2月18日)	40,084	40,112	1.4138	1.4148
第10計算期間	(2020年 2月18日)	42,494	42,523	1.4787	1.4797
第11計算期間	(2021年 2月18日)	41,691	41,719	1.5157	1.5167
	2020年 3月末日	40,398	—	1.3978	—
	4月末日	40,820	—	1.4128	—
	5月末日	41,631	—	1.4327	—
	6月末日	41,317	—	1.4410	—
	7月末日	41,433	—	1.4454	—
	8月末日	41,632	—	1.4645	—
	9月末日	41,750	—	1.4611	—
	10月末日	41,160	—	1.4409	—
	11月末日	41,683	—	1.4855	—
	12月末日	41,691	—	1.4978	—

2021年 1月末日	41,500	—	1.4997	—
2月末日	41,212	—	1.5022	—
3月末日	42,629	—	1.5399	—

のむラップ・ファンド（やや保守型）

2021年3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	(2017年 2月20日)	1,754	1,756	1.0428	1.0438
第2計算期間	(2018年 2月19日)	2,561	2,564	1.0771	1.0781
第3計算期間	(2019年 2月18日)	3,292	3,295	1.0905	1.0915
第4計算期間	(2020年 2月18日)	4,330	4,334	1.1619	1.1629
第5計算期間	(2021年 2月18日)	4,097	4,101	1.2108	1.2118
	2020年 3月末日	3,398	—	1.0622	—
	4月末日	3,479	—	1.0847	—
	5月末日	3,589	—	1.1066	—
	6月末日	3,703	—	1.1154	—
	7月末日	3,913	—	1.1205	—
	8月末日	4,020	—	1.1463	—
	9月末日	4,201	—	1.1384	—
	10月末日	4,165	—	1.1184	—
	11月末日	4,360	—	1.1703	—
	12月末日	4,331	—	1.1842	—
	2021年 1月末日	4,046	—	1.1893	—
	2月末日	4,058	—	1.1986	—
	3月末日	4,311	—	1.2381	—

のむラップ・ファンド（普通型）

2021年3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2計算期間	(2012年 2月20日)	6,615	6,615	0.9925	0.9925
第3計算期間	(2013年 2月18日)	6,993	6,999	1.2232	1.2242
第4計算期間	(2014年 2月18日)	11,197	11,205	1.4361	1.4371
第5計算期間	(2015年 2月18日)	21,005	21,017	1.7185	1.7195
第6計算期間	(2016年 2月18日)	37,150	37,173	1.5776	1.5786
第7計算期間	(2017年 2月20日)	45,690	45,717	1.6899	1.6909
第8計算期間	(2018年 2月19日)	58,457	58,490	1.7636	1.7646
第9計算期間	(2019年 2月18日)	75,805	75,847	1.7954	1.7964

第10計算期間	(2020年 2月18日)	92,176	92,223	1.9561	1.9571
第11計算期間	(2021年 2月18日)	103,707	103,757	2.0652	2.0662
	2020年 3月末日	83,229	—	1.7095	—
	4月末日	86,986	—	1.7682	—
	5月末日	90,812	—	1.8157	—
	6月末日	92,015	—	1.8349	—
	7月末日	93,513	—	1.8480	—
	8月末日	96,556	—	1.9112	—
	9月末日	96,736	—	1.8874	—
	10月末日	94,765	—	1.8461	—
	11月末日	99,072	—	1.9648	—
	12月末日	99,882	—	1.9959	—
	2021年 1月末日	100,921	—	2.0108	—
	2月末日	102,681	—	2.0422	—
	3月末日	109,787	—	2.1286	—

のむラップ・ファンド（やや積極型）

2021年3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	(2017年 2月20日)	448	448	1.0761	1.0771
第2計算期間	(2018年 2月19日)	1,565	1,566	1.1287	1.1297
第3計算期間	(2019年 2月18日)	2,229	2,231	1.1485	1.1495
第4計算期間	(2020年 2月18日)	3,070	3,072	1.2717	1.2727
第5計算期間	(2021年 2月18日)	4,445	4,448	1.3517	1.3527
	2020年 3月末日	2,888	—	1.0722	—
	4月末日	3,231	—	1.1215	—
	5月末日	3,457	—	1.1557	—
	6月末日	3,631	—	1.1692	—
	7月末日	3,774	—	1.1819	—
	8月末日	3,959	—	1.2329	—
	9月末日	3,960	—	1.2104	—
	10月末日	3,982	—	1.1815	—
	11月末日	4,270	—	1.2721	—
	12月末日	4,385	—	1.2955	—
	2021年 1月末日	4,316	—	1.3090	—
	2月末日	4,387	—	1.3355	—
	3月末日	4,829	—	1.3998	—

のむラップ・ファンド（積極型）

2021年3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2計算期間	(2012年 2月20日)	5,471	5,471	0.9929	0.9929
第3計算期間	(2013年 2月18日)	5,173	5,177	1.2607	1.2617
第4計算期間	(2014年 2月18日)	7,914	7,919	1.5322	1.5332
第5計算期間	(2015年 2月18日)	12,370	12,377	1.8855	1.8865
第6計算期間	(2016年 2月18日)	15,939	15,949	1.6702	1.6712
第7計算期間	(2017年 2月20日)	19,026	19,036	1.8662	1.8672
第8計算期間	(2018年 2月19日)	22,241	22,253	1.9744	1.9754
第9計算期間	(2019年 2月18日)	26,325	26,338	2.0233	2.0243
第10計算期間	(2020年 2月18日)	32,358	32,372	2.2782	2.2792
第11計算期間	(2021年 2月18日)	39,717	39,733	2.4423	2.4433
	2020年 3月末日	28,011	—	1.8588	—
	4月末日	30,310	—	1.9684	—
	5月末日	32,100	—	2.0339	—
	6月末日	33,291	—	2.0600	—
	7月末日	34,186	—	2.0915	—
	8月末日	36,018	—	2.1984	—
	9月末日	36,180	—	2.1458	—
	10月末日	35,616	—	2.0902	—
	11月末日	37,436	—	2.2747	—
	12月末日	37,709	—	2.3221	—
	2021年 1月末日	38,310	—	2.3524	—
	2月末日	39,264	—	2.4112	—
	3月末日	42,906	—	2.5405	—

②【分配の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0.0000円
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円

第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	0.0010円
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（普通型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0.0000円
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（やや積極型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	0.0010円
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

のむラップ・ファンド（積極型）

	計算期間	1口当たりの分配金
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	0.0000円

第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	0.0010円
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	0.0010円
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	0.0010円
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	0.0010円
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	0.0010円
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	0.0010円
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0010円
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	0.0010円
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	0.0010円

③【収益率の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	収益率
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	△0.4%
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	14.2%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	10.1%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	11.6%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	△3.1%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	2.0%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	2.4%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.9%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	4.7%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	2.6%

※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。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	4.4%
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	3.4%
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.3%
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	6.6%
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	4.3%

※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。

のむラップ・ファンド（普通型）

	計算期間	収益率
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	△3.4%
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	23.3%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	17.5%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	19.7%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	△8.1%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	7.2%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	4.4%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.9%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	9.0%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	5.6%

※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。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	7.7%
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	5.0%
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	1.8%
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	10.8%
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	6.4%

※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。

のむラップ・ファンド（積極型）

	計算期間	収益率
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	△4.8%
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	27.1%
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	21.6%
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	23.1%
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	△11.4%
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	11.8%
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	5.9%
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	2.5%
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	12.6%
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	7.2%

※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（分配額の額。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】

のむラップ・ファンド（保守型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	4,101,497,146	851,012,801	6,108,585,471
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	1,608,337,173	2,703,541,712	5,013,380,932
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	3,849,180,143	970,300,281	7,892,260,794
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	5,232,995,552	2,719,491,723	10,405,764,623
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	8,647,464,358	2,752,459,905	16,300,769,076
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	10,074,422,211	3,953,141,382	22,422,049,905
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	8,245,634,392	5,375,777,007	25,291,907,290
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	6,683,674,568	3,622,632,363	28,352,949,495
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	7,256,673,085	6,871,185,722	28,738,436,858
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	5,853,220,978	7,084,358,604	27,507,299,232

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	1,683,928,835	1,075,577	1,682,853,258
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	1,216,556,735	520,704,097	2,378,705,896
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	827,317,233	187,003,223	3,019,019,906
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	1,362,550,967	654,402,581	3,727,168,292
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	1,382,305,912	1,725,139,133	3,384,335,071

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（普通型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	4,035,238,777	777,144,309	6,665,994,789
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	1,357,750,676	2,306,257,102	5,717,488,363
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	3,301,811,164	1,221,662,831	7,797,636,696
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	6,938,730,583	2,513,534,586	12,222,832,693
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	14,624,481,293	3,298,164,142	23,549,149,844
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	8,370,562,015	4,882,793,242	27,036,918,617
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	13,898,310,644	7,788,778,406	33,146,450,855

第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	14,762,704,987	5,687,029,247	42,222,126,595
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	17,015,753,904	12,114,213,571	47,123,666,928
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	17,367,085,936	14,274,396,250	50,216,356,614

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年11月11日～2017年 2月20日	418,434,475	2,119,224	416,315,251
第2計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	1,136,667,950	165,912,216	1,387,070,985
第3計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	748,002,975	193,991,442	1,941,082,518
第4計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	1,250,105,711	776,826,920	2,414,361,309
第5計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	1,873,074,115	998,933,831	3,288,501,593

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（積極型）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第2計算期間	2011年 2月19日～2012年 2月20日	3,679,870,851	878,370,640	5,510,802,927
第3計算期間	2012年 2月21日～2013年 2月18日	959,956,709	2,366,840,325	4,103,919,311
第4計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月18日	2,155,523,440	1,094,037,100	5,165,405,651
第5計算期間	2014年 2月19日～2015年 2月18日	3,164,392,511	1,768,791,397	6,561,006,765
第6計算期間	2015年 2月19日～2016年 2月18日	4,833,876,039	1,851,238,866	9,543,643,938
第7計算期間	2016年 2月19日～2017年 2月20日	2,890,629,040	2,239,285,849	10,194,987,129
第8計算期間	2017年 2月21日～2018年 2月19日	4,305,044,963	3,234,715,551	11,265,316,541
第9計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	4,187,189,703	2,441,328,586	13,011,177,658
第10計算期間	2019年 2月19日～2020年 2月18日	5,773,245,162	4,580,921,634	14,203,501,186
第11計算期間	2020年 2月19日～2021年 2月18日	7,849,562,545	5,791,022,042	16,262,041,689

※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（2021年3月31日現在）

基準価額・純資産の推移（日次）



やや保守型（設定来）



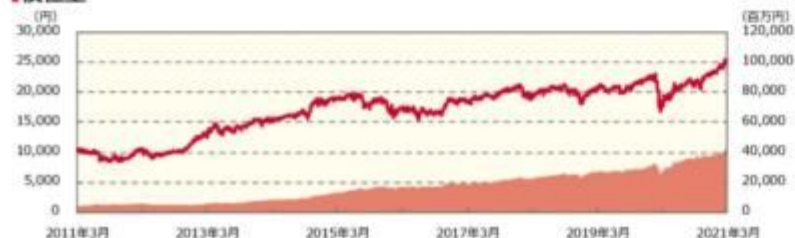
普通型



やや積極型（設定来）



積極型



分配の推移

（1万口あたり、課税前）

保守型	
2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
2017年2月	10 円
設定来累計	90 円

やや保守型

2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
2017年2月	10 円
設定来累計	50 円

普通型

2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
2017年2月	10 円
設定来累計	100 円

やや積極型

2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
2017年2月	10 円
設定来累計	50 円

積極型

2021年2月	10 円
2020年2月	10 円
2019年2月	10 円
2018年2月	10 円
2017年2月	10 円
設定来累計	100 円

主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率（％）				
	保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
国内株式マザーファンド	10.8	13.4	15.4	13.9	11.3
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	40.5	27.4	12.5	8.0	4.5
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7.3	15.3	25.5	38.2	51.7
外国債券マザーファンド	33.1	32.6	31.2	24.2	17.4
世界REITインデックス マザーファンド	7.3	10.2	14.2	14.5	13.9

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（％）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.3	0.4	0.5	0.4	0.4
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.3	0.4	0.4	0.4	0.3
3	ソニー	電気機器	0.3	0.4	0.4	0.4	0.3
4	キーエンス	電気機器	0.2	0.2	0.3	0.2	0.2
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.2	0.2	0.2	0.2	0.2

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	国庫債券 利付（5年）第135回	国債証券	0.5	0.3	0.1	0.1	0.1
2	国庫債券 利付（10年）第342回	国債証券	0.5	0.3	0.1	0.1	0.1
3	国庫債券 利付（10年）第360回	国債証券	0.4	0.3	0.1	0.1	0.0
4	国庫債券 利付（10年）第351回	国債証券	0.4	0.3	0.1	0.1	0.0
5	国庫債券 利付（10年）第341回	国債証券	0.4	0.3	0.1	0.1	0.0

・「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（％）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.3	0.6	1.0	1.5	2.1
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.2	0.5	0.8	1.3	1.7
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.4	0.7	1.0	1.3
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.2	0.3	0.5	0.7
5	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.2	0.3	0.5	0.6

・「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（％）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.5	0.5	0.5	0.4	0.3
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.5	0.5	0.5	0.4	0.3
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.5	0.5	0.4	0.3	0.2
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.4	0.4	0.4	0.3	0.2
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.4	0.4	0.4	0.3	0.2

・「世界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（％）				
			保守型	やや保守型	普通型	やや積極型	積極型
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.4	0.5	0.7	0.8	0.7
2	EQUINIX INC	投資証券	0.3	0.4	0.6	0.6	0.6
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.2	0.3	0.4	0.4	0.4
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.2	0.3	0.4	0.4	0.3
5	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.2	0.3	0.4	0.4	0.3

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

■ 保守型



■ やや保守型



■ 普通型



■ やや積極型



■ 積極型



2012年 2013年 2014年 2015年 2016年 2017年 2018年 2019年 2020年 2021年

- ・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。
- ・『(やや保守型)』『(やや積極型)』の2016年は設定日（2016年11月11日）から年末までの収益率。
- ・2021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。●グラフの横軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

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、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれま
す。

販売会社によっては、一部のファンドのみのお取り扱いと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。

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

ファンドの申込(販売)手続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/>

分配金の受取方法により、「一般コース」と「自動けいぞく投資コース」の2つの申込方法があります。
(原則として、お買付け後のコース変更はできません。)

販売の単位は、「一般コース」の場合は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、
「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選
択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。なお、販売会社や申込形態によっては、ど
ちらか一方のコースのみのお取扱いとなる場合や、申込単位が異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお
問い合わせください。

■積立方式■

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

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

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

「のむラップ・ファンド」を構成する各ファンド間でスイッチングができます。

なお、「(年3%目標払出)のむラップ・ファンド(普通型)」「(年6%目標払出)のむラップ・ファンド
(普通型)」の換金代金をもって、「のむラップ・ファンド」を構成する各ファンドへのスイッチングが可能
です。

スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。

なお、スイッチングの際には、換金時と同様の費用・税金がかかりますのでご留意下さい。(詳しくは「第
1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。)

購入およびスイッチングのお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社や申込形態によっては、上記
と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があ
るときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込み(スイッチングの申込みを含
みます。)の受付けを中止することおよび既に受付けた取得申込み(スイッチングの申込みを含みます。)の受付
けを取り消す場合があります。

※取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替

を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、受益権を、「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

※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。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

一部解約の実行の請求の受付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

換金価額は、換金のお申込み日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口当たりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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、1日1件10億円を超える一部解約は行なえません。また、別途、大口換金について、1日1件10億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断により一部解約の金額に制限を設ける場合や一部解約の実行の請求の受付時間に制限を設ける場合があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、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既に受付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

また、一部解約の実行の請求の受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ます。

※換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載また

は記録が行なわれます。

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} ①日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ②金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) ③価格情報会社の提供する価額
REIT (不動産投資信託)	原則として、基準価額計算日 ^{※1} の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

無期限とします。

(保守型、普通型、積極型：2010年3月15日設定)

(やや保守型、やや積極型：2016年11月11日設定)

（４）【計算期間】

原則として、毎年2月19日から翌年2月18日までとします。

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

（５）【その他】

(a)ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより、各ファンドにつき受益権の口数が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

(i)委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知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発します。

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

(iii)上記(i)の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。

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

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

(vi)委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者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(iv)」の書面決議が否決となる場合を除き、その委託者と受託者との間において存続します。

(c)運用報告書

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

(d)信託約款の変更等

(i)委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託

者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。

- (ii) 委託者は、上記(i)の事項(上記(i)の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないません。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。
- (iii) 上記(ii)の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。
- (iv) 上記(ii)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。
- (v) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- (vi) 上記(ii)から(v)までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (vii) 上記(i)から(vi)の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- (i) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d)信託約款の変更等」に従い、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します。
- (ii) 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h)他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示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。

①収益分配金に対する請求権

■収益分配金の支払い開始日■

＜自動けいぞく投資契約を結んでいない場合＞

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

＜自動けいぞく投資契約を結んでいる場合＞

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。

②償還金に対する請求権

■償還金の支払い開始日■

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

■償還金請求権の失効■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

③換金(解約)請求権

■換金(解約)の単位■

受益者は、受益権を「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

※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。

■換金(解約)代金の支払い開始日■

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、5営業日目から受益者にお支

払いします。

第3【ファンドの経理状況】

のむラップ・ファンド（保守型）

のむラップ・ファンド（普通型）

のむラップ・ファンド（積極型）

(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11期計算期間(2020年2月19日から2021年2月18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。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

のむラップ・ファンド（やや積極型）

(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5期計算期間(2020年2月19日から2021年2月18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】

【のむラップ・ファンド（保守型）】

（１）【貸借対照表】

	(単位：円)	
	第10期 (2020年 2月18日現在)	第11期 (2021年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	716,683,448	695,231,242
親投資信託受益証券	42,082,188,693	41,302,918,441
未収入金	100,448,000	52,479,000
流動資産合計	42,899,320,141	42,050,628,683
資産合計	42,899,320,141	42,050,628,683
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	28,738,436	27,507,299
未払解約金	131,179,715	81,625,855
未払受託者報酬	6,786,624	6,912,662
未払委託者報酬	237,531,717	241,943,039
未払利息	446	638
その他未払費用	678,602	691,207
流動負債合計	404,915,540	358,680,700
負債合計	404,915,540	358,680,700
純資産の部		
元本等		
元本	28,738,436,858	27,507,299,232
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,755,967,743	14,184,648,751
（分配準備積立金）	2,876,671,399	3,349,267,699
元本等合計	42,494,404,601	41,691,947,983
純資産合計	42,494,404,601	41,691,947,983
負債純資産合計	42,899,320,141	42,050,628,683

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,325,999,863	1,525,538,748
営業収益合計	2,325,999,863	1,525,538,748
営業費用		
支払利息	289,480	195,973
受託者報酬	13,299,839	13,654,553
委託者報酬	465,494,235	477,909,082
その他費用	1,329,863	1,365,338
営業費用合計	480,413,417	493,124,946
営業利益又は営業損失（△）	1,845,586,446	1,032,413,802
経常利益又は経常損失（△）	1,845,586,446	1,032,413,802
当期純利益又は当期純損失（△）	1,845,586,446	1,032,413,802
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（△）	194,162,719	△80,833,435
期首剰余金又は期首欠損金（△）	11,731,374,359	13,755,967,743
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,243,855,939	2,685,374,954
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,243,855,939	2,685,374,954
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,841,947,846	3,342,433,884
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,841,947,846	3,342,433,884
分配金	28,738,436	27,507,299
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,755,967,743	14,184,648,751

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年 2月19日から2021年 2月18日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第10期 2020年 2月18日現在	第11期 2021年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 28,738,436,858口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 27,507,299,232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 1.4787円 (10,000口当たり純資産額) (14,787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 1.5157円 (10,000口当たり純資産額) (15,157円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>622,077,134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>778,716,150円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>10,879,296,344円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,504,616,551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>13,784,706,179円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>28,738,436,858口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>4,796円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>28,738,436円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	622,077,134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	778,716,150円	収益調整金額	C	10,879,296,344円	分配準備積立金額	D	1,504,616,551円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,784,706,179円	当ファンドの期末残存口数	F	28,738,436,858口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,796円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	28,738,436円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>520,852,338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>592,394,899円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>10,835,381,052円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>2,263,527,761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>14,212,156,050円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>27,507,299,232口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>5,166円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>27,507,299円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	520,852,338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	592,394,899円	収益調整金額	C	10,835,381,052円	分配準備積立金額	D	2,263,527,761円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,212,156,050円	当ファンドの期末残存口数	F	27,507,299,232口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,166円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	27,507,299円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	622,077,134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	778,716,150円																																																											
収益調整金額	C	10,879,296,344円																																																											
分配準備積立金額	D	1,504,616,551円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	13,784,706,179円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	28,738,436,858口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,796円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	28,738,436円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	520,852,338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	592,394,899円																																																											
収益調整金額	C	10,835,381,052円																																																											
分配準備積立金額	D	2,263,527,761円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,212,156,050円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	27,507,299,232口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	5,166円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	27,507,299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10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第10期 2020年 2月18日現在	第11期 2021年 2月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
期首元本額 28,352,949,495円	期首元本額 28,738,436,858円
期中追加設定元本額 7,256,673,085円	期中追加設定元本額 5,853,220,978円
期中一部解約元本額 6,871,185,722円	期中一部解約元本額 7,084,358,604円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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	2,172,677,254	1,601,187,710
合計	2,172,677,254	1,601,187,710

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年2月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年2月18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	2,249,717,074	4,522,831,205	
		外国債券マザーファンド	5,581,450,930	13,795,114,118	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	842,053,808	3,033,246,227	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	12,801,272,047	16,937,363,045	
		世界REITインデックスマザーファンド	1,656,790,066	3,014,363,846	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：99.1%	23,131,283,925	41,302,918,441 100.0%	
合計				41,302,918,441	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【のむラップ・ファンド（やや保守型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 (2020年 2月18日現在)	第5期 (2021年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	59,572,718	77,887,189
親投資信託受益証券	4,291,560,689	4,060,315,947
未収入金	17,501,000	5,930,000
流動資産合計	4,368,634,407	4,144,133,136
資産合計	4,368,634,407	4,144,133,136
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	3,727,168	3,384,335
未払解約金	9,479,075	15,921,969
未払受託者報酬	642,626	698,316
未払委託者報酬	24,098,517	26,187,142
未払利息	37	71
その他未払費用	64,203	69,768
流動負債合計	38,011,626	46,261,601
負債合計	38,011,626	46,261,601
純資産の部		
元本等		
元本	3,727,168,292	3,384,335,071
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	603,454,489	713,536,464
（分配準備積立金）	296,817,423	374,002,336
元本等合計	4,330,622,781	4,097,871,535
純資産合計	4,330,622,781	4,097,871,535
負債純資産合計	4,368,634,407	4,144,133,136

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	284,572,534	151,702,258
営業収益合計	284,572,534	151,702,258
営業費用		
支払利息	26,633	19,702
受託者報酬	1,189,103	1,312,628
委託者報酬	44,591,317	49,223,757
その他費用	118,795	131,135
営業費用合計	45,925,848	50,687,222
営業利益又は営業損失（△）	238,646,686	101,015,036
経常利益又は経常損失（△）	238,646,686	101,015,036
当期純利益又は当期純損失（△）	238,646,686	101,015,036
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（△）	15,629,482	△91,683,806
期首剰余金又は期首欠損金（△）	273,124,692	603,454,489
剰余金増加額又は欠損金減少額	171,357,871	186,398,648
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	171,357,871	186,398,648
剰余金減少額又は欠損金増加額	60,318,110	265,631,180
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	60,318,110	265,631,180
分配金	3,727,168	3,384,335
期末剰余金又は期末欠損金（△）	603,454,489	713,536,464

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年 2月19日から2021年 2月18日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 2020年 2月18日現在	第5期 2021年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,727,168,292口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,384,335,071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 1.1619円 (10,000口当たり純資産額) (11,619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 1.2108円 (10,000口当たり純資産額) (12,108円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>65,380,796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>157,636,408円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>306,637,066円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>77,527,387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>607,181,657円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,727,168,292口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>1,629円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>3,727,168円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	65,380,796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	157,636,408円	収益調整金額	C	306,637,066円	分配準備積立金額	D	77,527,387円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	607,181,657円	当ファンドの期末残存口数	F	3,727,168,292口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,629円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,727,168円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>61,730,381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>130,968,461円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>339,534,128円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>184,687,829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>716,920,799円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,384,335,071口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>2,118円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>3,384,335円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	61,730,381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	130,968,461円	収益調整金額	C	339,534,128円	分配準備積立金額	D	184,687,829円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	716,920,799円	当ファンドの期末残存口数	F	3,384,335,071口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,118円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,384,335円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	65,380,796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	157,636,408円																																																											
収益調整金額	C	306,637,066円																																																											
分配準備積立金額	D	77,527,387円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	607,181,657円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,727,168,292口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,629円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,727,168円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	61,730,381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	130,968,461円																																																											
収益調整金額	C	339,534,128円																																																											
分配準備積立金額	D	184,687,829円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	716,920,799円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,384,335,071口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,118円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,384,335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4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 2月18日現在	第5期 2021年 2月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
期首元本額 3,019,019,906円	期首元本額 3,727,168,292円
期中追加設定元本額 1,362,550,967円	期中追加設定元本額 1,382,305,912円
期中一部解約元本額 654,402,581円	期中一部解約元本額 1,725,139,133円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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	271,893,252	238,431,279
合計	271,893,252	238,431,279

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式(2021年2月18日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2021年2月18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	281,911,259	566,754,395	
		外国債券マザーファンド	532,803,765	1,316,877,785	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	178,056,516	641,395,181	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	841,332,442	1,113,166,954	
		世界REITインデックスマザーファンド	232,011,450	422,121,632	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：99.1%	2,066,115,432	4,060,315,947 100.0%	
合計				4,060,315,947	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【のむラップ・ファンド（普通型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 (2020年 2月18日現在)	第11期 (2021年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,804,020,183	2,030,659,824
親投資信託受益証券	91,313,460,732	102,722,787,166
未収入金	139,339,000	79,884,000
流動資産合計	93,256,819,915	104,833,330,990
資産合計	93,256,819,915	104,833,330,990
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	47,123,666	50,216,356
未払解約金	449,049,521	403,174,411
未払受託者報酬	14,213,263	16,359,807
未払委託者報酬	568,530,499	654,392,349
未払利息	1,123	1,863
その他未払費用	1,421,265	1,635,924
流動負債合計	1,080,339,337	1,125,780,710
負債合計	1,080,339,337	1,125,780,710
純資産の部		
元本等		
元本	47,123,666,928	50,216,356,614
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	45,052,813,650	53,491,193,666
（分配準備積立金）	9,534,807,797	13,560,150,154
元本等合計	92,176,480,578	103,707,550,280
純資産合計	92,176,480,578	103,707,550,280
負債純資産合計	93,256,819,915	104,833,330,990

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	8,388,026,395	7,426,724,434
その他収益	-	38
営業収益合計	8,388,026,395	7,426,724,472
営業費用		
支払利息	621,435	468,777
受託者報酬	26,903,322	30,950,882
委託者報酬	1,076,132,652	1,238,035,530
その他費用	2,690,203	3,094,972
営業費用合計	1,106,347,612	1,272,550,161
営業利益又は営業損失（△）	7,281,678,783	6,154,174,311
経常利益又は経常損失（△）	7,281,678,783	6,154,174,311
当期純利益又は当期純損失（△）	7,281,678,783	6,154,174,311
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（△）	792,260,318	△225,274,351
期首剰余金又は期首欠損金（△）	33,582,898,988	45,052,813,650
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,717,061,191	15,413,438,460
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	14,717,061,191	15,413,438,460
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,689,441,328	13,304,290,750
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,689,441,328	13,304,290,750
分配金	47,123,666	50,216,356
期末剰余金又は期末欠損金（△）	45,052,813,650	53,491,193,666

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年 2月19日から2021年 2月18日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第10期 2020年 2月18日現在	第11期 2021年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 47,123,666,928口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 50,216,356,614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 1.9561円 (10,000口当たり純資産額) (19,561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 2.0652円 (10,000口当たり純資産額) (20,652円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,704,610,204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>4,646,841,018円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>35,518,005,853円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>3,230,480,241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>45,099,937,316円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>47,123,666,928口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>9,570円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>47,123,666円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,704,610,204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	4,646,841,018円	収益調整金額	C	35,518,005,853円	分配準備積立金額	D	3,230,480,241円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	45,099,937,316円	当ファンドの期末残存口数	F	47,123,666,928口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,570円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	47,123,666円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,762,609,272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>4,616,839,390円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>39,931,043,512円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>7,230,917,848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>53,541,410,022円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>50,216,356,614口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>10,662円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>50,216,356円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,762,609,272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	4,616,839,390円	収益調整金額	C	39,931,043,512円	分配準備積立金額	D	7,230,917,848円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	53,541,410,022円	当ファンドの期末残存口数	F	50,216,356,614口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,662円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	50,216,356円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,704,610,204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	4,646,841,018円																																																											
収益調整金額	C	35,518,005,853円																																																											
分配準備積立金額	D	3,230,480,241円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	45,099,937,316円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	47,123,666,928口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	9,570円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	47,123,666円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,762,609,272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	4,616,839,390円																																																											
収益調整金額	C	39,931,043,512円																																																											
分配準備積立金額	D	7,230,917,848円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	53,541,410,022円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	50,216,356,614口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	10,662円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	50,216,356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10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第10期 2020年 2月18日現在	第11期 2021年 2月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
期首元本額 42,222,126,595円	期首元本額 47,123,666,928円
期中追加設定元本額 17,015,753,904円	期中追加設定元本額 17,367,085,936円
期中一部解約元本額 12,114,213,571円	期中一部解約元本額 14,274,396,250円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	7,989,489,405	7,817,618,818
合計	7,989,489,405	7,817,618,818

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年2月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年2月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	8,148,951,180	16,382,651,452	
		外国債券マザーファンド	13,003,648,989	32,139,818,841	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7,401,513,965	26,661,733,604	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	9,775,501,630	12,933,966,206	
		世界REITインデックスマザーファンド	8,027,161,187	14,604,617,063	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：99.1%	46,356,776,951	102,722,787,166 100.0%	
合計				102,722,787,166	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【のむラップ・ファンド（やや積極型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 (2020年 2月18日現在)	第5期 (2021年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	61,044,452	89,955,504
親投資信託受益証券	3,042,513,026	4,403,953,354
未収入金	-	11,511,000
流動資産合計	3,103,557,478	4,505,419,858
資産合計	3,103,557,478	4,505,419,858
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	2,414,361	3,288,501
未払解約金	11,704,986	26,882,017
未払受託者報酬	436,814	692,985
未払委託者報酬	18,564,679	29,451,691
未払利息	38	82
その他未払費用	43,620	69,238
流動負債合計	33,164,498	60,384,514
負債合計	33,164,498	60,384,514
純資産の部		
元本等		
元本	2,414,361,309	3,288,501,593
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	656,031,671	1,156,533,751
（分配準備積立金）	251,073,126	539,992,157
元本等合計	3,070,392,980	4,445,035,344
純資産合計	3,070,392,980	4,445,035,344
負債純資産合計	3,103,557,478	4,505,419,858

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	303,720,212	427,614,328
営業収益合計	303,720,212	427,614,328
営業費用		
支払利息	19,848	20,006
受託者報酬	818,437	1,240,809
委託者報酬	34,783,805	52,734,085
その他費用	81,720	123,962
営業費用合計	35,703,810	54,118,862
営業利益又は営業損失（△）	268,016,402	373,495,466
経常利益又は経常損失（△）	268,016,402	373,495,466
当期純利益又は当期純損失（△）	268,016,402	373,495,466
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	38,880,492	16,568,580
期首剰余金又は期首欠損金（△）	288,223,404	656,031,671
剰余金増加額又は欠損金減少額	261,307,534	384,095,844
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	261,307,534	384,095,844
剰余金減少額又は欠損金増加額	120,220,816	237,232,149
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	120,220,816	237,232,149
分配金	2,414,361	3,288,501
期末剰余金又は期末欠損金（△）	656,031,671	1,156,533,751

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年 2月19日から2021年 2月18日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 2020年 2月18日現在	第5期 2021年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,414,361,309口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,288,501,593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 1.2717円 (10,000口当たり純資産額) (12,717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 1.3517円 (10,000口当たり純資産額) (13,517円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>53,096,539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>176,039,371円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>404,958,545円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>24,351,577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>658,446,032円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,414,361,309口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>2,727円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>2,414,361円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	53,096,539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	176,039,371円	収益調整金額	C	404,958,545円	分配準備積立金額	D	24,351,577円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	658,446,032円	当ファンドの期末残存口数	F	2,414,361,309口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,727円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,414,361円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>72,123,597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>284,803,289円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>616,541,594円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>186,353,772円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>1,159,822,252円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,288,501,593口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>3,526円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>3,288,501円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	72,123,597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	284,803,289円	収益調整金額	C	616,541,594円	分配準備積立金額	D	186,353,772円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,159,822,252円	当ファンドの期末残存口数	F	3,288,501,593口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,526円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,288,501円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	53,096,539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	176,039,371円																																																											
収益調整金額	C	404,958,545円																																																											
分配準備積立金額	D	24,351,577円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	658,446,032円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,414,361,309口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,727円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	2,414,361円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	72,123,597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	284,803,289円																																																											
収益調整金額	C	616,541,594円																																																											
分配準備積立金額	D	186,353,772円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,159,822,252円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	3,288,501,593口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,526円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	3,288,501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4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 2月18日現在	第5期 2021年 2月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
期首元本額 1,941,082,518円	期首元本額 2,414,361,309円
期中追加設定元本額 1,250,105,711円	期中追加設定元本額 1,873,074,115円
期中一部解約元本額 776,826,920円	期中一部解約元本額 998,933,831円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第5期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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	278,062,060	419,800,642
合計	278,062,060	419,800,642

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年2月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年2月18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	314,971,584	633,218,872	
		外国債券マザーファンド	430,865,064	1,064,926,092	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	473,502,633	1,705,651,184	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	267,624,556	354,094,050	
		世界REITインデックスマザーファンド	355,096,821	646,063,156	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：99.1%	1,842,060,658	4,403,953,354 100.0%	
合計				4,403,953,354	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【のむラップ・ファンド（積極型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 (2020年 2月18日現在)	第11期 (2021年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	645,463,588	839,856,149
親投資信託受益証券	32,032,922,480	39,337,762,128
未収入金	-	114,494,000
流動資産合計	32,678,386,068	40,292,112,277
資産合計	32,678,386,068	40,292,112,277
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	14,203,501	16,262,041
未払解約金	84,321,268	274,444,665
未払受託者報酬	4,807,079	6,167,413
未払委託者報酬	216,318,557	277,533,464
未払利息	401	770
その他未払費用	480,654	616,680
流動負債合計	320,131,460	575,025,033
負債合計	320,131,460	575,025,033
純資産の部		
元本等		
元本	14,203,501,186	16,262,041,689
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,154,753,422	23,455,045,555
（分配準備積立金）	4,742,787,203	6,782,965,780
元本等合計	32,358,254,608	39,717,087,244
純資産合計	32,358,254,608	39,717,087,244
負債純資産合計	32,678,386,068	40,292,112,277

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
営業収益		
有価証券売買等損益	3,884,127,140	3,900,729,648
営業収益合計	3,884,127,140	3,900,729,648
営業費用		
支払利息	221,898	187,359
受託者報酬	9,174,096	11,312,148
委託者報酬	412,834,246	509,046,505
その他費用	917,300	1,131,093
営業費用合計	423,147,540	521,677,105
営業利益又は営業損失（△）	3,460,979,600	3,379,052,543
経常利益又は経常損失（△）	3,460,979,600	3,379,052,543
当期純利益又は当期純損失（△）	3,460,979,600	3,379,052,543
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（△）	421,665,202	△75,630,301
期首剰余金又は期首欠損金（△）	13,314,412,054	18,154,753,422
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,533,406,428	8,932,789,820
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,533,406,428	8,932,789,820
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,718,175,957	7,070,918,490
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,718,175,957	7,070,918,490
分配金	14,203,501	16,262,041
期末剰余金又は期末欠損金（△）	18,154,753,422	23,455,045,555

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2020年 2月19日から2021年 2月18日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第10期 2020年 2月18日現在	第11期 2021年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 14,203,501,186口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 16,262,041,689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 2.2782円 (10,000口当たり純資産額) (22,782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 2.4423円 (10,000口当たり純資産額) (24,423円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>608,090,842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>2,431,223,556円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>13,411,966,219円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,717,676,306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>18,168,956,923円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>14,203,501,186口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>12,791円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>14,203,501円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	608,090,842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	2,431,223,556円	収益調整金額	C	13,411,966,219円	分配準備積立金額	D	1,717,676,306円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,168,956,923円	当ファンドの期末残存口数	F	14,203,501,186口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	12,791円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	14,203,501円	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>646,449,178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>2,808,233,666円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>16,672,079,775円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>3,344,544,977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>23,471,307,596円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>16,262,041,689口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>14,433円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>10円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>16,262,041円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	646,449,178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	2,808,233,666円	収益調整金額	C	16,672,079,775円	分配準備積立金額	D	3,344,544,977円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,471,307,596円	当ファンドの期末残存口数	F	16,262,041,689口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,433円	10,000口当たり分配金額	H	10円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	16,262,041円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	608,090,842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	2,431,223,556円																																																											
収益調整金額	C	13,411,966,219円																																																											
分配準備積立金額	D	1,717,676,306円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,168,956,923円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	14,203,501,186口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	12,791円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	14,203,501円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	646,449,178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	2,808,233,666円																																																											
収益調整金額	C	16,672,079,775円																																																											
分配準備積立金額	D	3,344,544,977円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,471,307,596円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	16,262,041,689口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	14,433円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	10円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	16,262,041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10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第10期 2020年 2月18日現在	第11期 2021年 2月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2. 時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
期首元本額 13,011,177,658円	期首元本額 14,203,501,186円
期中追加設定元本額 5,773,245,162円	期中追加設定元本額 7,849,562,545円
期中一部解約元本額 4,580,921,634円	期中一部解約元本額 5,791,022,042円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第10期 自 2019年 2月19日 至 2020年 2月18日	第11期 自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18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	3,687,762,487	3,953,639,258
合計	3,687,762,487	3,953,639,258

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2021年2月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年2月18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	2,298,735,416	4,621,377,680	
		外国債券マザーファンド	2,745,091,321	6,784,767,708	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	5,728,040,142	20,633,546,199	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,303,390,106	1,724,515,449	
		世界REITインデックスマザーファンド	3,063,402,821	5,573,555,092	
	小計	銘柄数:5 組入時価比率:99.0%	15,138,659,806	39,337,762,128 100.0%	
合計				39,337,762,128	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「のむラップ・ファンド」の各ファンドは「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」および「世界REITインデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2021年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,485,697,636
株式	406,973,266,290
派生商品評価勘定	308,821,643
未収入金	2,389,785
未収配当金	601,404,489
未収利息	301,187
その他未収収益	12,572,916
流動資産合計	419,384,453,946

(2021年 2月18日現在)

資産合計	419,384,453,946
負債の部	
流動負債	
前受金	79,367,504
未払解約金	579,124,649
未払利息	10,541
有価証券貸借取引受入金	5,143,593,759
流動負債合計	5,802,096,453
負債合計	5,802,096,453
純資産の部	
元本等	
元本	205,717,845,140
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	207,864,512,353
元本等合計	413,582,357,493
純資産合計	413,582,357,493
負債純資産合計	419,384,453,946

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 2月18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	2.0104円

(10,000口当たり純資産額)	(20,104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	4,847,771,050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19日 至 2021年 2月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○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

2021年 2月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 2月18日現在	
期首	2020年 2月19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	267,298,763,473円
同期中における追加設定元本額	41,522,107,691円
同期中における一部解約元本額	103,103,026,024円
期末元本額	205,717,845,140円
期末元本額の内訳※	
バランスセレクト30	142,236,040円
バランスセレクト50	320,210,918円
バランスセレクト70	442,704,746円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,429,563,940円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,102,782,372円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	7,469,938,945円
野村資産設計ファンド2015	41,033,184円
野村資産設計ファンド2020	41,362,809円
野村資産設計ファンド2025	75,717,363円
野村資産設計ファンド2030	102,240,954円
野村資産設計ファンド2035	82,749,144円
野村資産設計ファンド2040	161,798,638円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	33,414,302,335円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,249,717,074円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,148,951,180円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,298,735,416円
野村資産設計ファンド2045	24,890,629円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,450,214,134円
マイ・ロード	3,202,126,814円
ネクストコア	36,778,564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	1,365,676,809円
野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）	2,272,774,511円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,961,804,750円
野村資産設計ファンド2050	40,120,946円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	13,622,331円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	7,017,328円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,136,821円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,948,961円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	281,911,259円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	314,971,584円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	3,276,707円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,660,064円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	14,993,957円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	5,335,146円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	20,309,626円
野村6資産均等バランス	1,726,805,099円
世界6資産分散ファンド	83,195,786円
野村資産設計ファンド2060	18,210,584円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	629,480,357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）	351,070,742円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	173,598,836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）	546,035,113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）	644,744,754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）	3,516,018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）	9,047,716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）	853,365円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,569,819,723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）	9,344,155円
野村ワールド・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	86,890,622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）	68,632,141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）	23,913,059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）	96,433,313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）	226,260,802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）	4,256,750,599円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	61,835,426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）	355,042,604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）	1,560,821,124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）	296,878,559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）	859,156,936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）	2,443,661円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	5,833,744円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	27,024,171円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	32,389,988円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	118,075,985円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	9,124,815,387円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	24,251,395,313円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	26,651,317,705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）	31,574,025,963円
マイバランスＤＣ３０	3,157,095,770円
マイバランスＤＣ５０	5,191,124,832円
マイバランスＤＣ７０	5,002,854,563円
野村ＤＣ国内株式インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	9,798,878,371円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	715,272,983円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	60,307,910円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	1,071,961,845円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	861,036,787円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	719,793,979円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	8,492,852円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	4,162,332円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	60,270,589円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	16,309,319円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	13,785,100円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	12,010,387円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	357,039,786円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	289,977,194円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	168,266,705円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	204,741,367円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	6,187,120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(2021年2月18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	6,800	3,060.00	20,808,000	
		日本水産	193,100	495.00	95,584,500	
		マルハニチロ	32,500	2,444.00	79,430,000	
		雪国まいたけ	12,800	1,741.00	22,284,800	
		カネコ種苗	6,300	1,580.00	9,954,000	
		サカタのタネ	24,800	4,025.00	99,820,000	
		ホクト	17,400	2,146.00	37,340,400	貸付有価証券 400株
		ホクリヨウ	3,200	676.00	2,163,200	
		住石ホールディングス	36,400	113.00	4,113,200	
		日鉄鉱業	4,800	5,700.00	27,360,000	
		三井松島ホールディングス	8,700	932.00	8,108,400	
		国際石油開発帝石	764,700	790.00	604,113,000	貸付有価証券 200株
		石油資源開発	27,200	2,386.00	64,899,200	貸付有価証券 100株
		K&Oエナジーグループ	10,100	1,440.00	14,544,000	
		ヒノキヤグループ	5,200	2,208.00	11,481,600	
		ショーボンドホールディングス	29,700	4,745.00	140,926,500	
		ミライト・ホールディングス	72,100	1,733.00	124,949,300	
		タマホーム	12,600	1,915.00	24,129,000	
		サンヨーホームズ	2,400	819.00	1,965,600	
		日本アクア	8,300	620.00	5,146,000	
		ファーストコーポレーション	6,400	707.00	4,524,800	

ベステラ	4,000	1,672.00	6,688,000	
TATERU	39,000	178.00	6,942,000	
キャンディル	3,600	538.00	1,936,800	
スペースバリューホールディングス	25,400	737.00	18,719,800	
ダイセキ環境ソリューション	4,000	812.00	3,248,000	
第一カッター興業	5,100	1,308.00	6,670,800	
安藤・間	133,300	768.00	102,374,400	
東急建設	60,900	537.00	32,703,300	
コムシスホールディングス	73,700	3,280.00	241,736,000	
ビーアールホールディングス	24,500	727.00	17,811,500	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	12,900	2,155.00	27,799,500	
東建コーポレーション	6,400	8,640.00	55,296,000	
ソネック	2,100	826.00	1,734,600	
ヤマウラ	9,000	950.00	8,550,000	貸付有価証券 500株
大成建設	149,400	3,750.00	560,250,000	
大林組	480,200	922.00	442,744,400	
清水建設	449,800	803.00	361,189,400	
飛鳥建設	13,800	1,114.00	15,373,200	
長谷工コーポレーション	157,300	1,377.00	216,602,100	
松井建設	18,900	707.00	13,362,300	
銭高組	2,100	4,515.00	9,481,500	
鹿島建設	351,800	1,430.00	503,074,000	
不動テトラ	11,800	1,802.00	21,263,600	
大末建設	6,100	893.00	5,447,300	
鉄建建設	9,700	1,962.00	19,031,400	
西松建設	34,400	2,543.00	87,479,200	貸付有価証券 2,900株
三井住友建設	116,000	457.00	53,012,000	
大豊建設	10,500	3,670.00	38,535,000	貸付有価証券 4,900株
前田建設工業	120,300	942.00	113,322,600	
佐田建設	11,100	430.00	4,773,000	
ナカノフドー建設	11,500	376.00	4,324,000	

奥村組	26,400	2,648.00	69,907,200	
東鉄工業	20,600	2,687.00	55,352,200	
イチケン	3,500	2,013.00	7,045,500	
富士ピー・エス	6,200	591.00	3,664,200	貸付有価証券 1,100株
浅沼組	5,800	4,545.00	26,361,000	
戸田建設	199,400	748.00	149,151,200	貸付有価証券 3,700株
熊谷組	22,300	2,811.00	62,685,300	
北野建設	2,900	2,462.00	7,139,800	
植木組	2,100	2,893.00	6,075,300	貸付有価証券 200株
矢作建設工業	21,200	845.00	17,914,000	
ピーエス三菱	15,800	689.00	10,886,200	
日本ハウスホールディングス	32,800	330.00	10,824,000	
大東建託	52,400	12,020.00	629,848,000	
新日本建設	20,400	842.00	17,176,800	
N I P P O	39,700	2,827.00	112,231,900	
東亜道路工業	3,000	4,065.00	12,195,000	
前田道路	29,700	2,001.00	59,429,700	貸付有価証券 1,200株
日本道路	4,600	7,900.00	36,340,000	
東亜建設工業	12,800	2,102.00	26,905,600	貸付有価証券 7,900株（2,700株）
日本国土開発	46,700	562.00	26,245,400	
若築建設	8,600	1,270.00	10,922,000	
東洋建設	53,800	554.00	29,805,200	
五洋建設	204,000	800.00	163,200,000	
世紀東急工業	23,100	892.00	20,605,200	
福田組	5,600	5,160.00	28,896,000	
住友林業	113,000	2,105.00	237,865,000	貸付有価証券 4,700株
日本基礎技術	14,700	494.00	7,261,800	
巴コーポレーション	21,300	392.00	8,349,600	
大和ハウス工業	443,400	3,272.00	1,450,804,800	
ライト工業	27,500	1,659.00	45,622,500	
積水ハウス	520,800	2,082.50	1,084,566,000	

日特建設	12,500	784.00	9,800,000	貸付有価証券 100株
北陸電気工事	8,300	1,186.00	9,843,800	
ユアテック	27,500	824.00	22,660,000	
日本リーテック	10,000	2,573.00	25,730,000	貸付有価証券 200株（200株）
四電工	2,600	2,794.00	7,264,400	
中電工	22,100	2,209.00	48,818,900	
関電工	78,100	881.00	68,806,100	
きんでん	103,700	1,785.00	185,104,500	
東京エネシス	15,900	930.00	14,787,000	
トーエネック	4,800	3,810.00	18,288,000	
住友電設	13,600	2,434.00	33,102,400	
日本電設工業	26,300	1,964.00	51,653,200	
協和エクシオ	72,800	2,728.00	198,598,400	
新日本空調	12,700	2,245.00	28,511,500	
九電工	33,700	3,395.00	114,411,500	
三機工業	34,000	1,286.00	43,724,000	貸付有価証券 500株
日揮ホールディングス	160,200	1,353.00	216,750,600	
中外炉工業	5,200	1,751.00	9,105,200	
ヤマト	15,400	676.00	10,410,400	
太平電業	10,600	2,626.00	27,835,600	
高砂熱学工業	43,400	1,626.00	70,568,400	
三晃金属工業	1,900	3,000.00	5,700,000	
朝日工業社	3,600	3,005.00	10,818,000	
明星工業	31,100	828.00	25,750,800	
大気社	23,300	2,953.00	68,804,900	
ダイダン	10,700	2,846.00	30,452,200	
日比谷総合設備	15,500	1,867.00	28,938,500	
フィル・カンパニー	2,700	2,077.00	5,607,900	
OSJBホールディングス	69,900	270.00	18,873,000	
レイズネクスト	25,800	1,197.00	30,882,600	
ニッポン	45,000	1,615.00	72,675,000	
日清製粉グループ本社	173,600	1,756.00	304,841,600	
日東富士製粉	1,100	6,780.00	7,458,000	

昭和産業	12,900	3,280.00	42,312,000	
鳥越製粉	13,600	850.00	11,560,000	
中部飼料	18,800	1,430.00	26,884,000	
フィード・ワン	20,600	912.00	18,787,200	
東洋精糖	2,600	1,224.00	3,182,400	
日本甜菜製糖	8,000	1,674.00	13,392,000	貸付有価証券 200株
三井製糖	12,100	1,932.00	23,377,200	
塩水港精糖	18,300	229.00	4,190,700	
日新製糖	7,300	1,866.00	13,621,800	
森永製菓	36,100	4,125.00	148,912,500	
中村屋	3,700	3,945.00	14,596,500	
江崎グリコ	42,300	4,610.00	195,003,000	
名糖産業	6,800	1,516.00	10,308,800	
井村屋グループ	8,700	2,458.00	21,384,600	
不二家	9,800	2,301.00	22,549,800	
山崎製パン	115,200	1,934.00	222,796,800	貸付有価証券 1,000株
第一屋製パン	3,000	970.00	2,910,000	
モロゾフ	2,400	5,650.00	13,560,000	
亀田製菓	8,800	4,820.00	42,416,000	
寿スピリッツ	14,800	6,840.00	101,232,000	貸付有価証券 2,600株
カルビー	70,000	2,952.00	206,640,000	
森永乳業	28,400	4,875.00	138,450,000	
六甲バター	10,200	1,791.00	18,268,200	
ヤクルト本社	105,700	5,690.00	601,433,000	
明治ホールディングス	101,600	7,100.00	721,360,000	
雪印メグミルク	37,000	2,217.00	82,029,000	
プリマハム	21,600	3,430.00	74,088,000	
日本ハム	58,700	4,710.00	276,477,000	
林兼産業	5,100	628.00	3,202,800	
丸大食品	15,100	1,704.00	25,730,400	貸付有価証券 400株
S Foods	13,800	3,485.00	48,093,000	貸付有価証券 5,200株
柿安本店	5,300	2,749.00	14,569,700	貸付有価証券 2,800株

伊藤ハム米久ホールディングス	99,000	752.00	74,448,000	
サッポロホールディングス	52,400	2,249.00	117,847,600	
アサヒグループホールディングス	335,700	4,619.00	1,550,598,300	
キリンホールディングス	651,800	2,114.00	1,377,905,200	貸付有価証券 600株
宝ホールディングス	113,900	1,580.00	179,962,000	
オエノンホールディングス	43,700	400.00	17,480,000	
養命酒製造	4,700	1,924.00	9,042,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	117,700	1,861.00	219,039,700	貸付有価証券 1,900株
サントリー食品インターナショナル	102,800	3,735.00	383,958,000	
ダイドーグループホールディングス	8,700	5,340.00	46,458,000	貸付有価証券 4,200株（3,800株）
伊藤園	46,700	6,520.00	304,484,000	貸付有価証券 2,800株
キーコーヒー	15,100	2,161.00	32,631,100	
ユニカフェ	4,600	1,010.00	4,646,000	
ジャパンフーズ	2,200	1,251.00	2,752,200	
日清オイリオグループ	19,800	3,200.00	63,360,000	
不二製油グループ本社	37,500	3,295.00	123,562,500	
かどや製油	1,700	4,105.00	6,978,500	
J-オイルミルズ	7,200	3,800.00	27,360,000	
キッコーマン	110,600	7,630.00	843,878,000	貸付有価証券 1,900株
味の素	365,500	2,288.50	836,446,750	
ブルドックソース	8,000	2,346.00	18,768,000	貸付有価証券 3,700株
キューピー	85,600	2,423.00	207,408,800	
ハウス食品グループ本社	57,500	3,770.00	216,775,000	
カゴメ	62,800	3,405.00	213,834,000	貸付有価証券 1,900株
焼津水産化学工業	7,400	1,000.00	7,400,000	
アリアケジャパン	14,000	6,980.00	97,720,000	
ピエトロ	2,000	1,770.00	3,540,000	
エバラ食品工業	3,400	2,661.00	9,047,400	

やまみ	1,700	2,091.00	3,554,700	
ニチレイ	73,200	2,821.00	206,497,200	
東洋水産	79,100	4,645.00	367,419,500	
イトアンドホールディングス	5,300	1,982.00	10,504,600	貸付有価証券 2,700株
大冷	1,700	1,960.00	3,332,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,600	936.00	8,049,600	貸付有価証券 4,000株
日清食品ホールディングス	60,300	8,470.00	510,741,000	
永谷園ホールディングス	7,500	2,357.00	17,677,500	
一正蒲鉾	6,000	1,137.00	6,822,000	
フジッコ	16,600	2,022.00	33,565,200	
ロック・フィールド	16,600	1,590.00	26,394,000	
日本たばこ産業	824,000	1,950.00	1,606,800,000	貸付有価証券 16,700株
ケンコーマヨネーズ	9,400	1,975.00	18,565,000	
わらべや日洋ホールディングス	10,100	1,788.00	18,058,800	貸付有価証券 5,200株
なとり	8,600	1,990.00	17,114,000	貸付有価証券 100株
イフジ産業	2,400	941.00	2,258,400	
ピクルスコーポレーション	3,700	3,520.00	13,024,000	貸付有価証券 1,700株
北の達人コーポレーション	53,700	641.00	34,421,700	貸付有価証券 29,800株（25,200株）
ユーグレナ	66,400	995.00	66,068,000	貸付有価証券 27,700株（16,400株）
ミヨシ油脂	5,400	1,206.00	6,512,400	
理研ビタミン	14,500	1,370.00	19,865,000	
片倉工業	20,100	1,354.00	27,215,400	
グンゼ	11,000	3,805.00	41,855,000	
東洋紡	59,300	1,326.00	78,631,800	
ユニチカ	43,900	455.00	19,974,500	貸付有価証券 100株
富士紡ホールディングス	7,200	4,420.00	31,824,000	
倉敷紡績	13,800	1,901.00	26,233,800	
シキボウ	8,400	1,012.00	8,500,800	
日本毛織	49,300	956.00	47,130,800	

ダイトウボウ	24,200	107.00	2,589,400	貸付有価証券 12,400株（7,200株）
トーア紡コーポレーショ ン	6,000	478.00	2,868,000	
ダイドーリミテッド	19,700	190.00	3,743,000	貸付有価証券 9,200株
帝国繊維	16,900	2,305.00	38,954,500	貸付有価証券 100株
帝人	141,200	1,864.00	263,196,800	貸付有価証券 1,500株
東レ	1,085,800	712.50	773,632,500	
サカイオーベックス	4,000	2,856.00	11,424,000	
住江織物	3,300	2,040.00	6,732,000	
日本フェルト	8,500	447.00	3,799,500	貸付有価証券 700株
イチカワ	1,900	1,309.00	2,487,100	
日東製網	1,600	1,525.00	2,440,000	
アツギ	11,500	538.00	6,187,000	貸付有価証券 100株
ダイニック	5,700	792.00	4,514,400	
セーレン	36,900	1,866.00	68,855,400	貸付有価証券 8,600株
ソトー	6,000	831.00	4,986,000	
東海染工	1,900	1,128.00	2,143,200	
小松マテーレ	24,600	1,010.00	24,846,000	
ワコールホールディング ス	37,400	2,283.00	85,384,200	
ホギメディカル	20,200	3,250.00	65,650,000	
クラウドシアホールディ ングス	3,700	298.00	1,102,600	
T S I ホールディングス	45,500	277.00	12,603,500	貸付有価証券 900株
マツオカコーポレーショ ン	4,800	1,949.00	9,355,200	貸付有価証券 800株（800株）
ワールド	19,600	1,384.00	27,126,400	
三陽商会	7,800	729.00	5,686,200	貸付有価証券 4,700株（100株）
ナイガイ	5,500	331.00	1,820,500	
オンワードホールディン グス	90,100	280.00	25,228,000	貸付有価証券 47,300株

ルックホールディングス	5,100	1,112.00	5,671,200	
ゴールドウイン	24,800	7,410.00	183,768,000	貸付有価証券 200株
デサント	25,600	1,712.00	43,827,200	
キング	7,900	581.00	4,589,900	
ヤマトインターナショナル	13,200	337.00	4,448,400	
特種東海製紙	9,200	4,695.00	43,194,000	
王子ホールディングス	675,100	706.00	476,620,600	
日本製紙	66,300	1,376.00	91,228,800	貸付有価証券 3,100株
三菱製紙	21,300	366.00	7,795,800	
北越コーポレーション	107,300	506.00	54,293,800	
中越パルプ工業	5,700	1,194.00	6,805,800	
巴川製紙所	4,900	780.00	3,822,000	
大王製紙	72,300	2,100.00	151,830,000	
阿波製紙	3,900	455.00	1,774,500	
レンゴー	154,600	863.00	133,419,800	
トーモク	9,200	1,812.00	16,670,400	
ザ・パックス	11,400	2,691.00	30,677,400	
クラレ	236,200	1,202.00	283,912,400	貸付有価証券 1,000株
旭化成	994,000	1,163.50	1,156,519,000	
共和レザー	8,200	668.00	5,477,600	
昭和電工	113,900	2,649.00	301,721,100	貸付有価証券 100株
住友化学	1,180,500	514.00	606,777,000	貸付有価証券 200株
住友精化	7,300	3,990.00	29,127,000	
日産化学	82,700	6,060.00	501,162,000	
ラサ工業	4,900	2,204.00	10,799,600	
クレハ	12,900	7,180.00	92,622,000	
多木化学	5,800	6,230.00	36,134,000	貸付有価証券 400株
テイカ	11,000	1,456.00	16,016,000	
石原産業	26,900	796.00	21,412,400	
片倉コープアグリ	3,900	1,277.00	4,980,300	
日本曹達	21,000	3,385.00	71,085,000	

東ソー	231,800	1,951.00	452,241,800	
トクヤマ	44,600	2,600.00	115,960,000	
セントラル硝子	28,600	2,249.00	64,321,400	
東亜合成	91,500	1,212.00	110,898,000	
大阪ソーダ	15,200	2,650.00	40,280,000	
関東電化工業	35,600	879.00	31,292,400	貸付有価証券 1,100株
デンカ	54,700	4,105.00	224,543,500	
信越化学工業	277,300	18,540.00	5,141,142,000	
日本カーバイド工業	5,300	1,315.00	6,969,500	
堺化学工業	10,500	2,026.00	21,273,000	
第一稀元素化学工業	15,100	998.00	15,069,800	
エア・ウォーター	152,900	1,715.00	262,223,500	
日本酸素ホールディングス	123,500	1,998.00	246,753,000	貸付有価証券 6,000株
日本化学工業	4,200	3,145.00	13,209,000	
東邦アセチレン	2,200	1,383.00	3,042,600	
日本パーカライジング	75,600	1,105.00	83,538,000	貸付有価証券 600株
高压ガス工業	23,800	744.00	17,707,200	
チタン工業	1,900	2,168.00	4,119,200	
四国化成工業	19,900	1,259.00	25,054,100	
戸田工業	3,200	2,086.00	6,675,200	
ステラ ケミファ	8,200	3,275.00	26,855,000	
保土谷化学工業	4,400	5,000.00	22,000,000	
日本触媒	27,200	5,790.00	157,488,000	
大日精化工業	12,400	2,401.00	29,772,400	
カネカ	38,800	4,265.00	165,482,000	
三菱瓦斯化学	150,200	2,551.00	383,160,200	貸付有価証券 200株
三井化学	129,400	3,305.00	427,667,000	
J S R	150,500	3,420.00	514,710,000	貸付有価証券 1,200株
東京応化工業	25,700	6,880.00	176,816,000	貸付有価証券 2,000株
大阪有機化学工業	13,800	3,720.00	51,336,000	貸付有価証券 1,200株
三菱ケミカルホールディ	1,002,500	733.70	735,534,250	

ングス				
KHネオケム	24,700	2,506.00	61,898,200	貸付有価証券 300株
ダイセル	201,600	830.00	167,328,000	
住友ベークライト	23,600	4,460.00	105,256,000	
積水化学工業	317,100	2,034.00	644,981,400	
日本ゼオン	135,200	1,639.00	221,592,800	
アイカ工業	41,800	3,915.00	163,647,000	
宇部興産	75,700	2,096.00	158,667,200	
積水樹脂	24,700	2,080.00	51,376,000	貸付有価証券 100株
タキロンシーアイ	32,400	688.00	22,291,200	
旭有機材	8,500	1,490.00	12,665,000	
ニチバン	7,900	1,829.00	14,449,100	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	36,600	496.00	18,153,600	貸付有価証券 400株
大倉工業	7,100	1,981.00	14,065,100	
積水化成成品工業	20,100	565.00	11,356,500	
群栄化学工業	3,400	2,509.00	8,530,600	
タイガースポリマー	7,900	463.00	3,657,700	
ミライアル	4,800	1,201.00	5,764,800	
ダイキアクシス	5,500	979.00	5,384,500	
ダイキョーニシカワ	31,600	820.00	25,912,000	貸付有価証券 2,700株
竹本容器	5,400	879.00	4,746,600	
森六ホールディングス	8,100	2,083.00	16,872,300	
恵和	2,200	1,946.00	4,281,200	貸付有価証券 200株
日本化薬	92,800	1,061.00	98,460,800	
カーリットホールディングス	14,900	731.00	10,891,900	貸付有価証券 9,100株
日本精化	10,900	1,419.00	15,467,100	
扶桑化学工業	11,800	3,965.00	46,787,000	
トリケミカル研究所	13,400	4,125.00	55,275,000	貸付有価証券 2,700株（400株）
ADEKA	69,000	1,858.00	128,202,000	
日油	56,500	5,750.00	324,875,000	
新日本理化	24,800	274.00	6,795,200	貸付有価証券

				11,600株（100株）
ハリマ化成グループ	11,200	943.00	10,561,600	
花王	366,600	7,504.00	2,750,966,400	貸付有価証券 200株
第一工業製薬	5,100	3,825.00	19,507,500	
石原ケミカル	3,800	2,193.00	8,333,400	
日華化学	5,100	886.00	4,518,600	
ニイタカ	3,100	2,716.00	8,419,600	貸付有価証券 100株
三洋化成工業	9,000	5,250.00	47,250,000	
有機合成薬品工業	11,500	295.00	3,392,500	貸付有価証券 1,100株
大日本塗料	16,900	933.00	15,767,700	貸付有価証券 100株
日本ペイントホールディングス	123,800	8,610.00	1,065,918,000	
関西ペイント	168,500	2,972.00	500,782,000	貸付有価証券 900株
神東塗料	11,800	203.00	2,395,400	
中国塗料	36,100	944.00	34,078,400	
日本特殊塗料	11,200	1,209.00	13,540,800	
藤倉化成	20,200	532.00	10,746,400	
太陽ホールディングス	11,000	5,820.00	64,020,000	
D I C	63,300	2,767.00	175,151,100	
サカタインクス	32,700	1,094.00	35,773,800	
東洋インキ S C ホールディングス	31,700	1,991.00	63,114,700	
T & K T O K A	11,600	835.00	9,686,000	貸付有価証券 100株
富士フイルムホールディングス	269,100	6,350.00	1,708,785,000	
資生堂	304,300	8,250.00	2,510,475,000	貸付有価証券 1,000株
ライオン	199,100	2,188.00	435,630,800	貸付有価証券 1,500株
高砂香料工業	9,600	2,605.00	25,008,000	
マンダム	32,100	1,846.00	59,256,600	
ミルボン	20,500	6,640.00	136,120,000	
ファンケル	55,800	4,040.00	225,432,000	貸付有価証券 1,100株

コーセー	28,800	18,360.00	528,768,000	貸付有価証券 100株
コタ	8,800	1,646.00	14,484,800	
シーボン	2,000	1,995.00	3,990,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	65,400	2,483.00	162,388,200	貸付有価証券 200株
ノエビアホールディングス	13,000	4,955.00	64,415,000	
アジュバンコスメジャパン	3,400	1,080.00	3,672,000	貸付有価証券 1,700株
新日本製薬	3,100	2,665.00	8,261,500	
エステー	9,800	1,988.00	19,482,400	
アグロ カネショウ	5,700	1,625.00	9,262,500	
コニシ	25,200	1,657.00	41,756,400	
長谷川香料	26,400	1,983.00	52,351,200	
星光PMC	8,800	755.00	6,644,000	
小林製薬	42,900	10,830.00	464,607,000	
荒川化学工業	12,800	1,294.00	16,563,200	
メック	10,500	2,050.00	21,525,000	貸付有価証券 1,200株（300株）
日本高純度化学	4,200	2,688.00	11,289,600	
タカラバイオ	40,100	3,260.00	130,726,000	
J C U	17,200	3,335.00	57,362,000	
新田ゼラチン	9,600	675.00	6,480,000	
O A Tアグリオ	2,900	1,394.00	4,042,600	
デクセリアルズ	42,700	1,455.00	62,128,500	
アース製薬	11,500	6,140.00	70,610,000	
北興化学工業	14,300	1,051.00	15,029,300	
大成ラミック	4,700	2,883.00	13,550,100	
クミアイ化学工業	63,300	891.00	56,400,300	
日本農薬	27,300	529.00	14,441,700	
アキレス	10,600	1,498.00	15,878,800	
有沢製作所	21,300	987.00	21,023,100	
日東電工	98,100	9,410.00	923,121,000	
レック	18,100	1,346.00	24,362,600	
三光合成	16,000	446.00	7,136,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
きもと	23,400	200.00	4,680,000	

藤森工業	13,700	4,595.00	62,951,500	
前澤化成工業	9,700	985.00	9,554,500	
未来工業	5,500	1,767.00	9,718,500	
ウェーブロックホールディングス	5,300	733.00	3,884,900	
J S P	9,000	1,808.00	16,272,000	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	28,100	4,180.00	117,458,000	
天馬	11,500	2,151.00	24,736,500	
信越ポリマー	23,600	1,029.00	24,284,400	
東リ	38,100	247.00	9,410,700	
ニフコ	56,200	3,875.00	217,775,000	
バルカー	12,400	2,141.00	26,548,400	
ユニ・チャーム	324,700	4,904.00	1,592,328,800	貸付有価証券 2,000株
ショーエイコーポレーション	3,400	1,013.00	3,444,200	貸付有価証券 300株
協和キリン	154,000	3,250.00	500,500,000	
武田薬品工業	1,274,000	3,740.00	4,764,760,000	
アステラス製薬	1,327,600	1,779.50	2,362,464,200	貸付有価証券 800株
大日本住友製薬	113,500	1,764.00	200,214,000	貸付有価証券 100株
塩野義製薬	192,600	5,984.00	1,152,518,400	
わかもと製薬	18,200	244.00	4,440,800	
あすか製薬	17,400	1,431.00	24,899,400	
日本新薬	43,400	7,780.00	337,652,000	
バイオフェルミン製薬	2,600	2,653.00	6,897,800	
中外製薬	478,900	5,362.00	2,567,861,800	
科研製薬	26,200	4,220.00	110,564,000	貸付有価証券 300株
エーザイ	169,200	7,738.00	1,309,269,600	
ロート製薬	73,000	3,030.00	221,190,000	
小野薬品工業	351,600	3,090.00	1,086,444,000	
久光製薬	44,500	7,000.00	311,500,000	貸付有価証券 200株
持田製薬	21,200	4,220.00	89,464,000	
参天製薬	266,400	1,579.00	420,645,600	

扶桑薬品工業	4,900	2,640.00	12,936,000	
日本ケミファ	1,800	2,293.00	4,127,400	
ツムラ	51,100	3,520.00	179,872,000	
日医工	43,400	1,063.00	46,134,200	
キッセイ薬品工業	27,100	2,253.00	61,056,300	
生化学工業	27,000	1,076.00	29,052,000	
栄研化学	26,900	2,166.00	58,265,400	
日水製薬	5,600	990.00	5,544,000	
鳥居薬品	9,600	3,000.00	28,800,000	
J C Rファーマ	43,200	3,230.00	139,536,000	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
東和薬品	22,000	2,242.00	49,324,000	
富士製薬工業	10,400	1,311.00	13,634,400	
沢井製薬	33,500	4,975.00	166,662,500	
ゼリア新薬工業	27,800	2,027.00	56,350,600	貸付有価証券 900株
第一三共	1,314,500	3,316.00	4,358,882,000	
キョーリン製薬ホールディングス	33,800	1,923.00	64,997,400	貸付有価証券 100株
大幸薬品	18,800	1,330.00	25,004,000	貸付有価証券 9,400株
ダイト	9,800	3,670.00	35,966,000	
大塚ホールディングス	318,200	4,529.00	1,441,127,800	貸付有価証券 300株
大正製薬ホールディングス	36,400	7,090.00	258,076,000	
ペプチドリーム	77,800	5,410.00	420,898,000	貸付有価証券 300株
日本コークス工業	129,400	106.00	13,716,400	貸付有価証券 100株
ニチレキ	18,100	1,552.00	28,091,200	
ユシロ化学工業	8,600	1,114.00	9,580,400	
ビーピー・カストロール	5,500	1,234.00	6,787,000	
富士石油	37,200	213.00	7,923,600	
MORESCO	5,500	1,150.00	6,325,000	貸付有価証券 100株
出光興産	169,900	2,830.00	480,817,000	
ENEOSホールディングス	2,303,500	464.00	1,068,824,000	

コスモエネルギーホールディングス	48,400	2,521.00	122,016,400	
横浜ゴム	88,700	1,793.00	159,039,100	
TOYO TIRE	80,600	1,886.00	152,011,600	貸付有価証券 500株
ブリヂストン	407,100	4,219.00	1,717,554,900	貸付有価証券 1,400株
住友ゴム工業	137,600	1,160.00	159,616,000	
藤倉コンポジット	13,400	437.00	5,855,800	
オカモト	9,300	4,055.00	37,711,500	
フコク	6,700	696.00	4,663,200	
ニッタ	15,800	2,448.00	38,678,400	
住友理工	29,700	648.00	19,245,600	
三ツ星ベルト	18,600	1,725.00	32,085,000	
バンドー化学	26,900	736.00	19,798,400	
日東紡績	22,800	4,455.00	101,574,000	貸付有価証券 800株
A G C	140,600	3,820.00	537,092,000	貸付有価証券 300株
日本板硝子	77,700	550.00	42,735,000	貸付有価証券 10,200株（10,100株）
石塚硝子	2,600	1,921.00	4,994,600	
日本山村硝子	6,400	929.00	5,945,600	
日本電気硝子	56,800	2,510.00	142,568,000	
オハラ	6,000	2,016.00	12,096,000	貸付有価証券 400株（300株）
住友大阪セメント	27,600	3,495.00	96,462,000	
太平洋セメント	90,700	2,585.00	234,459,500	
日本ヒューム	14,000	766.00	10,724,000	
日本コンクリート工業	33,000	361.00	11,913,000	
三谷セキサン	7,100	5,400.00	38,340,000	
アジアパイルホールディングス	23,500	508.00	11,938,000	
東海カーボン	149,700	1,451.00	217,214,700	
日本カーボン	8,400	4,090.00	34,356,000	
東洋炭素	9,000	2,021.00	18,189,000	
ノリタケカンパニーリミテド	8,500	3,540.00	30,090,000	
TOTO	109,400	6,970.00	762,518,000	

日本碍子	168,500	1,915.00	322,677,500	
日本特殊陶業	116,500	1,911.00	222,631,500	
ダントーホールディングス	11,400	372.00	4,240,800	貸付有価証券 6,800株
MARUWA	5,300	10,480.00	55,544,000	
品川リフラクトリーズ	3,600	2,738.00	9,856,800	
黒崎播磨	2,600	4,790.00	12,454,000	
ヨータイ	10,900	972.00	10,594,800	
イソライト工業	6,700	575.00	3,852,500	
東京窯業	19,500	320.00	6,240,000	
ニッカトー	6,900	726.00	5,009,400	
フジミインコーポレーテッド	12,300	4,185.00	51,475,500	
クニミネ工業	4,800	1,233.00	5,918,400	
エーアンドエーマテリアル	3,000	1,062.00	3,186,000	
ニチアス	38,700	2,463.00	95,318,100	
ニチハ	21,300	3,105.00	66,136,500	
日本製鉄	722,800	1,526.50	1,103,354,200	
神戸製鋼所	277,100	631.00	174,850,100	貸付有価証券 6,400株
中山製鋼所	21,000	407.00	8,547,000	貸付有価証券 600株
合同製鐵	8,200	2,116.00	17,351,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	438,100	1,102.00	482,786,200	
東京製鐵	59,000	721.00	42,539,000	
共英製鋼	17,100	1,442.00	24,658,200	
大和工業	32,200	2,729.00	87,873,800	
東京鐵鋼	5,800	1,980.00	11,484,000	貸付有価証券 2,600株
大阪製鐵	8,000	1,271.00	10,168,000	
淀川製鋼所	20,400	2,314.00	47,205,600	
丸一鋼管	49,200	2,517.00	123,836,400	
モリ工業	4,500	2,323.00	10,453,500	
大同特殊鋼	24,800	4,710.00	116,808,000	
日本高周波鋼業	5,600	369.00	2,066,400	
日本冶金工業	11,800	2,056.00	24,260,800	貸付有価証券

				200株
山陽特殊製鋼	18,100	1,778.00	32,181,800	貸付有価証券 1,900株
愛知製鋼	8,500	3,305.00	28,092,500	
日立金属	142,700	1,703.00	243,018,100	
日本金属	3,800	1,171.00	4,449,800	貸付有価証券 1,700株
大太平洋金属	10,200	2,332.00	23,786,400	貸付有価証券 300株
新日本電工	97,700	291.00	28,430,700	貸付有価証券 23,800株
栗本鐵工所	6,800	1,794.00	12,199,200	
虹技	2,100	1,154.00	2,423,400	
日本鑄鉄管	1,700	1,406.00	2,390,200	
三菱製鋼	11,200	737.00	8,254,400	
日亜鋼業	22,100	293.00	6,475,300	
日本精線	2,200	3,705.00	8,151,000	
エンビプロ・ホールディ ングス	6,400	740.00	4,736,000	
シンニッタン	18,300	220.00	4,026,000	貸付有価証券 300株
新家工業	3,700	1,414.00	5,231,800	
大紀アルミニウム工業所	22,800	784.00	17,875,200	
日本軽金属ホールディン グス	41,300	2,096.00	86,564,800	
三井金属鉱業	40,900	3,735.00	152,761,500	
東邦亜鉛	8,400	2,363.00	19,849,200	貸付有価証券 100株
三菱マテリアル	100,000	2,549.00	254,900,000	
住友金属鉱山	193,600	5,229.00	1,012,334,400	
DOWAホールディング ス	38,300	4,080.00	156,264,000	
古河機械金属	25,000	1,317.00	32,925,000	
大阪チタニウムテクノロ ジーズ	15,700	809.00	12,701,300	貸付有価証券 5,900株（300株）
東邦チタニウム	27,100	964.00	26,124,400	
U A C J	23,000	2,441.00	56,143,000	
C K サンエツ	3,200	3,875.00	12,400,000	
古河電気工業	47,000	2,883.00	135,501,000	貸付有価証券

				100株
住友電気工業	528,400	1,556.50	822,454,600	
フジクラ	182,800	511.00	93,410,800	貸付有価証券 600株
昭和電線ホールディングス	14,700	1,755.00	25,798,500	
東京特殊電線	1,900	2,552.00	4,848,800	
タツタ電線	26,700	662.00	17,675,400	
カナレ電気	2,500	1,725.00	4,312,500	
平河ヒューテック	8,400	1,190.00	9,996,000	貸付有価証券 3,900株
リョービ	18,600	1,304.00	24,254,400	
アーレスティ	18,600	411.00	7,644,600	貸付有価証券 1,300株
アサヒホールディングス	28,400	4,230.00	120,132,000	
稲葉製作所	8,500	1,445.00	12,282,500	
宮地エンジニアリンググループ	4,900	2,223.00	10,892,700	貸付有価証券 100株
トーカロ	39,100	1,378.00	53,879,800	
アルファC o	5,300	1,057.00	5,602,100	
SUMCO	193,800	2,469.00	478,492,200	貸付有価証券 1,900株
川田テクノロジーズ	3,100	4,545.00	14,089,500	
RS Technologies	4,900	5,940.00	29,106,000	
ジェイテックコーポレーション	1,300	3,530.00	4,589,000	貸付有価証券 100株
信和	8,000	765.00	6,120,000	
東洋製罐グループホールディングス	96,400	1,346.00	129,754,400	
ホッカンホールディングス	7,700	1,441.00	11,095,700	貸付有価証券 500株
コロナ	8,400	966.00	8,114,400	
横河ブリッジホールディングス	26,000	1,923.00	49,998,000	
駒井ハルテック	3,100	2,097.00	6,500,700	
高田機工	1,400	2,620.00	3,668,000	
三和ホールディングス	142,800	1,300.00	185,640,000	貸付有価証券 1,200株
文化シャッター	44,600	1,019.00	45,447,400	

三協立山	19,500	819.00	15,970,500	貸付有価証券 100株
アルインコ	10,000	966.00	9,660,000	
東洋シャッター	3,300	700.00	2,310,000	
L I X I L	208,500	2,870.00	598,395,000	
日本ファイルコン	10,500	498.00	5,229,000	
ノーリツ	31,400	1,669.00	52,406,600	
長府製作所	15,400	2,086.00	32,124,400	
リンナイ	29,400	11,490.00	337,806,000	
ダイニチ工業	7,200	877.00	6,314,400	貸付有価証券 200株
日東精工	19,000	487.00	9,253,000	
三洋工業	1,800	1,847.00	3,324,600	
岡部	30,700	792.00	24,314,400	
ジーテクト	18,800	1,452.00	27,297,600	貸付有価証券 300株
東ブレ	28,200	1,581.00	44,584,200	
高周波熱錬	29,100	536.00	15,597,600	貸付有価証券 16,700株
東京製鋼	10,800	1,444.00	15,595,200	貸付有価証券 5,600株（300株）
サンコール	13,000	490.00	6,370,000	
モリテック スチール	11,800	421.00	4,967,800	貸付有価証券 1,000株
パイオラックス	22,400	1,669.00	37,385,600	
エイチワン	14,800	796.00	11,780,800	
日本発條	150,800	820.00	123,656,000	
中央発條	1,800	2,816.00	5,068,800	
アドバネクス	2,200	1,565.00	3,443,000	
立川ブラインド工業	6,700	1,289.00	8,636,300	
三益半導体工業	11,800	2,607.00	30,762,600	
日本ドライケミカル	3,800	1,548.00	5,882,400	
日本製鋼所	46,000	2,843.00	130,778,000	
三浦工業	65,500	5,890.00	385,795,000	
タクマ	51,300	1,974.00	101,266,200	
ツガミ	31,400	1,585.00	49,769,000	
オークマ	17,700	6,070.00	107,439,000	
芝浦機械	15,700	2,929.00	45,985,300	

アマダ	221,900	1,263.00	280,259,700	
アイダエンジニアリング	39,600	968.00	38,332,800	
滝澤鉄工所	4,400	1,083.00	4,765,200	
F U J I	60,500	2,704.00	163,592,000	
牧野フライス製作所	17,800	4,105.00	73,069,000	
オーエスジー	74,700	1,972.00	147,308,400	
ダイジェット工業	1,700	1,363.00	2,317,100	
旭ダイヤモンド工業	39,700	501.00	19,889,700	
DMG森精機	95,800	1,569.00	150,310,200	貸付有価証券 400株
ソディック	33,000	997.00	32,901,000	貸付有価証券 400株
ディスコ	20,600	34,500.00	710,700,000	
日東工器	7,300	1,890.00	13,797,000	
日進工具	5,900	2,716.00	16,024,400	
パンチ工業	12,600	604.00	7,610,400	
富士ダイス	7,600	660.00	5,016,000	
豊和工業	8,400	872.00	7,324,800	
OKK	5,800	466.00	2,702,800	
東洋機械金属	10,800	461.00	4,978,800	
津田駒工業	2,900	900.00	2,610,000	
エンシュウ	3,600	893.00	3,214,800	
島精機製作所	22,100	2,297.00	50,763,700	
オプトラン	19,000	2,776.00	52,744,000	貸付有価証券 2,800株
N Cホールディングス	4,600	659.00	3,031,400	
イワキポンプ	9,600	830.00	7,968,000	
フリーー	14,800	1,123.00	16,620,400	
ヤマシンフィルタ	30,500	890.00	27,145,000	貸付有価証券 3,800株（100株）
日阪製作所	18,700	844.00	15,782,800	
やまびこ	29,400	1,202.00	35,338,800	
平田機工	7,200	7,420.00	53,424,000	
ペガサスミシン製造	15,300	455.00	6,961,500	貸付有価証券 300株
マルマエ	5,600	1,234.00	6,910,400	
タツモ	6,400	1,488.00	9,523,200	貸付有価証券 800株（100株）

ナブテスコ	89,200	4,900.00	437,080,000	
三井海洋開発	16,100	1,801.00	28,996,100	
レオン自動機	14,800	1,149.00	17,005,200	
SMC	44,800	65,820.00	2,948,736,000	
ホソカワミクロン	5,300	7,020.00	37,206,000	
ユニオンツール	5,600	3,405.00	19,068,000	
オイレス工業	21,200	1,705.00	36,146,000	
日精エー・エス・ビー機械	4,400	5,830.00	25,652,000	
サトーホールディングス	19,900	2,499.00	49,730,100	
技研製作所	13,300	5,160.00	68,628,000	
日本エアテック	4,900	1,223.00	5,992,700	貸付有価証券 2,300株（1,100株）
カワタ	4,100	924.00	3,788,400	貸付有価証券 2,500株
日精樹脂工業	11,600	911.00	10,567,600	
オカダアイヨン	4,800	1,189.00	5,707,200	貸付有価証券 2,200株
ワイエイシイホールディングス	6,000	986.00	5,916,000	貸付有価証券 900株
小松製作所	693,800	3,231.00	2,241,667,800	
住友重機械工業	87,600	2,914.00	255,266,400	貸付有価証券 1,200株
日立建機	71,600	3,230.00	231,268,000	
日工	22,800	725.00	16,530,000	
巴工業	6,000	2,031.00	12,186,000	
井関農機	15,300	1,540.00	23,562,000	
TOWA	14,300	2,048.00	29,286,400	
丸山製作所	3,100	1,602.00	4,966,200	
北川鉄工所	6,900	1,515.00	10,453,500	
ローツェ	6,700	7,540.00	50,518,000	貸付有価証券 100株
タカキタ	5,300	689.00	3,651,700	
クボタ	804,400	2,459.50	1,978,421,800	
荏原実業	3,800	4,725.00	17,955,000	
三菱化工機	4,900	2,995.00	14,675,500	貸付有価証券 300株
月島機械	28,200	1,339.00	37,759,800	

帝国電機製作所	10,700	1,207.00	12,914,900	貸付有価証券 100株
東京機械製作所	6,200	312.00	1,934,400	
新東工業	36,300	766.00	27,805,800	貸付有価証券 400株
澁谷工業	13,400	3,465.00	46,431,000	
アイチ コーポレーショ ン	26,400	905.00	23,892,000	
小森コーポレーション	38,800	701.00	27,198,800	
鶴見製作所	11,800	1,801.00	21,251,800	
住友精密工業	2,300	2,020.00	4,646,000	
日本ギア工業	6,100	310.00	1,891,000	
酒井重工業	2,700	2,129.00	5,748,300	
荏原製作所	63,500	4,010.00	254,635,000	
石井鐵工所	2,200	2,873.00	6,320,600	
西島製作所	15,400	853.00	13,136,200	
北越工業	15,800	1,110.00	17,538,000	
ダイキン工業	195,100	23,255.00	4,537,050,500	
オルガノ	5,000	6,080.00	30,400,000	
トーヨーカネツ	5,800	2,785.00	16,153,000	
栗田工業	82,900	4,335.00	359,371,500	
椿本チエイン	21,800	2,873.00	62,631,400	
大同工業	7,300	782.00	5,708,600	
木村化工機	12,700	625.00	7,937,500	貸付有価証券 2,800株
アネスト岩田	25,800	1,073.00	27,683,400	
ダイフク	84,300	11,220.00	945,846,000	
サムコ	3,800	3,570.00	13,566,000	貸付有価証券 800株（800株）
加藤製作所	8,400	990.00	8,316,000	
油研工業	2,600	1,641.00	4,266,600	
タダノ	73,900	1,012.00	74,786,800	
フジテック	52,700	2,594.00	136,703,800	
CKD	35,500	2,390.00	84,845,000	
キトー	12,900	1,478.00	19,066,200	
平和	42,700	1,580.00	67,466,000	
理想科学工業	11,800	1,385.00	16,343,000	
SANKYO	36,400	2,989.00	108,799,600	

日本金銭機械	16,900	525.00	8,872,500	
マースグループホールディングス	9,700	1,603.00	15,549,100	
フクシマガリレイ	10,500	4,100.00	43,050,000	
オーイズミ	6,400	402.00	2,572,800	
ダイコク電機	7,000	947.00	6,629,000	
竹内製作所	25,600	2,760.00	70,656,000	貸付有価証券 100株
アマノ	40,100	2,432.00	97,523,200	
JUKI	21,300	829.00	17,657,700	貸付有価証券 1,200株
蛇の目マシン工業	13,900	809.00	11,245,100	
マックス	21,000	1,605.00	33,705,000	
グローリー	39,300	2,339.00	91,922,700	
新晃工業	14,200	2,011.00	28,556,200	
大和冷機工業	24,600	1,087.00	26,740,200	
セガサミーホールディングス	139,200	1,830.00	254,736,000	貸付有価証券 100株
日本ピストンリング	5,600	1,049.00	5,874,400	
リケン	7,100	2,275.00	16,152,500	
T P R	20,600	1,538.00	31,682,800	貸付有価証券 300株
ツバキ・ナカシマ	29,300	1,233.00	36,126,900	
ホシザキ	48,200	9,910.00	477,662,000	貸付有価証券 200株
大豊工業	12,500	767.00	9,587,500	
日本精工	314,500	1,005.00	316,072,500	
NTN	354,400	311.00	110,218,400	
ジェイテクト	146,900	1,150.00	168,935,000	
不二越	14,200	4,585.00	65,107,000	
日本トムソン	41,900	546.00	22,877,400	
THK	95,500	3,660.00	349,530,000	
ユーシン精機	10,200	948.00	9,669,600	
前澤給装工業	5,600	2,210.00	12,376,000	
イーグル工業	18,900	1,161.00	21,942,900	
前澤工業	9,200	580.00	5,336,000	貸付有価証券 100株
日本ピラー工業	15,500	1,757.00	27,233,500	

キッツ	47,300	594.00	28,096,200	
マキタ	199,700	4,830.00	964,551,000	貸付有価証券 200株
日立造船	121,400	660.00	80,124,000	
三菱重工業	240,600	3,077.00	740,326,200	
I H I	102,900	1,977.00	203,433,300	貸付有価証券 300株
スター精密	23,600	1,561.00	36,839,600	
日清紡ホールディングス	93,600	797.00	74,599,200	
イビデン	73,700	4,785.00	352,654,500	貸付有価証券 400株
コニカミノルタ	310,700	574.00	178,341,800	貸付有価証券 6,500株
ブラザー工業	187,000	2,244.00	419,628,000	
ミネベアミツミ	263,900	2,640.00	696,696,000	貸付有価証券 300株
日立製作所	736,200	4,800.00	3,533,760,000	
東芝	12,800	3,620.00	46,336,000	
三菱電機	1,531,100	1,626.00	2,489,568,600	
富士電機	92,300	4,535.00	418,580,500	貸付有価証券 200株
東洋電機製造	6,000	1,211.00	7,266,000	
安川電機	164,800	5,800.00	955,840,000	
シンフォニアテクノロジー	19,800	1,352.00	26,769,600	
明電舎	26,000	2,395.00	62,270,000	
オリジン	4,100	1,346.00	5,518,600	
山洋電気	7,400	6,040.00	44,696,000	
デンヨー	13,000	2,187.00	28,431,000	
東芝テック	16,400	3,900.00	63,960,000	
芝浦メカトロニクス	2,700	4,855.00	13,108,500	
マブチモーター	42,400	4,940.00	209,456,000	
日本電産	368,500	14,600.00	5,380,100,000	貸付有価証券 14,800株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,200	764.00	7,028,800	貸付有価証券 200株（100株）
トレックス・セミコンダクター	8,200	1,503.00	12,324,600	
東光高岳	7,700	1,575.00	12,127,500	貸付有価証券

				200株
ダブル・スコープ	30,200	818.00	24,703,600	貸付有価証券 7,400株（100株）
ダイヘン	16,800	4,590.00	77,112,000	
ヤーマン	25,000	1,928.00	48,200,000	貸付有価証券 1,700株
JVCケンウッド	132,500	197.00	26,102,500	
ミマキエンジニアリング	13,700	559.00	7,658,300	
IPEX	7,100	2,097.00	14,888,700	貸付有価証券 1,800株
日新電機	35,900	1,245.00	44,695,500	
大崎電気工業	30,400	610.00	18,544,000	貸付有価証券 400株
オムロン	127,500	9,410.00	1,199,775,000	
日東工業	22,500	2,131.00	47,947,500	貸付有価証券 600株
IDEC	20,500	1,834.00	37,597,000	
正興電機製作所	3,600	2,333.00	8,398,800	貸付有価証券 100株
不二電機工業	2,500	1,278.00	3,195,000	
ジーエス・ユアサコーポレーション	55,100	3,365.00	185,411,500	
サクサホールディングス	3,600	1,507.00	5,425,200	
メルコホールディングス	5,300	3,800.00	20,140,000	
テクノメディカ	3,400	1,615.00	5,491,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	4,400	3,445.00	15,158,000	貸付有価証券 2,000株
日本電気	194,600	6,290.00	1,224,034,000	
富士通	137,800	15,735.00	2,168,283,000	
沖電気工業	62,200	1,045.00	64,999,000	貸付有価証券 100株
岩崎通信機	6,700	865.00	5,795,500	
電気興業	7,400	2,852.00	21,104,800	
サンケン電気	17,900	5,560.00	99,524,000	貸付有価証券 8,400株（400株）
ナカヨ	3,000	1,443.00	4,329,000	
アイホン	8,700	1,772.00	15,416,400	
ルネサスエレクトロニクス	658,700	1,206.00	794,392,200	貸付有価証券 15,500株
セイコーエプソン	190,000	1,767.00	335,730,000	貸付有価証券

				7,800株
ワコム	110,800	784.00	86,867,200	
アルバック	28,200	4,940.00	139,308,000	
アクセル	6,400	786.00	5,030,400	
E I Z O	13,000	3,770.00	49,010,000	
日本信号	35,700	966.00	34,486,200	貸付有価証券 300株
京三製作所	32,900	427.00	14,048,300	
能美防災	20,200	2,234.00	45,126,800	
ホーチキ	11,100	1,299.00	14,418,900	
星和電機	7,600	622.00	4,727,200	
エレコム	17,500	4,990.00	87,325,000	
パナソニック	1,633,000	1,459.50	2,383,363,500	
シャープ	177,200	2,256.00	399,763,200	貸付有価証券 4,000株
アンリツ	92,000	2,388.00	219,696,000	貸付有価証券 41,600株（500株）
富士通ゼネラル	46,800	3,070.00	143,676,000	貸付有価証券 100株
ソニー	959,200	12,000.00	11,510,400,000	
T D K	73,900	16,120.00	1,191,268,000	
帝国通信工業	6,700	1,153.00	7,725,100	
タムラ製作所	55,100	546.00	30,084,600	
アルプスアルパイン	125,100	1,420.00	177,642,000	
池上通信機	4,800	830.00	3,984,000	
日本電波工業	14,800	662.00	9,797,600	貸付有価証券 6,100株（1,400株）
鈴木	6,800	1,076.00	7,316,800	
日本トリム	3,300	4,425.00	14,602,500	
ローランド ディー. ジー.	9,000	1,877.00	16,893,000	
フォスター電機	16,100	1,344.00	21,638,400	
SMK	3,900	3,025.00	11,797,500	
ヨコオ	11,300	2,929.00	33,097,700	
ティアック	9,600	127.00	1,219,200	貸付有価証券 100株（100株）
ホシデン	41,800	1,042.00	43,555,600	
ヒロセ電機	23,600	16,560.00	390,816,000	

日本航空電子工業	35,100	1,702.00	59,740,200	
TOA	18,100	893.00	16,163,300	
マクセルホールディングス	30,400	1,410.00	42,864,000	
古野電気	19,700	1,146.00	22,576,200	貸付有価証券 500株
ユニデンホールディングス	3,900	2,294.00	8,946,600	
スミダコーポレーション	13,000	1,007.00	13,091,000	
アイコム	6,400	2,774.00	17,753,600	貸付有価証券 100株
リオン	6,400	3,050.00	19,520,000	
本多通信工業	11,900	503.00	5,985,700	
船井電機	17,200	469.00	8,066,800	
横河電機	153,200	2,197.00	336,580,400	貸付有価証券 700株
新電元工業	5,900	3,010.00	17,759,000	
アズビル	103,500	4,990.00	516,465,000	
東亜ディーケーケー	7,600	826.00	6,277,600	
日本光電工業	63,300	3,140.00	198,762,000	貸付有価証券 300株
チノー	4,800	1,399.00	6,715,200	
共和電業	16,000	383.00	6,128,000	
日本電子材料	5,500	1,774.00	9,757,000	貸付有価証券 2,600株（1,800株）
堀場製作所	30,300	6,730.00	203,919,000	
アドバンテスト	113,800	9,180.00	1,044,684,000	
小野測器	6,400	551.00	3,526,400	
エスベック	13,600	1,877.00	25,527,200	
キーエンス	150,300	58,140.00	8,738,442,000	
日置電機	7,300	3,910.00	28,543,000	
シスメックス	119,500	11,845.00	1,415,477,500	
日本マイクロニクス	26,600	1,820.00	48,412,000	
メガチップス	15,300	3,200.00	48,960,000	
OBARA GROUP	8,900	3,930.00	34,977,000	貸付有価証券 4,500株（4,500株）
澤藤電機	1,600	2,134.00	3,414,400	
原田工業	6,200	904.00	5,604,800	
コーセル	18,700	1,146.00	21,430,200	

イリソ電子工業	12,900	5,110.00	65,919,000	貸付有価証券 200株
オブテックスグループ	25,100	1,729.00	43,397,900	
千代田インテグレ	6,400	1,793.00	11,475,200	
アイ・オー・データ機器	5,600	1,007.00	5,639,200	
レーザーテック	67,200	13,880.00	932,736,000	
スタンレー電気	107,300	3,485.00	373,940,500	
岩崎電気	5,600	1,520.00	8,512,000	
ウシオ電機	78,500	1,359.00	106,681,500	
岡谷電機産業	10,900	376.00	4,098,400	貸付有価証券 5,100株
ヘリオス テクノ ホールディング	14,100	344.00	4,850,400	貸付有価証券 300株
エノモト	4,200	1,724.00	7,240,800	
日本セラミック	15,500	2,800.00	43,400,000	
遠藤照明	7,700	626.00	4,820,200	
古河電池	10,900	1,654.00	18,028,600	貸付有価証券 5,700株
双信電機	7,400	431.00	3,189,400	貸付有価証券 400株
山一電機	10,000	1,440.00	14,400,000	
図研	10,000	2,908.00	29,080,000	
日本電子	27,900	4,240.00	118,296,000	
カシオ計算機	123,100	2,001.00	246,323,100	貸付有価証券 2,200株
ファナック	134,400	29,050.00	3,904,320,000	
日本シイエムケイ	33,000	415.00	13,695,000	貸付有価証券 1,400株
エンプラス	6,900	4,700.00	32,430,000	
大真空	5,200	2,461.00	12,797,200	貸付有価証券 900株
ローム	63,700	11,230.00	715,351,000	
浜松ホトニクス	109,800	6,910.00	758,718,000	貸付有価証券 100株
三井ハイテック	15,000	4,150.00	62,250,000	
新光電気工業	51,400	2,905.00	149,317,000	
京セラ	233,400	6,996.00	1,632,866,400	
太陽誘電	68,100	5,590.00	380,679,000	
村田製作所	449,800	9,667.00	4,348,216,600	貸付有価証券

				500株
双葉電子工業	26,200	981.00	25,702,200	
北陸電気工業	5,700	930.00	5,301,000	
ニチコン	48,200	1,154.00	55,622,800	貸付有価証券 4,700株
日本ケミコン	15,500	1,792.00	27,776,000	
KOA	21,200	1,518.00	32,181,600	
市光工業	22,900	749.00	17,152,100	
小糸製作所	91,700	7,840.00	718,928,000	
ミツバ	28,200	629.00	17,737,800	貸付有価証券 1,200株（1,100株）
SCREENホールディングス	26,600	8,820.00	234,612,000	
キャノン電子	14,000	1,697.00	23,758,000	
キャノン	760,900	2,339.00	1,779,745,100	貸付有価証券 10,900株
リコー	389,500	939.00	365,740,500	
象印マホービン	41,400	1,817.00	75,223,800	貸付有価証券 2,700株
MUTOHホールディングス	1,900	1,586.00	3,013,400	貸付有価証券 800株
東京エレクトロン	89,700	42,880.00	3,846,336,000	
トヨタ紡織	44,600	1,713.00	76,399,800	
芦森工業	2,900	1,010.00	2,929,000	
ユニプレス	25,100	999.00	25,074,900	
豊田自動織機	123,900	9,310.00	1,153,509,000	貸付有価証券 200株
モリタホールディングス	24,500	1,801.00	44,124,500	貸付有価証券 400株
三櫻工業	21,200	1,002.00	21,242,400	貸付有価証券 100株
デンソー	337,100	6,728.00	2,268,008,800	
東海理化電機製作所	40,300	1,798.00	72,459,400	
三井E&Sホールディングス	59,300	445.00	26,388,500	貸付有価証券 1,200株
川崎重工業	119,100	2,374.00	282,743,400	貸付有価証券 800株
名村造船所	46,000	182.00	8,372,000	
サノヤスホールディングス	18,700	152.00	2,842,400	貸付有価証券 700株

日本車輛製造	5,600	2,529.00	14,162,400	
三菱ロジスネクスト	20,300	1,150.00	23,345,000	
近畿車輛	2,600	1,262.00	3,281,200	
日産自動車	1,805,800	595.40	1,075,173,320	貸付有価証券 5,000株
いすゞ自動車	443,700	1,124.00	498,718,800	
トヨタ自動車	1,551,200	8,093.00	12,553,861,600	
日野自動車	191,200	1,010.00	193,112,000	貸付有価証券 100株
三菱自動車工業	566,800	301.00	170,606,800	貸付有価証券 81,200株
エフテック	10,700	663.00	7,094,100	貸付有価証券 2,600株
レシップホールディングス	6,100	596.00	3,635,600	貸付有価証券 900株（900株）
GMB	2,700	916.00	2,473,200	貸付有価証券 600株
ファルテック	2,700	813.00	2,195,100	
武蔵精密工業	34,100	1,911.00	65,165,100	
日産車体	22,400	806.00	18,054,400	
新明和工業	43,300	949.00	41,091,700	貸付有価証券 1,000株
極東開発工業	26,400	1,595.00	42,108,000	
トピー工業	12,600	1,475.00	18,585,000	
ティラド	4,800	1,841.00	8,836,800	
タチエス	23,500	1,150.00	27,025,000	貸付有価証券 14,300株
NOK	74,100	1,433.00	106,185,300	
フタバ産業	38,300	536.00	20,528,800	貸付有価証券 4,000株
KYB	17,100	2,954.00	50,513,400	
大同メタル工業	31,600	560.00	17,696,000	
プレス工業	75,900	334.00	25,350,600	
ミクニ	19,400	284.00	5,509,600	
太平洋工業	32,100	1,220.00	39,162,000	
河西工業	20,700	419.00	8,673,300	
アイシン精機	112,100	3,555.00	398,515,500	
マツダ	480,600	866.00	416,199,600	貸付有価証券 5,800株

今仙電機製作所	13,400	756.00	10,130,400	
本田技研工業	1,205,600	3,052.00	3,679,491,200	貸付有価証券 100株
スズキ	303,500	5,023.00	1,524,480,500	
S U B A R U	438,800	2,028.50	890,105,800	貸付有価証券 200株
安永	7,400	1,179.00	8,724,600	貸付有価証券 100株
ヤマハ発動機	216,400	2,365.00	511,786,000	貸付有価証券 13,700株（1,600株）
T B K	18,200	435.00	7,917,000	
エクセディ	20,800	1,645.00	34,216,000	貸付有価証券 200株
豊田合成	49,500	2,906.00	143,847,000	貸付有価証券 100株
愛三工業	24,000	579.00	13,896,000	
盟和産業	2,300	888.00	2,042,400	
日本プラスト	12,900	576.00	7,430,400	
ヨロズ	13,100	1,341.00	17,567,100	貸付有価証券 600株
エフ・シー・シー	25,000	1,710.00	42,750,000	
シマノ	57,300	26,315.00	1,507,849,500	
テイ・エス テック	35,600	3,065.00	109,114,000	
ジャムコ	8,900	857.00	7,627,300	貸付有価証券 300株
テルモ	469,400	4,541.00	2,131,545,400	
クリエートメディック	5,100	973.00	4,962,300	
日機装	49,400	1,079.00	53,302,600	貸付有価証券 100株
日本エム・ディ・エム	8,800	2,049.00	18,031,200	
島津製作所	197,000	4,315.00	850,055,000	
J M S	12,900	1,041.00	13,428,900	
クボテック	3,900	373.00	1,454,700	貸付有価証券 100株（100株）
長野計器	11,100	995.00	11,044,500	
ブイ・テクノロジー	7,200	5,930.00	42,696,000	
東京計器	9,700	950.00	9,215,000	
愛知時計電機	2,000	4,345.00	8,690,000	
インターアクション	7,700	2,459.00	18,934,300	貸付有価証券

				100株（100株）
オーバル	13,700	301.00	4,123,700	
東京精密	25,800	4,820.00	124,356,000	
マニー	61,000	2,746.00	167,506,000	
ニコン	233,800	921.00	215,329,800	
トプコン	77,100	1,295.00	99,844,500	
オリンパス	847,200	2,334.50	1,977,788,400	
理研計器	13,500	2,935.00	39,622,500	
タムロン	12,300	2,010.00	24,723,000	貸付有価証券 100株
HOYA	303,800	13,195.00	4,008,641,000	
シード	6,500	653.00	4,244,500	
ノーリツ銅機	13,800	2,465.00	34,017,000	
エー・アンド・デイ	12,900	1,226.00	15,815,400	
朝日インテック	161,100	3,490.00	562,239,000	貸付有価証券 300株
シチズン時計	194,300	394.00	76,554,200	
リズム	4,800	793.00	3,806,400	
大研医器	12,100	575.00	6,957,500	
メニコン	23,500	6,910.00	162,385,000	貸付有価証券 1,000株
シンシア	1,600	807.00	1,291,200	
松風	7,000	1,780.00	12,460,000	
セイコーホールディングス	21,700	1,731.00	37,562,700	貸付有価証券 200株
ニプロ	114,100	1,396.00	159,283,600	
中本パックス	3,900	1,740.00	6,786,000	貸付有価証券 2,000株
スノーピーク	9,100	2,867.00	26,089,700	貸付有価証券 1,200株
パラマウントベッドホールディングス	14,700	4,580.00	67,326,000	
トランザクション	8,400	1,147.00	9,634,800	貸付有価証券 4,400株
粧美堂	4,500	404.00	1,818,000	貸付有価証券 100株
ニホンフラッシュ	13,100	1,210.00	15,851,000	
前田工織	16,900	2,926.00	49,449,400	
永大産業	20,000	303.00	6,060,000	

アートネイチャー	14,700	675.00	9,922,500	
バンダイナムコホールディングス	126,600	8,876.00	1,123,701,600	
アイフィスジャパン	3,900	714.00	2,784,600	
共立印刷	25,600	127.00	3,251,200	
SHOEI	13,400	4,225.00	56,615,000	
フランスベッドホールディングス	19,700	969.00	19,089,300	
パイロットコーポレーション	27,100	3,160.00	85,636,000	貸付有価証券 200株
萩原工業	8,500	1,488.00	12,648,000	
トッパン・フォームズ	27,300	1,060.00	28,938,000	
フジシールインターナショナル	31,500	2,176.00	68,544,000	
タカラトミー	68,700	994.00	68,287,800	貸付有価証券 200株
廣済堂	10,700	896.00	9,587,200	
エステールホールディングス	4,100	646.00	2,648,600	
タカノ	5,200	604.00	3,140,800	貸付有価証券 3,400株
プロネクサス	13,100	1,204.00	15,772,400	
ホクシン	9,400	115.00	1,081,000	
ウッドワン	5,100	1,081.00	5,513,100	
大建工業	10,300	1,984.00	20,435,200	
凸版印刷	232,700	1,634.00	380,231,800	
大日本印刷	185,000	1,898.00	351,130,000	
共同印刷	4,700	3,145.00	14,781,500	
NISSHA	31,400	1,459.00	45,812,600	貸付有価証券 100株
光村印刷	1,300	1,770.00	2,301,000	
TAKARA & COMPANY	7,500	1,751.00	13,132,500	貸付有価証券 900株
アシックス	135,400	1,783.00	241,418,200	貸付有価証券 200株
ツツミ	3,800	2,038.00	7,744,400	
ローランド	8,900	3,500.00	31,150,000	貸付有価証券 100株
小松ウオール工業	4,700	1,849.00	8,690,300	

ヤマハ	91,100	5,780.00	526,558,000	
河合楽器製作所	4,300	3,605.00	15,501,500	
クリナップ	14,200	520.00	7,384,000	
ピジョン	98,300	4,210.00	413,843,000	貸付有価証券 46,200株
オリバー	3,200	2,551.00	8,163,200	貸付有価証券 400株
兼松サステック	1,000	1,766.00	1,766,000	
キングジム	12,700	886.00	11,252,200	
リンテック	32,800	2,390.00	78,392,000	
イトーキ	30,400	367.00	11,156,800	
任天堂	87,600	68,600.00	6,009,360,000	
三菱鉛筆	25,200	1,412.00	35,582,400	
タカスタンダード	31,600	1,575.00	49,770,000	
コクヨ	73,400	1,443.00	105,916,200	
ナカバヤシ	15,100	620.00	9,362,000	
グローブライド	7,400	4,040.00	29,896,000	
オカムラ	58,800	1,059.00	62,269,200	
美津濃	15,200	2,239.00	34,032,800	
東京電力ホールディングス	1,298,700	368.00	477,921,600	貸付有価証券 900株
中部電力	468,500	1,345.00	630,132,500	
関西電力	580,100	1,094.50	634,919,450	
中国電力	220,900	1,322.00	292,029,800	貸付有価証券 400株
北陸電力	140,000	689.00	96,460,000	
東北電力	358,600	956.00	342,821,600	
四国電力	127,300	775.00	98,657,500	
九州電力	338,100	947.00	320,180,700	
北海道電力	143,300	472.00	67,637,600	
沖縄電力	29,800	1,446.00	43,090,800	
電源開発	121,800	1,774.00	216,073,200	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
エフオン	9,300	1,029.00	9,569,700	貸付有価証券 2,600株（200株）
イーレックス	22,500	1,715.00	38,587,500	貸付有価証券 10,500株（8,100株）
レノバ	25,800	3,360.00	86,688,000	貸付有価証券

				5,100株（1,700株）
東京瓦斯	294,500	2,300.50	677,497,250	
大阪瓦斯	277,300	1,986.00	550,717,800	
東邦瓦斯	75,300	6,700.00	504,510,000	貸付有価証券 1,200株
北海道瓦斯	8,200	1,593.00	13,062,600	貸付有価証券 100株
広島ガス	31,600	380.00	12,008,000	
西部瓦斯	17,200	2,893.00	49,759,600	
静岡ガス	43,500	958.00	41,673,000	
メタウォーター	17,300	2,154.00	37,264,200	
S B Sホールディングス	11,300	2,598.00	29,357,400	貸付有価証券 600株
東武鉄道	159,600	3,160.00	504,336,000	
相鉄ホールディングス	52,500	2,553.00	134,032,500	
東急	386,200	1,462.00	564,624,400	
京浜急行電鉄	196,600	1,841.00	361,940,600	貸付有価証券 6,000株
小田急電鉄	245,300	3,415.00	837,699,500	貸付有価証券 800株
京王電鉄	85,600	8,710.00	745,576,000	
京成電鉄	114,700	3,900.00	447,330,000	
富士急行	20,900	5,990.00	125,191,000	貸付有価証券 1,900株
新京成電鉄	3,900	2,260.00	8,814,000	
東日本旅客鉄道	269,500	7,635.00	2,057,632,500	
西日本旅客鉄道	136,400	6,359.00	867,367,600	貸付有価証券 4,800株
東海旅客鉄道	127,300	17,740.00	2,258,302,000	
西武ホールディングス	184,500	1,297.00	239,296,500	貸付有価証券 100株
鴻池運輸	24,400	1,096.00	26,742,400	
西日本鉄道	42,400	3,115.00	132,076,000	
ハマキョウレックス	11,700	3,220.00	37,674,000	
サカイ引越センター	7,000	4,920.00	34,440,000	
近鉄グループホールディングス	145,000	4,730.00	685,850,000	貸付有価証券 100株
阪急阪神ホールディングス	193,400	3,715.00	718,481,000	

南海電気鉄道	68,700	2,697.00	185,283,900	
京阪ホールディングス	64,600	5,120.00	330,752,000	貸付有価証券 300株
神戸電鉄	3,400	3,670.00	12,478,000	貸付有価証券 1,500株
名古屋鉄道	119,200	2,859.00	340,792,800	貸付有価証券 1,200株
山陽電気鉄道	10,400	2,014.00	20,945,600	
アルプス物流	11,600	1,007.00	11,681,200	
日本通運	50,200	7,850.00	394,070,000	
ヤマトホールディングス	203,200	2,846.00	578,307,200	
山九	37,200	4,455.00	165,726,000	
丸運	8,300	255.00	2,116,500	
丸全昭和運輸	11,800	3,235.00	38,173,000	
センコーグループホール ディングス	80,000	1,025.00	82,000,000	
トナミホールディングス	3,500	5,510.00	19,285,000	
ニッコンホールディング ス	48,700	2,196.00	106,945,200	
日本石油輸送	1,600	2,664.00	4,262,400	
福山通運	18,600	4,470.00	83,142,000	
セイノーホールディング ス	108,600	1,559.00	169,307,400	
エスライン	4,000	897.00	3,588,000	
神奈川中央交通	3,600	3,830.00	13,788,000	
日立物流	31,900	3,315.00	105,748,500	貸付有価証券 200株
丸和運輸機関	30,600	2,164.00	66,218,400	貸付有価証券 9,900株
C & F ロジホールディン グス	14,700	1,789.00	26,298,300	
九州旅客鉄道	112,200	2,638.00	295,983,600	
S Gホールディングス	274,000	2,644.00	724,456,000	
日本郵船	121,300	2,839.00	344,370,700	
商船三井	86,000	3,135.00	269,610,000	
川崎汽船	44,700	1,958.00	87,522,600	
N S ユナイテッド海運	6,800	1,559.00	10,601,200	
明治海運	15,400	390.00	6,006,000	
飯野海運	67,300	437.00	29,410,100	

共栄タンカー	2,500	983.00	2,457,500	貸付有価証券 1,100株
乾汽船	7,400	927.00	6,859,800	
日本航空	353,300	2,373.00	838,380,900	貸付有価証券 12,600株（12,600株）
A N Aホールディングス	391,400	2,519.00	985,936,600	貸付有価証券 5,200株
パスコ	2,800	1,389.00	3,889,200	
トランコム	4,400	8,240.00	36,256,000	
日新	11,600	1,394.00	16,170,400	
三菱倉庫	50,200	3,375.00	169,425,000	
三井倉庫ホールディングス	15,400	2,230.00	34,342,000	
住友倉庫	52,200	1,466.00	76,525,200	
澁澤倉庫	8,000	2,262.00	18,096,000	
東陽倉庫	24,300	330.00	8,019,000	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	31,900	566.00	18,055,400	貸付有価証券 100株
ケイヒン	2,800	1,353.00	3,788,400	
中央倉庫	8,800	1,191.00	10,480,800	
川西倉庫	2,700	1,200.00	3,240,000	
安田倉庫	11,900	961.00	11,435,900	貸付有価証券 100株
ファイズホールディングス	2,600	1,016.00	2,641,600	
東洋埠頭	4,400	1,442.00	6,344,800	
宇徳	10,300	466.00	4,799,800	貸付有価証券 100株
上組	80,900	2,050.00	165,845,000	
サンリツ	3,700	701.00	2,593,700	
キムラユニティー	3,900	1,120.00	4,368,000	
キューソー流通システム	3,600	1,583.00	5,698,800	
近鉄エクスプレス	27,400	2,720.00	74,528,000	
東海運	8,200	319.00	2,615,800	貸付有価証券 3,800株
エーアイテイー	9,100	1,069.00	9,727,900	
内外トランスライン	5,100	1,305.00	6,655,500	
日本コンセプト	4,600	1,670.00	7,682,000	

NECネットエスアイ	49,700	1,905.00	94,678,500	貸付有価証券 200株（200株）
クロスキャット	3,900	1,137.00	4,434,300	
システナ	53,600	1,945.00	104,252,000	
デジタルアーツ	8,700	10,360.00	90,132,000	
日鉄ソリューションズ	22,500	3,280.00	73,800,000	
キューブシステム	8,000	1,131.00	9,048,000	貸付有価証券 2,000株（1,000株）
エイジア	2,300	1,809.00	4,160,700	
コア	6,300	1,535.00	9,670,500	
ラクーンホールディングス	10,600	2,242.00	23,765,200	貸付有価証券 4,500株（800株）
ソリトンシステムズ	7,500	1,837.00	13,777,500	
ソフトクリエイトホールディングス	5,900	2,612.00	15,410,800	
T I S	150,200	2,295.00	344,709,000	
J N Sホールディングス	7,200	573.00	4,125,600	
電算システム	5,600	3,260.00	18,256,000	
グリー	92,100	597.00	54,983,700	貸付有価証券 9,900株
GMOベパボ	1,000	6,300.00	6,300,000	貸付有価証券 500株
コーエーテクモホールディングス	30,700	6,530.00	200,471,000	
三菱総合研究所	6,400	4,155.00	26,592,000	
ボルテージ	4,000	541.00	2,164,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
電算	1,700	2,540.00	4,318,000	
A G S	7,600	841.00	6,391,600	
ファインデックス	12,600	1,205.00	15,183,000	
ブレインパッド	3,900	4,640.00	18,096,000	貸付有価証券 1,800株
K L a b	27,400	849.00	23,262,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	20,000	1,180.00	23,600,000	
イーブックイニシアティブジャパン	2,400	2,350.00	5,640,000	貸付有価証券 1,000株
ネクソン	379,500	3,530.00	1,339,635,000	貸付有価証券 3,400株
アイスタイル	45,800	548.00	25,098,400	

エムアップホールディングス	3,900	2,528.00	9,859,200	
エイチーム	10,300	1,249.00	12,864,700	貸付有価証券 100株
エニグモ	14,200	1,238.00	17,579,600	
テクノスジャパン	11,600	705.00	8,178,000	
e n i s h	7,800	509.00	3,970,200	貸付有価証券 1,900株
コロプラ	49,300	936.00	46,144,800	貸付有価証券 15,700株
オルトプラス	9,100	451.00	4,104,100	貸付有価証券 3,800株（100株）
ブロードリーフ	74,500	511.00	38,069,500	貸付有価証券 45,600株
クロス・マーケティング グループ	6,600	398.00	2,626,800	
デジタルハーツホール ディングス	6,800	1,462.00	9,941,600	貸付有価証券 800株（800株）
システム情報	11,300	1,073.00	12,124,900	貸付有価証券 1,800株
メディアドゥ	5,700	6,160.00	35,112,000	貸付有価証券 2,700株（2,600株）
じげん	37,200	403.00	14,991,600	
ブイキューブ	8,200	2,737.00	22,443,400	貸付有価証券 500株
エンカレッジ・テクノロ ジ	2,600	610.00	1,586,000	
サイバーリンクス	4,900	2,018.00	9,888,200	貸付有価証券 2,500株（600株）
ディー・エル・イー	12,100	319.00	3,859,900	貸付有価証券 6,900株（4,900株）
フィックスターズ	16,000	999.00	15,984,000	
CARTA HOLD I NGS	6,100	1,570.00	9,577,000	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
オブティム	10,500	3,220.00	33,810,000	貸付有価証券 500株
セレス	4,900	4,000.00	19,600,000	貸付有価証券 1,700株（1,400株）
SHIFT	6,700	14,040.00	94,068,000	貸付有価証券 2,100株
ティーガイア	16,000	1,887.00	30,192,000	

セック	2,200	2,859.00	6,289,800	
日本アジアグループ	14,500	1,224.00	17,748,000	貸付有価証券 900株（700株）
テクマトリックス	23,300	1,772.00	41,287,600	貸付有価証券 200株
プロシップ	4,400	1,365.00	6,006,000	貸付有価証券 700株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	36,200	2,376.00	86,011,200	
GMOペイメントゲート ウェイ	31,800	15,840.00	503,712,000	
ザッパラス	5,800	439.00	2,546,200	
システムリサーチ	4,400	1,884.00	8,289,600	
インターネットイニシア ティブ	40,000	2,346.00	93,840,000	
さくらインターネット	16,100	674.00	10,851,400	貸付有価証券 600株（600株）
ヴィンクス	4,200	1,157.00	4,859,400	
GMOグローバルサイ ン・ホールディングス	3,300	8,840.00	29,172,000	貸付有価証券 1,500株（1,100株）
S R Aホールディングス	8,000	2,585.00	20,680,000	
システムインテグレータ	4,200	628.00	2,637,600	貸付有価証券 300株
朝日ネット	12,200	832.00	10,150,400	
e B A S E	17,900	902.00	16,145,800	貸付有価証券 100株
アバント	16,100	1,393.00	22,427,300	
アドソル日進	5,300	2,800.00	14,840,000	
ODKソリューションズ	2,300	729.00	1,676,700	
フリービット	8,900	997.00	8,873,300	
コムチュア	13,800	2,949.00	40,696,200	貸付有価証券 300株（300株）
サイバーコム	2,700	1,605.00	4,333,500	
アステリア	10,800	929.00	10,033,200	貸付有価証券 200株
アイル	8,300	1,627.00	13,504,100	貸付有価証券 800株
マークラインズ	6,300	2,450.00	15,435,000	
メディカル・データ・ビ ジョン	17,100	2,172.00	37,141,200	貸付有価証券 4,600株

g u m i	20,800	967.00	20,113,600	貸付有価証券 800株
ショーケース	3,200	993.00	3,177,600	貸付有価証券 1,600株
モバイルファクトリー	3,400	1,019.00	3,464,600	貸付有価証券 1,100株
テラスカイ	4,800	3,700.00	17,760,000	貸付有価証券 3,200株（1,000株）
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	6,600	1,615.00	10,659,000	貸付有価証券 100株
P C I ホールディングス	5,700	1,307.00	7,449,900	
パイプドHD	3,100	1,545.00	4,789,500	
アイビーシー	2,400	1,031.00	2,474,400	
ネオジャパン	2,800	1,794.00	5,023,200	貸付有価証券 300株（300株）
P R T I M E S	3,200	3,645.00	11,664,000	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
ランドコンピュータ	2,300	1,125.00	2,587,500	
ダブルスタンダード	1,900	4,115.00	7,818,500	貸付有価証券 1,000株（100株）
オープンドア	8,900	2,429.00	21,618,100	貸付有価証券 4,100株（1,100株）
マイネット	4,900	786.00	3,851,400	貸付有価証券 2,300株（1,900株）
アカツキ	6,000	4,235.00	25,410,000	
ベネフィットジャパン	1,100	1,764.00	1,940,400	
U b i c o m ホールディ ングス	3,900	3,155.00	12,304,500	
カナミックネットワーク	13,700	793.00	10,864,100	
ノムラシステムコーポ レーション	6,600	323.00	2,131,800	貸付有価証券 900株
チェンジ	21,000	3,595.00	75,495,000	貸付有価証券 9,300株（2,400株）
シンクロ・フード	8,900	362.00	3,221,800	
オークネット	7,900	1,355.00	10,704,500	
キャピタル・アセット・ プランニング	1,800	989.00	1,780,200	
セグエグループ	3,800	1,284.00	4,879,200	貸付有価証券 600株
エイトレッド	2,800	2,414.00	6,759,200	
A O I T Y O H o l	15,200	490.00	7,448,000	

d i n g s				
マクロミル	30,700	898.00	27,568,600	
ビーグリー	2,900	1,478.00	4,286,200	貸付有価証券 1,100株（300株）
オロ	4,700	3,960.00	18,612,000	
ユーザーローカル	2,200	4,485.00	9,867,000	
テモナ	3,200	966.00	3,091,200	貸付有価証券 300株（300株）
ニーズウェル	2,900	663.00	1,922,700	
サインポスト	3,400	970.00	3,298,000	貸付有価証券 500株（500株）
ソルクシーズ	5,700	978.00	5,574,600	貸付有価証券 700株
フェイス	4,600	804.00	3,698,400	
プロトコーポレーション	13,500	1,179.00	15,916,500	貸付有価証券 200株
ハイマックス	3,500	1,778.00	6,223,000	
野村総合研究所	274,200	3,655.00	1,002,201,000	
サイバネットシステム	10,700	864.00	9,244,800	
C Eホールディングス	7,900	549.00	4,337,100	
日本システム技術	2,700	1,539.00	4,155,300	
インテージホールディングス	18,700	1,212.00	22,664,400	
東邦システムサイエンス	4,000	931.00	3,724,000	
ソースネクスト	71,300	321.00	22,887,300	貸付有価証券 16,500株（15,600株）
インフォコム	13,700	2,866.00	39,264,200	
HEROZ	4,300	3,375.00	14,512,500	貸付有価証券 700株
ラクスル	12,100	3,860.00	46,706,000	貸付有価証券 500株
I P S	2,600	2,895.00	7,527,000	
F I G	16,300	268.00	4,368,400	
システムサポート	4,400	1,463.00	6,437,200	
イーソル	8,200	1,423.00	11,668,600	貸付有価証券 2,600株
アルテリア・ネットワークス	16,600	1,569.00	26,045,400	
E d u L a b	1,400	7,470.00	10,458,000	
東海ソフト	1,800	1,155.00	2,079,000	

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	2,600	2,047.00	5,322,200	
サーバーワークス	1,200	5,200.00	6,240,000	
東名	800	1,130.00	904,000	
ヴィッツ	600	2,273.00	1,363,800	貸付有価証券 200株
トビラシステムズ	1,500	1,538.00	2,307,000	貸付有価証券 700株（600株）
S a n s a n	5,200	8,940.00	46,488,000	貸付有価証券 500株
L i n k－U	1,000	1,400.00	1,400,000	貸付有価証券 400株（100株）
ギフティ	6,700	4,690.00	31,423,000	貸付有価証券 2,400株
ベース	1,300	5,110.00	6,643,000	貸付有価証券 600株
フォーカスシステムズ	10,100	938.00	9,473,800	
クレスコ	10,300	1,385.00	14,265,500	
フジ・メディア・ホールディングス	155,900	1,308.00	203,917,200	貸付有価証券 1,700株
オービック	47,300	19,630.00	928,499,000	
ジャストシステム	21,400	7,120.00	152,368,000	
T D Cソフト	13,100	955.00	12,510,500	
Zホールディングス	2,063,900	639.10	1,319,038,490	
トレンドマイクロ	80,200	5,850.00	469,170,000	
I Dホールディングス	5,700	1,225.00	6,982,500	
日本オラクル	30,500	12,370.00	377,285,000	貸付有価証券 200株
アルファシステムズ	4,000	3,765.00	15,060,000	
フューチャー	18,100	1,899.00	34,371,900	
C A C H o l d i n g s	9,800	1,453.00	14,239,400	
S Bテクノロジー	5,400	3,005.00	16,227,000	
トーセ	4,100	806.00	3,304,600	
オービックビジネスコン サルタント	15,300	6,520.00	99,756,000	貸付有価証券 8,200株
伊藤忠テクノソリュー ションズ	68,500	3,535.00	242,147,500	
アイティフォー	19,600	866.00	16,973,600	
東計電算	2,200	4,320.00	9,504,000	

エックスネット	2,400	987.00	2,368,800	
大塚商会	81,300	5,300.00	430,890,000	貸付有価証券 9,100株
サイボウズ	17,600	2,601.00	45,777,600	貸付有価証券 3,600株
電通国際情報サービス	18,600	3,695.00	68,727,000	
A C C E S S	14,100	802.00	11,308,200	
デジタルガレージ	24,800	4,335.00	107,508,000	
EMシステムズ	24,800	869.00	21,551,200	
ウェザーニューズ	4,500	5,140.00	23,130,000	貸付有価証券 3,000株
C I J	10,200	884.00	9,016,800	
ビジネスエンジニアリン グ	1,500	3,175.00	4,762,500	
日本エンタープライズ	15,300	240.00	3,672,000	貸付有価証券 3,200株
WOWOW	7,200	2,861.00	20,599,200	
スカラ	13,400	717.00	9,607,800	貸付有価証券 1,600株
インテリジェント ウェ イブ	8,800	699.00	6,151,200	
I M A G I C A G R O U P	12,800	530.00	6,784,000	
ネットワンシステムズ	61,300	3,365.00	206,274,500	
システムソフト	32,300	129.00	4,166,700	貸付有価証券 3,600株
アルゴグラフィックス	11,700	3,030.00	35,451,000	
マーベラス	23,700	942.00	22,325,400	
エイベックス	25,900	1,488.00	38,539,200	
日本ユニシス	52,100	3,345.00	174,274,500	
兼松エレクトロニクス	8,200	3,645.00	29,889,000	
都築電気	5,500	1,534.00	8,437,000	貸付有価証券 100株
T B Sホールディングス	99,700	2,012.00	200,596,400	貸付有価証券 200株
日本テレビホールディン グス	125,400	1,403.00	175,936,200	
朝日放送グループホール ディングス	14,900	722.00	10,757,800	
テレビ朝日ホールディン	46,400	2,203.00	102,219,200	貸付有価証券

グス				1,300株（100株）
スカパーJ S A Tホールディングス	98,900	460.00	45,494,000	
テレビ東京ホールディングス	10,900	2,481.00	27,042,900	
日本BS放送	5,100	1,157.00	5,900,700	貸付有価証券 2,600株
ビジョン	18,600	950.00	17,670,000	
スマートバリュー	3,900	938.00	3,658,200	貸付有価証券 1,600株
USEN-NEXT HOLDINGS	5,700	1,973.00	11,246,100	貸付有価証券 2,600株（400株）
ワイヤレスゲート	6,100	528.00	3,220,800	貸付有価証券 2,300株
コネクシオ	8,500	1,394.00	11,849,000	
日本通信	132,700	227.00	30,122,900	貸付有価証券 33,100株（31,800株）
クロップス	2,700	799.00	2,157,300	
日本電信電話	1,757,400	2,848.50	5,005,953,900	
KDDI	1,204,900	3,362.00	4,050,873,800	貸付有価証券 700株
ソフトバンク	1,365,500	1,442.50	1,969,733,750	
光通信	17,700	21,390.00	378,603,000	
エムティーアイ	14,500	844.00	12,238,000	
GMOインターネット	53,800	3,510.00	188,838,000	
ファイバーゲート	4,900	2,242.00	10,985,800	貸付有価証券 1,100株（800株）
アイドママーケティングコミュニケーション	3,900	459.00	1,790,100	
KADOKAWA	40,400	3,970.00	160,388,000	
学研ホールディングス	20,100	1,616.00	32,481,600	
ゼンリン	27,200	1,325.00	36,040,000	
昭文社ホールディングス	6,000	465.00	2,790,000	貸付有価証券 200株
インプレスホールディングス	12,400	192.00	2,380,800	
アイネット	7,700	1,506.00	11,596,200	
松竹	9,900	15,350.00	151,965,000	貸付有価証券 4,600株
東宝	88,700	4,225.00	374,757,500	

東映	4,900	21,420.00	104,958,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	400,000	1,648.00	659,200,000	
ピー・シー・エー	2,200	4,245.00	9,339,000	貸付有価証券 400株
ビジネスブレイン太田昭 和	5,100	1,736.00	8,853,600	
D T S	31,200	2,444.00	76,252,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	64,100	6,690.00	428,829,000	貸付有価証券 800株
シーイーシー	16,100	1,498.00	24,117,800	
カプコン	64,400	6,750.00	434,700,000	
アイ・エス・ビー	6,900	1,260.00	8,694,000	貸付有価証券 500株
ジャステック	9,600	1,251.00	12,009,600	貸付有価証券 600株
S C S K	34,700	6,690.00	232,143,000	
日本システムウエア	5,000	2,056.00	10,280,000	
アイネス	14,800	1,388.00	20,542,400	
T K C	12,700	6,700.00	85,090,000	
富士ソフト	16,000	5,600.00	89,600,000	貸付有価証券 8,400株（300株）
N S D	48,300	1,922.00	92,832,600	
コナミホールディングス	54,600	7,350.00	401,310,000	
福井コンピュータホール ディングス	6,900	3,725.00	25,702,500	貸付有価証券 100株
J B C Cホールディング ス	10,100	1,469.00	14,836,900	
ミロク情報サービス	14,900	2,277.00	33,927,300	貸付有価証券 400株
ソフトバンクグループ	1,192,200	10,340.00	12,327,348,000	
ハウスイ	1,200	968.00	1,161,600	
高千穂交易	5,800	1,211.00	7,023,800	貸付有価証券 3,000株
オルバヘルスケアホール ディングス	2,500	1,571.00	3,927,500	
伊藤忠食品	3,700	5,270.00	19,499,000	
エレマテック	12,100	1,003.00	12,136,300	
J A L U X	4,300	1,722.00	7,404,600	貸付有価証券 900株

あらた	12,000	4,670.00	56,040,000	
トーメンデバイス	1,900	3,985.00	7,571,500	
東京エレクトロン デバイス	5,000	3,785.00	18,925,000	
フィールズ	13,200	545.00	7,194,000	
双日	832,900	275.00	229,047,500	
アルフレッサ ホールディングス	156,400	2,186.00	341,890,400	
横浜冷凍	39,400	898.00	35,381,200	
神栄	2,100	1,507.00	3,164,700	貸付有価証券 1,000株（300株）
ラサ商事	8,000	905.00	7,240,000	
アルコニックス	16,000	1,660.00	26,560,000	
神戸物産	104,100	2,960.00	308,136,000	貸付有価証券 4,100株
ハイパー	2,300	511.00	1,175,300	
あい ホールディングス	21,500	2,061.00	44,311,500	
ディーブイエックス	4,800	1,044.00	5,011,200	貸付有価証券 2,100株
ダイワボウホールディングス	13,700	8,320.00	113,984,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	36,000	2,074.00	74,664,000	貸付有価証券 20,500株
ラクト・ジャパン	6,600	2,657.00	17,536,200	貸付有価証券 100株
グリムス	3,400	1,649.00	5,606,600	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,200	802.00	21,012,400	
八洲電機	11,600	950.00	11,020,000	
メディアスホールディングス	8,500	845.00	7,182,500	
レスターホールディングス	15,700	2,055.00	32,263,500	
ジューテックホールディングス	3,400	1,060.00	3,604,000	貸付有価証券 1,500株
大光	5,800	668.00	3,874,400	
OCHIホールディングス	4,400	1,352.00	5,948,800	貸付有価証券 2,300株
TOKAIホールディン	73,000	958.00	69,934,000	

グス				
黒谷	4,100	726.00	2,976,600	
C o m i n i x	2,600	774.00	2,012,400	貸付有価証券 1,300株
三洋貿易	15,200	1,086.00	16,507,200	
ビューティガレージ	2,400	2,492.00	5,980,800	貸付有価証券 900株（100株）
ウイン・パートナーズ	10,900	1,129.00	12,306,100	貸付有価証券 6,200株
ミタチ産業	4,100	594.00	2,435,400	
シップヘルスケアホールディングス	26,600	5,920.00	157,472,000	貸付有価証券 3,800株
明治電機工業	5,200	1,416.00	7,363,200	
デリカフーズホールディングス	5,800	631.00	3,659,800	
スターティアホールディングス	2,900	1,030.00	2,987,000	
コメダホールディングス	32,900	1,944.00	63,957,600	貸付有価証券 17,000株
ピーバンドットコム	1,900	874.00	1,660,600	貸付有価証券 400株（400株）
アセンテック	3,900	1,797.00	7,008,300	
富士興産	4,600	1,288.00	5,924,800	
協栄産業	1,700	1,382.00	2,349,400	
小野建	13,500	1,323.00	17,860,500	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
南陽	3,100	1,665.00	5,161,500	
佐鳥電機	9,400	802.00	7,538,800	
エコートレーディング	3,200	683.00	2,185,600	貸付有価証券 1,600株
伯東	9,200	1,313.00	12,079,600	
コンドーテック	11,700	1,057.00	12,366,900	
中山福	8,600	520.00	4,472,000	
ナガイレーベン	20,000	2,841.00	56,820,000	
三菱食品	16,600	3,005.00	49,883,000	
松田産業	11,000	1,883.00	20,713,000	
第一興商	22,400	4,120.00	92,288,000	
メディバルホールディングス	151,100	2,225.00	336,197,500	貸付有価証券 1,100株
S P K	6,500	1,272.00	8,268,000	

萩原電気ホールディングス	5,600	2,559.00	14,330,400	
アズワン	10,800	14,830.00	160,164,000	
スズデン	5,200	1,251.00	6,505,200	
尾家産業	4,400	1,393.00	6,129,200	
シモジマ	9,200	1,382.00	12,714,400	
ドウシシャ	14,200	1,835.00	26,057,000	貸付有価証券 100株
小津産業	3,300	1,916.00	6,322,800	
高速	8,000	1,537.00	12,296,000	
たけびし	5,300	1,549.00	8,209,700	貸付有価証券 900株
リックス	3,400	1,563.00	5,314,200	
丸文	13,300	523.00	6,955,900	
ハピネット	12,600	1,537.00	19,366,200	
橋本総業ホールディングス	3,000	2,555.00	7,665,000	
日本ライフライン	48,700	1,361.00	66,280,700	
タカショー	9,800	788.00	7,722,400	貸付有価証券 400株（400株）
マルカ	4,900	2,000.00	9,800,000	
I DOM	50,800	645.00	32,766,000	
進和	8,900	2,156.00	19,188,400	
エスケイジャパン	3,600	463.00	1,666,800	貸付有価証券 1,900株
ダイトロン	6,400	1,551.00	9,926,400	
シークス	19,200	1,763.00	33,849,600	貸付有価証券 3,600株
田中商事	4,600	700.00	3,220,000	
オーハシテクニカ	7,700	1,474.00	11,349,800	
白銅	5,400	1,411.00	7,619,400	
ダイコー通産	1,300	1,512.00	1,965,600	
伊藤忠商事	1,054,800	3,182.00	3,356,373,600	貸付有価証券 100株
丸紅	1,487,200	777.40	1,156,149,280	
高島	2,400	1,727.00	4,144,800	
長瀬産業	84,800	1,758.00	149,078,400	
蝶理	9,600	1,574.00	15,110,400	

豊田通商	151,500	4,595.00	696,142,500	
三共生興	22,800	495.00	11,286,000	
兼松	60,300	1,387.00	83,636,100	貸付有価証券 600株
ツカモトコーポレーショ ン	2,500	1,542.00	3,855,000	
三井物産	1,224,500	2,158.50	2,643,083,250	
日本紙パルプ商事	7,900	3,645.00	28,795,500	
カメイ	19,700	1,239.00	24,408,300	
東都水産	1,700	3,870.00	6,579,000	貸付有価証券 400株
ＯＵＧホールディングス	2,400	2,813.00	6,751,200	
スターゼン	5,600	4,265.00	23,884,000	
山善	58,900	1,014.00	59,724,600	
椿本興業	2,800	3,755.00	10,514,000	
住友商事	951,700	1,529.00	1,455,149,300	
内田洋行	5,900	4,505.00	26,579,500	貸付有価証券 1,400株
三菱商事	918,200	2,977.00	2,733,481,400	
第一実業	6,900	4,115.00	28,393,500	
キヤノンマーケティング ジャパン	37,400	2,443.00	91,368,200	
西華産業	7,900	1,406.00	11,107,400	
佐藤商事	12,400	1,004.00	12,449,600	
菱洋エレクトロ	11,500	2,831.00	32,556,500	
東京産業	13,600	652.00	8,867,200	
ユアサ商事	15,400	3,125.00	48,125,000	
神鋼商事	3,400	1,935.00	6,579,000	
トルク	9,000	258.00	2,322,000	
阪和興業	30,200	2,790.00	84,258,000	
正栄食品工業	9,800	3,855.00	37,779,000	貸付有価証券 1,200株
カナデン	12,200	1,266.00	15,445,200	
菱電商事	10,900	1,608.00	17,527,200	
フルサト工業	7,600	1,318.00	10,016,800	
岩谷産業	36,200	6,310.00	228,422,000	
ナイス	6,000	1,688.00	10,128,000	
昭光通商	4,800	731.00	3,508,800	

ニチモウ	2,300	1,931.00	4,441,300	
極東貿易	4,300	1,409.00	6,058,700	
イワキ	19,800	620.00	12,276,000	
三愛石油	37,100	1,079.00	40,030,900	
稲畑産業	36,200	1,515.00	54,843,000	
G S I クレオス	3,700	2,620.00	9,694,000	
明和産業	13,900	470.00	6,533,000	
クワザワホールディングス	5,400	671.00	3,623,400	貸付有価証券 2,500株
ヤマエ久野	11,000	1,063.00	11,693,000	
ワキタ	29,700	1,021.00	30,323,700	
東邦ホールディングス	48,400	1,992.00	96,412,800	貸付有価証券 500株
サンゲツ	40,700	1,611.00	65,567,700	
ミツウロコグループホールディングス	22,200	1,245.00	27,639,000	
シナネンホールディングス	5,600	3,270.00	18,312,000	
伊藤忠エネクス	33,300	1,045.00	34,798,500	
サンリオ	42,300	1,745.00	73,813,500	貸付有価証券 300株
サンワテクノス	9,900	1,045.00	10,345,500	
リョーサン	16,600	2,262.00	37,549,200	
新光商事	20,300	779.00	15,813,700	
トーヨー	6,800	1,839.00	12,505,200	
三信電気	8,100	2,068.00	16,750,800	
東陽テクニカ	16,100	1,126.00	18,128,600	
モスフードサービス	21,300	3,125.00	66,562,500	
加賀電子	13,600	2,403.00	32,680,800	
ソーダニッカ	14,400	539.00	7,761,600	
立花エレクトック	11,100	1,579.00	17,526,900	
フォーバル	5,300	843.00	4,467,900	
P A L T A C	24,200	5,660.00	136,972,000	
三谷産業	19,800	428.00	8,474,400	
太平洋興発	5,900	662.00	3,905,800	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	3,400	2,900.00	9,860,000	
ヤマシタヘルスケアホー	1,300	1,553.00	2,018,900	

ルディングス				
コア商事ホールディングス	4,200	1,324.00	5,560,800	
国際紙パルプ商事	32,100	244.00	7,832,400	貸付有価証券 200株
ヤマタネ	6,500	1,421.00	9,236,500	
丸紅建材リース	1,500	1,873.00	2,809,500	
日鉄物産	10,800	3,880.00	41,904,000	
泉州電業	4,200	3,520.00	14,784,000	
トラスコ中山	34,500	2,668.00	92,046,000	貸付有価証券 500株
オートバックスセブン	55,900	1,406.00	78,595,400	
モリト	11,000	611.00	6,721,000	
加藤産業	21,800	3,820.00	83,276,000	
北恵	3,800	930.00	3,534,000	
イノテック	8,500	1,221.00	10,378,500	貸付有価証券 3,900株
イエローハット	28,500	1,727.00	49,219,500	
J Kホールディングス	13,600	812.00	11,043,200	貸付有価証券 7,800株
日伝	12,500	2,230.00	27,875,000	
北沢産業	10,200	266.00	2,713,200	
杉本商事	7,600	2,411.00	18,323,600	
因幡電機産業	40,200	2,550.00	102,510,000	
東テク	5,000	2,817.00	14,085,000	
ミスミグループ本社	189,100	3,525.00	666,577,500	
アルテック	11,000	285.00	3,135,000	
タキヒヨー	5,000	1,992.00	9,960,000	貸付有価証券 2,400株
蔵王産業	2,900	1,387.00	4,022,300	
スズケン	63,900	4,330.00	276,687,000	
ジェコス	10,400	965.00	10,036,000	
グローセル	16,300	499.00	8,133,700	
ローソン	38,100	5,220.00	198,882,000	
サンエー	11,400	4,330.00	49,362,000	貸付有価証券 5,900株
カワチ薬品	10,500	2,980.00	31,290,000	
エービーシー・マート	23,500	6,310.00	148,285,000	貸付有価証券

				12,200株
ハードオフコーポレーション	6,600	812.00	5,359,200	
アスクル	13,100	3,675.00	48,142,500	
ゲオホールディングス	20,200	1,195.00	24,139,000	
アダストリア	20,900	2,077.00	43,409,300	貸付有価証券 10,800株
ジーフット	9,100	421.00	3,831,100	貸付有価証券 4,200株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,200	426.00	937,200	貸付有価証券 1,100株
くら寿司	8,900	7,490.00	66,661,000	貸付有価証券 300株
キャンドゥ	7,200	1,892.00	13,622,400	
アイケイ	3,300	868.00	2,864,400	
パルグループホールディ ングス	13,200	1,619.00	21,370,800	貸付有価証券 6,900株
エディオン	63,900	1,069.00	68,309,100	貸付有価証券 19,600株（10,400株）
サーラコーポレーション	30,600	587.00	17,962,200	貸付有価証券 1,900株
ワッツ	6,600	870.00	5,742,000	貸付有価証券 200株
ハローズ	5,700	3,025.00	17,242,500	貸付有価証券 2,600株（800株）
フジオフードグループ本 社	12,700	1,326.00	16,840,200	貸付有価証券 400株
あみやき亭	3,300	2,941.00	9,705,300	貸付有価証券 1,600株
ひらまつ	27,700	178.00	4,930,600	貸付有価証券 3,700株（1,200株）
大黒天物産	3,600	6,110.00	21,996,000	
ハニーズホールディン グス	11,900	1,011.00	12,030,900	
ファーマライズホール ディングス	3,700	778.00	2,878,600	
アルペン	11,500	2,319.00	26,668,500	貸付有価証券 300株
ハブ	4,800	715.00	3,432,000	貸付有価証券 2,200株（100株）
クオールホールディン グ	20,300	1,451.00	29,455,300	

ス				
ジンズホールディングス	8,000	7,390.00	59,120,000	貸付有価証券 200株
ビックカメラ	89,400	1,186.00	106,028,400	貸付有価証券 42,000株
DCMホールディングス	93,000	1,117.00	103,881,000	貸付有価証券 47,800株
MonotaRO	107,200	6,680.00	716,096,000	貸付有価証券 200株
東京一番フーズ	3,800	595.00	2,261,000	
DDホールディングス	6,800	691.00	4,698,800	貸付有価証券 3,500株（100株）
きちりホールディングス	4,000	609.00	2,436,000	貸付有価証券 2,300株
アークランドサービス ホールディングス	12,600	2,154.00	27,140,400	
J. フロント リテイ リング	180,100	1,016.00	182,981,600	
ドトール・日レスホール ディングス	23,900	1,687.00	40,319,300	貸付有価証券 12,000株
マツモトキヨシホール ディングス	62,300	4,395.00	273,808,500	
ブロンコビリー	7,900	2,295.00	18,130,500	貸付有価証券 100株
Z O Z O	88,900	3,630.00	322,707,000	貸付有価証券 1,900株
トレジャー・ファクト リー	4,400	817.00	3,594,800	貸付有価証券 2,300株
物語コーポレーション	4,000	11,880.00	47,520,000	貸付有価証券 300株
ココカラファイン	13,400	7,410.00	99,294,000	
三越伊勢丹ホールディ ングス	263,800	743.00	196,003,400	貸付有価証券 400株
Hamee	3,900	1,701.00	6,633,900	貸付有価証券 100株
ウエルシアホールディ ングス	79,700	3,520.00	280,544,000	貸付有価証券 2,700株
クリエイティブSDホー ルディングス	22,200	3,420.00	75,924,000	
丸善CH I ホールディ ングス	17,600	375.00	6,600,000	
ミサワ	3,000	685.00	2,055,000	

ティーライフ	2,200	1,195.00	2,629,000	
エー・ピーホールディングス	2,800	450.00	1,260,000	
チムニー	4,600	1,416.00	6,513,600	貸付有価証券 700株
シュッピン	10,300	1,053.00	10,845,900	貸付有価証券 900株
オイシックス・ラ・大地	14,900	2,977.00	44,357,300	貸付有価証券 1,300株（200株）
ネクステージ	25,800	1,739.00	44,866,200	
ジョイフル本田	44,200	1,450.00	64,090,000	
鳥貴族ホールディングス	4,400	1,721.00	7,572,400	貸付有価証券 400株
ホットランド	11,300	1,207.00	13,639,100	貸付有価証券 3,900株（300株）
すかいらくホールディングス	169,000	1,633.00	275,977,000	貸付有価証券 63,300株
S F Pホールディングス	7,400	1,463.00	10,826,200	貸付有価証券 3,400株
綿半ホールディングス	11,300	1,262.00	14,260,600	
ヨシックス	2,900	2,145.00	6,220,500	貸付有価証券 1,300株
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	43,800	1,150.00	50,370,000	貸付有価証券 22,900株
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	7,800	1,234.00	9,625,200	貸付有価証券 2,800株
BEENOS	7,000	2,690.00	18,830,000	
あさひ	11,200	1,555.00	17,416,000	貸付有価証券 5,900株（500株）
日本調剤	9,100	1,634.00	14,869,400	貸付有価証券 100株
コスモス薬品	15,200	15,820.00	240,464,000	
トーエル	7,300	827.00	6,037,100	
オンリー	2,600	472.00	1,227,200	貸付有価証券 100株
セブン&アイ・ホール ディングス	590,000	4,240.00	2,501,600,000	
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	81,100	850.00	68,935,000	貸付有価証券 43,100株（1,800株）
ツルハホールディングス	32,900	14,290.00	470,141,000	
サンマルクホールディン	11,900	1,603.00	19,075,700	

ダス				
フェリシモ	3,300	1,339.00	4,418,700	
トリドールホールディングス	37,300	1,490.00	55,577,000	貸付有価証券 900株
TOKYO BASE	13,600	724.00	9,846,400	貸付有価証券 5,100株（3,200株）
ウイルプラスホールディングス	2,300	1,067.00	2,454,100	
JMホールディングス	11,400	2,028.00	23,119,200	
サツドラホールディングス	2,300	2,045.00	4,703,500	
アレンザホールディングス	8,600	1,426.00	12,263,600	貸付有価証券 4,400株
串カツ田中ホールディングス	4,000	1,873.00	7,492,000	
パロックジャパンリミテッド	10,500	818.00	8,589,000	貸付有価証券 4,900株
クスリのアオキホールディングス	15,000	8,740.00	131,100,000	貸付有価証券 2,700株（1,400株）
力の源ホールディングス	6,900	613.00	4,229,700	貸付有価証券 2,000株
スシローグローバルホールディングス	82,800	4,230.00	350,244,000	
メディカルシステムネットワーク	13,100	687.00	8,999,700	
はるやまホールディングス	7,100	713.00	5,062,300	貸付有価証券 600株
ノジマ	26,800	2,916.00	78,148,800	
カッパ・クリエイト	21,100	1,504.00	31,734,400	貸付有価証券 100株（100株）
ライトオン	11,300	641.00	7,243,300	貸付有価証券 4,200株（3,100株）
ジーンズメイト	4,600	290.00	1,334,000	貸付有価証券 2,100株
良品計画	200,200	2,590.00	518,518,000	貸付有価証券 2,600株
三城ホールディングス	18,700	326.00	6,096,200	
アドヴァン	15,300	1,100.00	16,830,000	貸付有価証券 400株
アルビス	4,800	2,482.00	11,913,600	
コナカ	17,800	339.00	6,034,200	

ハウス オブ ローゼ	1,800	1,705.00	3,069,000	
G-7ホールディングス	8,900	2,349.00	20,906,100	貸付有価証券 100株
イオン北海道	19,900	1,064.00	21,173,600	貸付有価証券 10,400株
コジマ	25,900	653.00	16,912,700	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,300	976.00	5,172,800	貸付有価証券 2,400株
コーナン商事	21,400	2,995.00	64,093,000	貸付有価証券 2,300株
エコス	5,500	1,992.00	10,956,000	貸付有価証券 2,900株
ワタミ	19,800	1,015.00	20,097,000	貸付有価証券 10,000株（2,900株）
マルシェ	4,000	512.00	2,048,000	
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	301,400	2,587.00	779,721,800	
西松屋チェーン	33,100	1,515.00	50,146,500	貸付有価証券 14,900株（2,100株）
ゼンショーホールディン グス	81,000	2,870.00	232,470,000	貸付有価証券 2,700株
幸楽苑ホールディングス	9,600	1,735.00	16,656,000	貸付有価証券 1,200株（700株）
ハークスレイ	3,100	904.00	2,802,400	
サイゼリヤ	22,400	2,194.00	49,145,600	貸付有価証券 100株
VTホールディングス	56,800	413.00	23,458,400	
魚力	4,700	1,857.00	8,727,900	
ポプラ	3,900	339.00	1,322,100	貸付有価証券 2,000株
フジ・コーポレーション	4,000	2,236.00	8,944,000	
ユナイテッドアローズ	17,200	2,009.00	34,554,800	貸付有価証券 2,600株
ハイデイ日高	21,800	1,831.00	39,915,800	貸付有価証券 11,400株
京都きもの友禅	9,600	249.00	2,390,400	
コロワイド	50,100	1,942.00	97,294,200	貸付有価証券 29,200株（1,600株）
ピーシーデポコーポレー ション	17,500	542.00	9,485,000	貸付有価証券 1,700株

壱番屋	10,600	5,060.00	53,636,000	貸付有価証券 5,500株
トップカルチャー	5,400	352.00	1,900,800	
P L A N T	3,800	768.00	2,918,400	
スギホールディングス	30,100	7,370.00	221,837,000	
薬王堂ホールディングス	6,600	2,743.00	18,103,800	貸付有価証券 400株
スクロール	21,500	1,305.00	28,057,500	貸付有価証券 9,500株（3,100株）
ヨンドシーホールディングス	13,900	2,014.00	27,994,600	貸付有価証券 7,100株
木曽路	19,700	2,432.00	47,910,400	貸付有価証券 9,200株
S R S ホールディングス	18,800	868.00	16,318,400	貸付有価証券 8,800株（7,800株）
千趣会	27,200	359.00	9,764,800	貸付有価証券 16,300株
タカキュー	11,600	146.00	1,693,600	貸付有価証券 6,200株（300株）
リテールパートナーズ	18,300	1,412.00	25,839,600	貸付有価証券 9,500株
ケーヨー	27,900	750.00	20,925,000	貸付有価証券 12,700株
上新電機	17,700	3,195.00	56,551,500	
日本瓦斯	24,800	4,985.00	123,628,000	
ロイヤルホールディングス	26,300	1,894.00	49,812,200	貸付有価証券 900株（300株）
東天紅	1,100	948.00	1,042,800	貸付有価証券 500株
いなげや	16,800	1,683.00	28,274,400	貸付有価証券 100株
島忠	10,100	5,490.00	55,449,000	貸付有価証券 1,700株（1,000株）
チヨダ	15,800	996.00	15,736,800	貸付有価証券 8,300株
ライフコーポレーション	11,400	3,330.00	37,962,000	
リンガーハット	18,600	2,463.00	45,811,800	貸付有価証券 9,900株（1,000株）
MrMaxHD	20,700	749.00	15,504,300	貸付有価証券 10,800株
テンアライド	13,900	355.00	4,934,500	貸付有価証券

				7,300株
AOKIホールディングス	30,200	630.00	19,026,000	
オークワ	23,700	1,213.00	28,748,100	貸付有価証券 11,100株
コメリ	23,300	2,899.00	67,546,700	
青山商事	33,500	797.00	26,699,500	貸付有価証券 2,500株
しまむら	17,500	11,700.00	204,750,000	
はせがわ	8,000	293.00	2,344,000	
高島屋	109,900	1,063.00	116,823,700	貸付有価証券 500株
松屋	32,900	968.00	31,847,200	
エイチ・ツー・オー リ テイリング	71,400	846.00	60,404,400	
近鉄百貨店	5,800	3,420.00	19,836,000	貸付有価証券 100株
丸井グループ	127,600	2,015.00	257,114,000	貸付有価証券 500株
アクシアル リテイリン グ	12,500	4,875.00	60,937,500	
井筒屋	7,600	279.00	2,120,400	貸付有価証券 3,800株
イオン	580,300	3,546.00	2,057,743,800	
イズミ	30,700	3,930.00	120,651,000	貸付有価証券 15,800株
平和堂	27,800	2,122.00	58,991,600	貸付有価証券 13,000株
フジ	18,200	2,046.00	37,237,200	貸付有価証券 9,500株
ヤオコー	17,100	6,730.00	115,083,000	貸付有価証券 3,800株
ゼビオホールディングス	18,200	951.00	17,308,200	貸付有価証券 600株
ケーズホールディングス	134,300	1,519.00	204,001,700	
Olympicグループ	7,800	921.00	7,183,800	貸付有価証券 4,100株（2,600株）
日産東京販売ホールディ ングス	22,200	260.00	5,772,000	貸付有価証券 10,400株
シルバーライフ	2,000	2,171.00	4,342,000	
一家ダイニングプロジェ	2,200	568.00	1,249,600	

クト				
Genky Drug Stores	6,600	3,720.00	24,552,000	
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	989.00	2,868,100	貸付有価証券 500株（500株）
ブックオフグループホールディングス	8,800	875.00	7,700,000	貸付有価証券 4,800株
ギフト	1,400	2,046.00	2,864,400	
アインホールディングス	21,900	7,230.00	158,337,000	貸付有価証券 300株
元気寿司	4,200	2,498.00	10,491,600	
ヤマダホールディングス	505,400	546.00	275,948,400	
アークランドサカモト	23,600	1,602.00	37,807,200	貸付有価証券 7,200株（7,200株）
ニトリホールディングス	59,800	21,355.00	1,277,029,000	
グルメ杵屋	10,700	995.00	10,646,500	貸付有価証券 5,600株
愛眼	12,000	231.00	2,772,000	
ケーユーホールディングス	7,900	856.00	6,762,400	
吉野家ホールディングス	49,500	2,211.00	109,444,500	貸付有価証券 26,000株（12,300株）
松屋フーズホールディングス	7,300	3,660.00	26,718,000	
サガミホールディングス	20,300	1,190.00	24,157,000	貸付有価証券 10,500株
関西スーパーマーケット	11,400	1,160.00	13,224,000	
王将フードサービス	10,000	5,850.00	58,500,000	
プレナス	16,900	1,918.00	32,414,200	貸付有価証券 8,300株
ミニストップ	11,200	1,446.00	16,195,200	貸付有価証券 5,200株
アークス	28,800	2,401.00	69,148,800	貸付有価証券 14,900株
バローホールディングス	30,800	2,359.00	72,657,200	
藤久	3,500	739.00	2,586,500	
ベルク	7,400	5,750.00	42,550,000	貸付有価証券 100株（100株）
大庄	8,100	1,058.00	8,569,800	貸付有価証券 3,800株（600株）
ファーストリテイリング	20,200	107,350.00	2,168,470,000	

サンドラッグ	56,700	4,060.00	230,202,000	
サックスバー ホールディングス	12,800	615.00	7,872,000	
ヤマザワ	3,500	1,739.00	6,086,500	貸付有価証券 1,800株
やまや	3,100	2,244.00	6,956,400	貸付有価証券 1,600株
ベルーナ	32,400	1,016.00	32,918,400	
島根銀行	5,200	670.00	3,484,000	
じもとホールディングス	10,200	813.00	8,292,600	
めぶきフィナンシャルグループ	784,700	231.00	181,265,700	貸付有価証券 3,100株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,900	1,247.00	23,568,300	
九州フィナンシャルグループ	308,400	448.00	138,163,200	貸付有価証券 4,900株
ゆうちょ銀行	427,900	1,022.00	437,313,800	貸付有価証券 225,200株
富山第一銀行	36,000	294.00	10,584,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	920,100	421.00	387,362,100	
西日本フィナンシャルホールディングス	100,500	710.00	71,355,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	70,900	606.00	42,965,400	貸付有価証券 800株
三十三フィナンシャルグループ	13,100	1,369.00	17,933,900	
第四北越フィナンシャルグループ	24,600	2,358.00	58,006,800	
ひろぎんホールディングス	222,700	647.00	144,086,900	貸付有価証券 1,300株
新生銀行	123,100	1,449.00	178,371,900	
あおぞら銀行	90,000	2,300.00	207,000,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,330,900	553.50	5,718,153,150	貸付有価証券 100株
りそなホールディングス	1,642,100	433.30	711,521,930	
三井住友トラスト・ホールディングス	285,500	3,522.00	1,005,531,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,045,100	3,733.00	3,901,358,300	
千葉銀行	504,000	693.00	349,272,000	

群馬銀行	310,800	340.00	105,672,000	
武蔵野銀行	22,500	1,646.00	37,035,000	
千葉興業銀行	38,500	260.00	10,010,000	
筑波銀行	62,800	190.00	11,932,000	
七十七銀行	47,400	1,428.00	67,687,200	
青森銀行	11,700	2,505.00	29,308,500	
秋田銀行	9,000	1,438.00	12,942,000	
山形銀行	17,000	1,104.00	18,768,000	
岩手銀行	9,900	2,151.00	21,294,900	
東邦銀行	135,000	213.00	28,755,000	貸付有価証券 1,500株
東北銀行	7,200	1,080.00	7,776,000	
みちのく銀行	9,700	1,071.00	10,388,700	
ふくおかフィナンシャル グループ	136,300	2,027.00	276,280,100	
静岡銀行	367,800	805.00	296,079,000	
十六銀行	18,900	2,008.00	37,951,200	
スルガ銀行	132,400	348.00	46,075,200	
八十二銀行	340,200	364.00	123,832,800	貸付有価証券 300株
山梨中央銀行	17,500	901.00	15,767,500	
大垣共立銀行	29,800	2,084.00	62,103,200	
福井銀行	12,900	1,937.00	24,987,300	
北國銀行	14,000	2,791.00	39,074,000	
清水銀行	6,200	1,654.00	10,254,800	
富山銀行	2,900	2,878.00	8,346,200	
滋賀銀行	30,300	2,035.00	61,660,500	
南都銀行	22,000	1,829.00	40,238,000	
百五銀行	135,900	313.00	42,536,700	貸付有価証券 200株
京都銀行	54,100	6,530.00	353,273,000	
紀陽銀行	53,500	1,457.00	77,949,500	
ほくほくフィナンシャル グループ	100,500	971.00	97,585,500	
山陰合同銀行	95,100	501.00	47,645,100	
中国銀行	130,000	873.00	113,490,000	
鳥取銀行	4,800	1,127.00	5,409,600	
伊予銀行	200,100	640.00	128,064,000	

百十四銀行	16,000	1,596.00	25,536,000	
四国銀行	21,400	736.00	15,750,400	
阿波銀行	23,100	2,280.00	52,668,000	
大分銀行	8,700	2,133.00	18,557,100	
宮崎銀行	9,400	2,294.00	21,563,600	
佐賀銀行	8,600	1,403.00	12,065,800	
沖縄銀行	13,800	2,832.00	39,081,600	
琉球銀行	32,800	786.00	25,780,800	
セブン銀行	504,600	243.00	122,617,800	貸付有価証券 13,800株
みずほフィナンシャルグループ	2,052,100	1,570.00	3,221,797,000	
高知銀行	5,500	805.00	4,427,500	
山口フィナンシャルグループ	188,500	659.00	124,221,500	
長野銀行	5,000	1,290.00	6,450,000	
名古屋銀行	12,100	2,847.00	34,448,700	
北洋銀行	227,700	235.00	53,509,500	
愛知銀行	5,100	2,986.00	15,228,600	
中京銀行	5,400	1,836.00	9,914,400	
大光銀行	5,200	1,363.00	7,087,600	
愛媛銀行	21,100	1,017.00	21,458,700	
トマト銀行	5,800	1,071.00	6,211,800	
京葉銀行	64,400	432.00	27,820,800	
栃木銀行	72,900	180.00	13,122,000	
北日本銀行	4,700	1,933.00	9,085,100	
東和銀行	26,500	699.00	18,523,500	
福島銀行	17,300	249.00	4,307,700	貸付有価証券 6,400株
大東銀行	7,200	666.00	4,795,200	
トモニホールディングス	116,800	313.00	36,558,400	
フィデアホールディングス	146,600	122.00	17,885,200	
池田泉州ホールディングス	173,700	165.00	28,660,500	貸付有価証券 1,800株
F P G	46,600	614.00	28,612,400	貸付有価証券 800株（800株）
ジャパンインベストメン	7,600	1,292.00	9,819,200	貸付有価証券

トアドバイザー				3,500株（100株）
マーキュリアインベストメント	5,900	701.00	4,135,900	
S B I ホールディングス	185,200	3,125.00	578,750,000	貸付有価証券 200株
日本アジア投資	12,800	253.00	3,238,400	
ジャフコ グループ	23,200	6,910.00	160,312,000	貸付有価証券 10,800株（10,800株）
大和証券グループ本社	1,131,000	534.30	604,293,300	
野村ホールディングス	2,305,800	630.40	1,453,576,320	
岡三証券グループ	128,700	408.00	52,509,600	
丸三証券	44,900	607.00	27,254,300	貸付有価証券 26,800株
東洋証券	49,800	184.00	9,163,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	161,000	378.00	60,858,000	
光世証券	3,600	701.00	2,523,600	
水戸証券	40,300	298.00	12,009,400	
いちよし証券	30,300	603.00	18,270,900	
松井証券	74,000	905.00	66,970,000	
マネックスグループ	135,400	995.00	134,723,000	貸付有価証券 39,200株（38,800株）
極東証券	20,300	810.00	16,443,000	
岩井コスモホールディングス	15,500	1,541.00	23,885,500	
藍澤證券	27,100	864.00	23,414,400	
マネーパートナーズグループ	16,100	337.00	5,425,700	
スパークス・グループ	69,700	317.00	22,094,900	貸付有価証券 500株
小林洋行	4,300	287.00	1,234,100	
かんぽ生命保険	187,200	2,169.00	406,036,800	
SOMPOホールディングス	266,200	4,190.00	1,115,378,000	
アニコム ホールディングス	42,500	1,114.00	47,345,000	
MS&ADインシュアランスグループホール	366,800	3,117.00	1,143,315,600	
第一生命ホールディングス	797,800	1,890.50	1,508,240,900	

東京海上ホールディングス	500,600	5,400.00	2,703,240,000	
T&Dホールディングス	451,400	1,442.00	650,918,800	
アドバンスクリエイト	3,200	1,826.00	5,843,200	
全国保証	39,300	5,270.00	207,111,000	貸付有価証券 9,600株
ジェイリース	5,000	796.00	3,980,000	貸付有価証券 1,000株
イントラスト	4,300	720.00	3,096,000	
日本モーゲージサービス	7,600	1,127.00	8,565,200	貸付有価証券 200株（200株）
C a s a	4,200	998.00	4,191,600	貸付有価証券 1,900株
アルヒ	22,300	1,582.00	35,278,600	貸付有価証券 10,300株
プレミアグループ	6,900	2,340.00	16,146,000	
クレディセゾン	88,200	1,336.00	117,835,200	
芙蓉総合リース	15,800	7,250.00	114,550,000	
みずほリース	23,300	3,365.00	78,404,500	
東京センチュリー	35,100	7,580.00	266,058,000	貸付有価証券 4,900株
日本証券金融	63,900	600.00	38,340,000	貸付有価証券 200株
アイフル	253,400	277.00	70,191,800	
リコーリース	11,900	3,305.00	39,329,500	
イオンフィナンシャルサービス	92,400	1,410.00	130,284,000	
アコム	303,500	468.00	142,038,000	貸付有価証券 200株
ジャックス	16,700	2,090.00	34,903,000	
オリエントコーポレーション	408,500	149.00	60,866,500	貸付有価証券 100株
日立キャピタル	35,600	2,877.00	102,421,200	
オリックス	937,000	1,802.00	1,688,474,000	
三菱UFJリース	340,700	571.00	194,539,700	貸付有価証券 1,900株
九州リースサービス	7,400	651.00	4,817,400	貸付有価証券 1,100株
日本取引所グループ	408,000	2,440.00	995,520,000	貸付有価証券 100株

イー・ギャランティ	17,300	2,186.00	37,817,800	
アサックス	7,800	745.00	5,811,000	貸付有価証券 4,700株
NEC キャピタルソ リューション	6,100	2,005.00	12,230,500	
いちご	168,200	328.00	55,169,600	貸付有価証券 400株
日本駐車場開発	149,100	141.00	21,023,100	
スター・マイカ・ホール ディングス	7,800	1,182.00	9,219,600	
SREホールディングス	1,600	5,080.00	8,128,000	
ADワークスグループ	28,800	157.00	4,521,600	
ヒューリック	320,400	1,204.00	385,761,600	貸付有価証券 21,000株
三栄建築設計	6,100	1,800.00	10,980,000	
野村不動産ホールディン グス	91,800	2,432.00	223,257,600	
三重交通グループホール ディングス	30,600	496.00	15,177,600	貸付有価証券 15,800株
サムティ	21,500	1,751.00	37,646,500	貸付有価証券 1,000株
ディア・ライフ	21,400	417.00	8,923,800	
コーセーアールイー	4,400	601.00	2,644,400	貸付有価証券 500株
日本商業開発	9,600	1,658.00	15,916,800	
プレサンスコーポレー ション	24,800	1,523.00	37,770,400	貸付有価証券 7,600株（5,900株）
ハウスコム	2,600	1,320.00	3,432,000	
日本管理センター	8,100	1,207.00	9,776,700	
サンセイランディック	4,400	775.00	3,410,000	
エストラスト	1,800	710.00	1,278,000	貸付有価証券 900株
フージャースホールディ ングス	24,600	683.00	16,801,800	貸付有価証券 12,600株
オープンハウス	47,600	4,045.00	192,542,000	
東急不動産ホールディン グス	410,600	676.00	277,565,600	貸付有価証券 500株
飯田グループホールディ ングス	126,000	2,386.00	300,636,000	
イーグランド	2,400	847.00	2,032,800	

ムゲンエステート	9,300	488.00	4,538,400	
ビーロット	7,100	638.00	4,529,800	
ファーストブラザーズ	2,700	969.00	2,616,300	
ハウドゥ	7,400	1,137.00	8,413,800	
シーアールイー	3,900	1,205.00	4,699,500	
プロパティエージェント	2,400	1,538.00	3,691,200	
ケイアイスター不動産	4,700	3,610.00	16,967,000	
アグレ都市デザイン	2,700	770.00	2,079,000	貸付有価証券 1,200株
グッドコムアセット	7,200	1,400.00	10,080,000	
ジェイ・エス・ビー	2,800	3,335.00	9,338,000	
テンポイノベーション	4,200	958.00	4,023,600	貸付有価証券 1,700株
グローバル・リンク・マ ネジメント	2,600	847.00	2,202,200	
パーク 2 4	81,100	2,292.00	185,881,200	
パラカ	3,900	1,623.00	6,329,700	
三井不動産	688,300	2,400.00	1,651,920,000	
三菱地所	992,100	1,863.00	1,848,282,300	
平和不動産	25,900	3,585.00	92,851,500	貸付有価証券 900株
東京建物	149,200	1,528.00	227,977,600	
ダイビル	38,900	1,268.00	49,325,200	
京阪神ビルディング	26,000	1,531.00	39,806,000	
住友不動産	339,500	3,583.00	1,216,428,500	貸付有価証券 500株
テーオーシー	29,600	805.00	23,828,000	
東京楽天地	2,500	4,335.00	10,837,500	
レオパレス 2 1	125,300	131.00	16,414,300	貸付有価証券 73,200株
スターツコーポレーショ ン	18,000	2,905.00	52,290,000	
フジ住宅	17,500	666.00	11,655,000	貸付有価証券 500株
空港施設	15,100	517.00	7,806,700	
明和地所	7,100	637.00	4,522,700	
ゴールドクレスト	13,600	1,719.00	23,378,400	貸付有価証券 100株
エスリード	5,900	1,596.00	9,416,400	貸付有価証券

				900株
日神グループホールディングス	22,300	446.00	9,945,800	貸付有価証券 10,400株
日本エスコン	27,400	765.00	20,961,000	貸付有価証券 800株
タカラレーベン	63,300	341.00	21,585,300	
A V A N T I A	8,500	875.00	7,437,500	
イオンモール	75,700	1,870.00	141,559,000	貸付有価証券 39,800株
毎日コムネット	3,900	700.00	2,730,000	
ファースト住建	6,400	1,100.00	7,040,000	貸付有価証券 1,700株
カチタス	37,400	3,170.00	118,558,000	
トーセイ	20,800	1,011.00	21,028,800	貸付有価証券 100株
穴吹興産	3,300	1,720.00	5,676,000	
サンフロンティア不動産	18,500	918.00	16,983,000	
エフ・ジェー・ネクスト	14,800	1,146.00	16,960,800	貸付有価証券 2,500株
インテリックス	3,400	560.00	1,904,000	
ランドビジネス	5,100	362.00	1,846,200	
サンネクスタグループ	4,800	986.00	4,732,800	
グランディハウス	10,300	457.00	4,707,100	
日本空港ビルデング	48,200	5,080.00	244,856,000	貸付有価証券 100株
明豊ファシリティワークス	6,700	634.00	4,247,800	
日本工営	9,100	2,842.00	25,862,200	
L I F U L L	51,100	426.00	21,768,600	
ミクシィ	27,900	2,741.00	76,473,900	貸付有価証券 300株
ジェイエイシーリクルートメント	9,800	1,700.00	16,660,000	
日本M&Aセンター	119,900	6,180.00	740,982,000	貸付有価証券 300株
メンバーズ	4,300	2,682.00	11,532,600	
中広	2,000	341.00	682,000	貸付有価証券 100株
UTグループ	21,100	3,165.00	66,781,500	貸付有価証券 4,900株（4,900株）

アイティメディア	4,900	1,991.00	9,755,900	貸付有価証券 1,000株（100株）
タケエイ	16,300	1,273.00	20,749,900	貸付有価証券 5,600株
E・Jホールディングス	5,700	994.00	5,665,800	
ビーネックスグループ	18,400	1,345.00	24,748,000	貸付有価証券 4,100株
コシダカホールディングス	35,200	564.00	19,852,800	貸付有価証券 12,900株
アルトナー	3,500	833.00	2,915,500	
パソナグループ	15,900	1,929.00	30,671,100	貸付有価証券 100株
C D S	3,600	1,394.00	5,018,400	
リンクアンドモチベーション	26,900	537.00	14,445,300	貸付有価証券 5,400株（5,400株）
G C A	19,100	791.00	15,108,100	
エス・エム・エス	49,700	3,635.00	180,659,500	
サニーサイドアップグループ	5,100	710.00	3,621,000	貸付有価証券 400株（300株）
パーソルホールディングス	146,300	2,199.00	321,713,700	
リニカル	8,200	762.00	6,248,400	貸付有価証券 400株
クックパッド	46,000	310.00	14,260,000	貸付有価証券 4,800株
エスクリ	4,600	384.00	1,766,400	貸付有価証券 2,100株
アイ・ケイ・ケイ	7,100	615.00	4,366,500	
学情	5,200	1,410.00	7,332,000	
スタジオアリス	7,400	2,045.00	15,133,000	貸付有価証券 4,300株
シミックホールディングス	7,200	1,724.00	12,412,800	貸付有価証券 1,000株
エプコ	3,500	927.00	3,244,500	
N J S	3,600	1,896.00	6,825,600	
総合警備保障	58,200	4,990.00	290,418,000	
カカクコム	108,100	3,610.00	390,241,000	
セントケア・ホールディング	10,700	918.00	9,822,600	
サイネックス	2,500	728.00	1,820,000	

ルネサンス	9,100	1,206.00	10,974,600	貸付有価証券 4,200株
ディップ	22,900	3,100.00	70,990,000	貸付有価証券 10,700株（4,700株）
デジタルホールディングス	10,200	2,011.00	20,512,200	
新日本科学	17,800	661.00	11,765,800	貸付有価証券 4,700株（2,500株）
ツクイホールディングス	34,400	924.00	31,785,600	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
キャリアデザインセンター	3,400	895.00	3,043,000	
ベネフィット・ワン	53,200	2,943.00	156,567,600	貸付有価証券 100株
エムスリー	258,100	8,886.00	2,293,476,600	貸付有価証券 300株
ツカダ・グローバルホールディング	11,600	342.00	3,967,200	
プラス	1,900	488.00	927,200	貸付有価証券 400株（400株）
アウトソーシング	83,800	1,491.00	124,945,800	
ウェルネット	14,800	510.00	7,548,000	
ワールドホールディングス	5,000	2,351.00	11,755,000	貸付有価証券 500株
ディー・エヌ・エー	61,900	2,208.00	136,675,200	
博報堂DYホールディングス	203,600	1,800.00	366,480,000	
ぐるなび	25,500	636.00	16,218,000	貸付有価証券 200株
タカミヤ	17,700	527.00	9,327,900	
ジャパンベストレスキューシステム	11,500	917.00	10,545,500	
ファンコミュニケーションズ	40,200	402.00	16,160,400	
ライク	3,900	1,933.00	7,538,700	
ビジネス・ブレークスルー	6,100	440.00	2,684,000	
エスプール	37,600	1,059.00	39,818,400	貸付有価証券 200株
WDBホールディングス	6,700	2,718.00	18,210,600	
手間いらず	1,400	5,140.00	7,196,000	

ティア	8,500	476.00	4,046,000	
C D G	1,300	1,557.00	2,024,100	
アドウェイズ	17,800	896.00	15,948,800	貸付有価証券 8,200株
バリューコマース	9,800	3,155.00	30,919,000	
インフォマート	148,000	997.00	147,556,000	
J Pホールディングス	41,800	290.00	12,122,000	貸付有価証券 100株
E P Sホールディングス	19,800	1,210.00	23,958,000	貸付有価証券 400株
レグス	3,600	1,667.00	6,001,200	
プレステージ・インター ナショナル	54,800	783.00	42,908,400	
アミューズ	8,000	2,493.00	19,944,000	
ドリームインキュベータ	4,500	1,192.00	5,364,000	
クイック	9,100	1,222.00	11,120,200	
T A C	7,900	263.00	2,077,700	
ケネディクス	41,900	748.00	31,341,200	貸付有価証券 4,000株
電通グループ	164,500	3,640.00	598,780,000	貸付有価証券 100株
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,800	884.00	6,011,200	
ぴあ	4,200	3,315.00	13,923,000	貸付有価証券 1,800株（1,400株）
イオンファンタジー	5,600	2,498.00	13,988,800	貸付有価証券 2,900株
シーティーエス	16,500	913.00	15,064,500	
ネクシィーズグループ	4,500	1,054.00	4,743,000	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	40,900	3,255.00	133,129,500	
アルプス技研	12,900	2,028.00	26,161,200	
ダイオーズ	2,900	985.00	2,856,500	
日本空調サービス	15,300	734.00	11,230,200	
オリエンタルランド	155,600	18,355.00	2,856,038,000	貸付有価証券 200株
ダスキン	33,900	2,830.00	95,937,000	
明光ネットワークジャパ ン	18,500	573.00	10,600,500	貸付有価証券 4,400株

ファルコホールディングス	7,000	1,640.00	11,480,000	
秀英予備校	3,200	431.00	1,379,200	
ラウンドワン	49,900	1,127.00	56,237,300	貸付有価証券 1,600株
リゾートトラスト	67,100	1,750.00	117,425,000	
ビー・エム・エル	18,800	3,710.00	69,748,000	
りらいあコミュニケーションズ	22,200	1,405.00	31,191,000	貸付有価証券 1,200株
リソー教育	74,300	344.00	25,559,200	
早稲田アカデミー	5,500	991.00	5,450,500	貸付有価証券 2,500株（100株）
ユー・エス・エス	163,800	2,094.00	342,997,200	
東京個別指導学院	12,900	676.00	8,720,400	貸付有価証券 6,000株
サイバーエージェント	90,200	6,830.00	616,066,000	
楽天	682,000	1,130.00	770,660,000	貸付有価証券 90,000株
クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,297.00	9,986,900	
モーニングスター	16,000	481.00	7,696,000	
テー・オー・ダブリュー	25,600	291.00	7,449,600	貸付有価証券 100株
山田コンサルティンググループ	8,500	1,002.00	8,517,000	
セントラルスポーツ	5,500	2,411.00	13,260,500	貸付有価証券 2,500株
フルキャストホールディングス	12,800	1,883.00	24,102,400	
エン・ジャパン	26,000	3,320.00	86,320,000	
リソルホールディングス	1,600	4,145.00	6,632,000	貸付有価証券 800株
テクノプロ・ホールディングス	29,200	8,110.00	236,812,000	
アトラ	3,400	364.00	1,237,600	貸付有価証券 2,000株
インターワークス	4,200	386.00	1,621,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,900	14,190.00	83,721,000	
Keepers技研	9,400	1,729.00	16,252,600	
ファーストロジック	2,800	766.00	2,144,800	

三機サービス	2,800	1,009.00	2,825,200	
Gunosy	9,100	767.00	6,979,700	
デザインワン・ジャパン	4,300	235.00	1,010,500	
イー・ガーディアン	6,400	3,220.00	20,608,000	
リブセンス	8,000	235.00	1,880,000	
ジャパンマテリアル	45,000	1,411.00	63,495,000	
ベクトル	18,200	1,205.00	21,931,000	貸付有価証券 9,700株
ウチヤマホールディングス	7,200	365.00	2,628,000	貸付有価証券 3,700株
チャーム・ケア・コーポレーション	10,900	1,450.00	15,805,000	貸付有価証券 2,000株
キャリアリンク	4,800	3,140.00	15,072,000	貸付有価証券 2,500株
I B J	12,000	994.00	11,928,000	貸付有価証券 1,200株
アサンテ	5,300	1,719.00	9,110,700	
N・フィールド	10,000	1,198.00	11,980,000	貸付有価証券 6,000株
バリューHR	5,800	1,827.00	10,596,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	12,000	4,880.00	58,560,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,600	1,753.00	9,816,800	貸付有価証券 3,300株（3,300株）
ERIホールディングス	4,100	621.00	2,546,100	
アビスト	2,300	3,000.00	6,900,000	
シグマクシス	8,000	1,835.00	14,680,000	
ウィルグループ	10,700	988.00	10,571,600	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	21,700	287.00	6,227,900	
メドピア	6,900	6,340.00	43,746,000	
レアジョブ	2,000	2,069.00	4,138,000	貸付有価証券 900株
リクルートホールディングス	1,048,100	5,312.00	5,567,507,200	
エラン	20,200	1,448.00	29,249,600	
土木管理総合試験所	7,100	350.00	2,485,000	
ネットマーケティング	7,000	614.00	4,298,000	貸付有価証券 800株
日本郵政	1,107,000	901.00	997,407,000	

ベルシステム24ホールディングス	24,500	1,844.00	45,178,000	
鎌倉新書	14,700	888.00	13,053,600	貸付有価証券 4,500株（1,300株）
SMN	3,100	763.00	2,365,300	
一蔵	1,800	394.00	709,200	
LITALICO	5,900	3,715.00	21,918,500	
グローバルキッズCOMPANY	2,600	853.00	2,217,800	
エアトリ	7,900	2,019.00	15,950,100	貸付有価証券 800株
アトラエ	4,400	3,305.00	14,542,000	貸付有価証券 100株
ストライク	5,500	4,700.00	25,850,000	
ソラスト	35,900	1,525.00	54,747,500	
セラク	4,600	1,769.00	8,137,400	貸付有価証券 2,300株
インソース	12,200	2,248.00	27,425,600	貸付有価証券 3,200株（3,200株）
ベイカレント・コンサルティング	9,600	21,200.00	203,520,000	
Orchestra Holdings	3,300	2,610.00	8,613,000	
アイモバイル	5,200	1,319.00	6,858,800	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
キャリアインデックス	6,000	584.00	3,504,000	貸付有価証券 700株（700株）
MS-Japan	5,900	1,167.00	6,885,300	貸付有価証券 600株
船場	2,900	865.00	2,508,500	
グレイステクノロジー	7,400	5,580.00	41,292,000	貸付有価証券 1,500株（700株）
ジャパンエレベーターサービスホールディング	42,100	2,315.00	97,461,500	
フルテック	2,000	1,395.00	2,790,000	
グリーンズ	5,500	540.00	2,970,000	貸付有価証券 700株
ツナググループ・ホールディングス	2,500	351.00	877,500	貸付有価証券 400株
GameWith	4,300	630.00	2,709,000	
ソウルドアウト	3,500	1,712.00	5,992,000	貸付有価証券

				100株（100株）
MS&Consulting	2,300	595.00	1,368,500	
ウェルビー	4,700	1,466.00	6,890,200	貸付有価証券 2,200株
エル・ティー・エス	1,000	3,765.00	3,765,000	貸付有価証券 500株（400株）
ミダック	3,200	4,125.00	13,200,000	
日総工産	11,400	855.00	9,747,000	貸付有価証券 400株
キュービーネットホールディングス	6,700	1,834.00	12,287,800	
RPAホールディングス	16,700	661.00	11,038,700	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
スプリックス	4,100	821.00	3,366,100	貸付有価証券 2,100株（400株）
マネジメントソリューションズ	7,100	1,929.00	13,695,900	
プロレド・パートナーズ	2,000	3,480.00	6,960,000	貸付有価証券 300株（300株）
and factory	1,400	787.00	1,101,800	
テクノ・ホールディングス	1,200	1,066.00	1,279,200	
フロンティア・マネジメント	2,500	1,945.00	4,862,500	貸付有価証券 500株
ピアラ	800	1,876.00	1,500,800	
コプロ・ホールディングス	700	2,922.00	2,045,400	
ギークス	1,900	1,637.00	3,110,300	
カーブスホールディングス	40,200	967.00	38,873,400	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
フォーラムエンジニアリング	7,600	1,021.00	7,759,600	
ダイレクトマーケティングミックス	5,700	3,020.00	17,214,000	
ポピンズホールディングス	2,900	3,100.00	8,990,000	貸付有価証券 1,200株
アドバンテッジリスクマネジメント	7,400	724.00	5,357,600	
リログループ	80,000	2,622.00	209,760,000	貸付有価証券 24,100株
東祥	9,100	1,829.00	16,643,900	

エイチ・アイ・エス	21,300	2,305.00	49,096,500	貸付有価証券 10,000株（4,100株）
ラックランド	4,200	2,380.00	9,996,000	貸付有価証券 100株
共立メンテナンス	24,200	3,820.00	92,444,000	貸付有価証券 10,300株（3,100株）
イチネンホールディングス	15,200	1,307.00	19,866,400	
建設技術研究所	9,400	2,395.00	22,513,000	
スペース	9,500	867.00	8,236,500	貸付有価証券 1,300株
長大	5,800	1,551.00	8,995,800	
燦ホールディングス	6,400	1,134.00	7,257,600	
スバル興業	900	7,950.00	7,155,000	
東京テアトル	5,700	1,296.00	7,387,200	
タナベ経営	2,800	1,390.00	3,892,000	
ナガワ	4,700	12,130.00	57,011,000	貸付有価証券 2,200株
よみうりランド	800	6,030.00	4,824,000	
東京都競馬	9,600	4,840.00	46,464,000	
常磐興産	5,900	1,398.00	8,248,200	
カナモト	25,800	2,412.00	62,229,600	
東京ドーム	59,200	1,299.00	76,900,800	
西尾レントオール	13,500	2,657.00	35,869,500	
トランス・コスモス	13,900	2,786.00	38,725,400	貸付有価証券 600株
乃村工藝社	62,700	827.00	51,852,900	
藤田観光	5,800	1,849.00	10,724,200	貸付有価証券 2,700株
KNT－CTホールディングス	7,800	1,149.00	8,962,200	貸付有価証券 4,900株
日本管財	15,700	2,124.00	33,346,800	貸付有価証券 8,600株
トーカイ	14,100	2,245.00	31,654,500	
白洋舎	1,700	2,365.00	4,020,500	貸付有価証券 900株
セコム	144,200	9,882.00	1,424,984,400	
セントラル警備保障	7,000	3,570.00	24,990,000	
丹青社	27,600	812.00	22,411,200	

	メイテック	17,900	5,630.00	100,777,000	
	応用地質	17,000	1,282.00	21,794,000	
	船井総研ホールディングス	29,900	2,386.00	71,341,400	
	進学会ホールディングス	5,700	473.00	2,696,100	貸付有価証券 3,000株
	オオバ	10,300	743.00	7,652,900	貸付有価証券 100株（100株）
	いであ	3,600	1,725.00	6,210,000	
	学究社	4,300	1,323.00	5,688,900	
	ベネッセホールディングス	53,600	2,175.00	116,580,000	
	イオンディライト	18,000	3,180.00	57,240,000	貸付有価証券 9,400株
	ナック	6,900	978.00	6,748,200	貸付有価証券 2,600株
	ダイセキ	24,500	3,465.00	84,892,500	
	ステップ	5,300	1,525.00	8,082,500	
	小計 銘柄数：2,172			406,973,266,290	
	組入時価比率：98.4%			100.0%	
合計				406,973,266,290	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2021年2月18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	2021年 2月18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	6,281,170,552	—	6,590,160,000	308,821,643
合計	6,281,170,552	—	6,590,160,000	308,821,643

(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NOMURA－BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2021年 2月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,091,209,933
国債証券	577,173,063,270
地方債証券	51,647,590,559
特殊債券	62,722,661,305
社債券	27,221,484,700
未収入金	812,739,000
未収利息	1,641,727,229
前払費用	35,169,695
流動資産合計	728,345,645,691
資産合計	728,345,645,691
負債の部	
流動負債	
未払金	300,000,000
未払解約金	1,800,956,452
未払利息	6,508
流動負債合計	2,100,962,960
負債合計	2,100,962,960
純資産の部	
元本等	
元本	548,901,914,574
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	177,342,768,157
元本等合計	726,244,682,731
純資産合計	726,244,682,731
負債純資産合計	728,345,645,691

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 2月18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	1.3231円
(10,000口当たり純資産額)	(13,231円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2020年 2月19日 至 2021年 2月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月18日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年 2月18日現在	
期首	2020年 2月19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	530,140,447,762円
同期中における追加設定元本額	101,192,043,728円
同期中における一部解約元本額	82,430,576,916円
期末元本額	548,901,914,574円
期末元本額の内訳※	
野村国内債券インデックスファンド	416,513,672円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	41,156,819,670円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	17,520,382,553円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,012,877,354円
野村資産設計ファンド2015	347,487,444円
野村資産設計ファンド2020	350,339,060円
野村資産設計ファンド2025	320,671,440円
野村資産設計ファンド2030	252,577,630円
野村資産設計ファンド2035	129,791,252円
野村資産設計ファンド2040	182,725,911円
野村日本債券インデックスファンド	889,379,279円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	162,802,858,944円
のむラップ・ファンド（保守型）	12,801,272,047円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,775,501,630円
のむラップ・ファンド（積極型）	1,303,390,106円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,604,770,917円
野村資産設計ファンド2045	17,568,685円
野村円債投資インデックスファンド	893,784,146円
野村インデックスファンド・国内債券	2,514,784,723円
マイ・ロード	33,414,226,110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	1,285,256,225円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	16,743,827,497円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,397,369,664円
野村資産設計ファンド2050	21,783,690円
野村ターゲットデートファンド2016 2026－2028年目標型	24,183,840円
野村ターゲットデートファンド2016 2029－2031年目標型	6,667,510円
野村ターゲットデートファンド2016 2032－2034年目標型	3,599,356円
野村ターゲットデートファンド2016 2035－2037年目標型	2,117,130円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	841,332,442円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	267,624,556円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	55,439,346円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	29,345,613円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	73,580,854円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	14,276,593円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	12,672,396円
野村6資産均等バランス	2,437,672,134円

世界6資産分散ファンド	117,444,724円
野村資産設計ファンド2060	7,344,906円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	4,379,397,386円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	15,774,853,794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）	594,714,243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）	98,028,790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）	1,927,049,142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）	1,365,293,631円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	18,195,002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）	11,350,822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）	481,753円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,626,871,199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）	10,549,901円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	81,767,026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）	67,501,058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）	363,017,665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）	319,415,740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）	858,444,937円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	177,455,580円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	708,585,579円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	1,956,498,707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）	13,794,842円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	36,056,599,143円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	46,286,278,109円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	17,221,860,962円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合（確定拠出年金向け）	50,475,045,686円
マイバランスDC30	12,611,366,136円
マイバランスDC50	10,086,162,926円
マイバランスDC70	3,295,449,544円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	13,000,780,790円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	891,217,870円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	2,190,717,312円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	975,347,650円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	143,868,335円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	23,503,293円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	24,309,087円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	40,290,842円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	15,567,927円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	6,521,031円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	608,024,605円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	309,952,885円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	105,571,463円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	128,455,664円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	2,495,468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(2021年2月18日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2021年2月18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４１３回	500,000,000	501,470,000	
		国庫債券 利付（２年）第４１５回	3,700,000,000	3,712,580,000	
		国庫債券 利付（２年）第４１６回	3,000,000,000	3,010,800,000	
		国庫債券 利付（２年）第４１７回	3,200,000,000	3,212,160,000	
		国庫債券 利付（２年）第４１８回	4,400,000,000	4,417,600,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２０回	500,000,000	502,150,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３１回	4,300,000,000	4,310,449,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３２回	3,000,000,000	3,009,180,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３３回	6,200,000,000	6,222,568,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３４回	2,500,000,000	2,510,325,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３５回	8,500,000,000	8,538,930,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３６回	3,300,000,000	3,316,962,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３７回	4,000,000,000	4,022,800,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３８回	5,500,000,000	5,535,145,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３９回	4,400,000,000	4,429,876,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４０回	3,400,000,000	3,424,446,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４１回	4,500,000,000	4,533,975,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４３回	4,970,000,000	5,010,704,300	
		国庫債券 利付（５年）第１４４回	4,500,000,000	4,538,160,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４５回	4,900,000,000	4,943,953,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４６回	1,000,000,000	1,008,970,000	
		国庫債券 利付（４０年）第１回	2,360,000,000	3,397,031,200	
		国庫債券 利付（４０年）第２回	900,000,000	1,256,607,000	
		国庫債券 利付（４０年）第３回	900,000,000	1,264,356,000	
		国庫債券 利付（４０年）第４回	1,130,000,000	1,596,791,700	
		国庫債券 利付（４０年）第５回	1,200,000,000	1,642,212,000	
		国庫債券 利付（４０年）第６回	1,300,000,000	1,754,623,000	
		国庫債券 利付（４０年）第７回	1,400,000,000	1,820,028,000	
		国庫債券 利付（４０年）第８回	1,500,000,000	1,824,045,000	
		国庫債券 利付（４０年）第９回	2,050,000,000	1,866,279,000	
		国庫債券 利付（４０年）第１０回	2,010,000,000	2,144,308,200	

国庫債券 利付（４０年）第１１回	1,750,000,000	1,812,177,500	
国庫債券 利付（４０年）第１２回	2,070,000,000	1,936,774,800	
国庫債券 利付（４０年）第１３回	3,960,000,000	3,699,907,200	
国庫債券 利付（１０年）第３２１回	3,200,000,000	3,238,912,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２２回	2,400,000,000	2,426,568,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２３回	1,700,000,000	1,723,239,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２４回	3,200,000,000	3,239,456,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２５回	4,400,000,000	4,464,548,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２６回	2,100,000,000	2,131,626,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２７回	3,100,000,000	3,152,359,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２８回	5,250,000,000	5,328,750,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	6,128,340,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,890,098,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,935,188,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	6,019,888,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３３回	3,600,000,000	3,679,524,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	6,756,684,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３５回	4,600,000,000	4,700,096,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３６回	2,750,000,000	2,813,470,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３７回	3,000,000,000	3,046,170,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３８回	5,000,000,000	5,101,350,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３９回	5,000,000,000	5,107,600,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４０回	4,200,000,000	4,295,676,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４１回	7,300,000,000	7,436,364,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４２回	5,750,000,000	5,802,785,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４３回	5,900,000,000	5,955,224,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４４回	5,800,000,000	5,855,216,000	
	5,000,000,000	5,048,300,000	

国庫債券 利付（１０年）第３４５回			
国庫債券 利付（１０年）第３４６回	4,900,000,000	4,947,824,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４７回	5,400,000,000	5,453,136,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４８回	6,800,000,000	6,865,076,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４９回	2,800,000,000	2,826,852,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５０回	5,150,000,000	5,197,483,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５１回	7,700,000,000	7,767,837,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５２回	6,600,000,000	6,655,044,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５３回	5,100,000,000	5,139,933,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５４回	4,350,000,000	4,381,581,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５５回	5,100,000,000	5,131,773,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５６回	4,800,000,000	4,826,688,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５７回	1,900,000,000	1,909,177,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５８回	5,470,000,000	5,492,208,200	
国庫債券 利付（１０年）第３５９回	5,300,000,000	5,314,734,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６０回	7,900,000,000	7,915,010,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６１回	1,800,000,000	1,801,746,000	
国庫債券 利付（３０年）第１回	500,000,000	618,045,000	
国庫債券 利付（３０年）第２回	500,000,000	605,305,000	
国庫債券 利付（３０年）第３回	160,000,000	192,956,800	
国庫債券 利付（３０年）第４回	900,000,000	1,145,556,000	
国庫債券 利付（３０年）第５回	150,000,000	181,857,000	
国庫債券 利付（３０年）第６回	600,000,000	744,798,000	
国庫債券 利付（３０年）第７回	600,000,000	743,082,000	
国庫債券 利付（３０年）第８回	100,000,000	118,787,000	
国庫債券 利付（３０年）第９回	265,000,000	302,632,650	
国庫債券 利付（３０年）第１０回	250,000,000	277,027,500	
国庫債券 利付（３０年）第１１回	160,000,000	189,110,400	
国庫債券 利付（３０年）第１２回	220,000,000	271,473,400	
国庫債券 利付（３０年）第１３回	290,000,000	355,087,600	
国庫債券 利付（３０年）第１４回	800,000,000	1,023,024,000	
国庫債券 利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,165,761,000	

国庫債券	利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,188,585,000
国庫債券	利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,547,016,000
国庫債券	利付（３０年）第１８回	2,200,000,000	2,813,382,000
国庫債券	利付（３０年）第１９回	2,050,000,000	2,627,813,000
国庫債券	利付（３０年）第２０回	1,270,000,000	1,668,538,700
国庫債券	利付（３０年）第２１回	300,000,000	386,301,000
国庫債券	利付（３０年）第２２回	600,000,000	792,144,000
国庫債券	利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,111,681,200
国庫債券	利付（３０年）第２４回	700,000,000	928,571,000
国庫債券	利付（３０年）第２５回	500,000,000	649,675,000
国庫債券	利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,120,368,000
国庫債券	利付（３０年）第２７回	1,550,000,000	2,075,574,000
国庫債券	利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,614,492,000
国庫債券	利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	2,001,060,000
国庫債券	利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,246,465,000
国庫債券	利付（３０年）第３１回	1,200,000,000	1,570,908,000
国庫債券	利付（３０年）第３２回	1,200,000,000	1,599,912,000
国庫債券	利付（３０年）第３３回	2,400,000,000	3,080,592,000
国庫債券	利付（３０年）第３４回	1,600,000,000	2,121,488,000
国庫債券	利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	2,971,577,000
国庫債券	利付（３０年）第３６回	2,300,000,000	2,980,616,000
国庫債券	利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	2,941,608,000
国庫債券	利付（３０年）第３８回	1,600,000,000	2,019,616,000
国庫債券	利付（３０年）第３９回	1,600,000,000	2,054,096,000
国庫債券	利付（３０年）第４０回	1,300,000,000	1,644,604,000
国庫債券	利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	1,868,865,000
国庫債券	利付（３０年）第４２回	1,600,000,000	1,995,216,000
国庫債券	利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,622,556,000
国庫債券	利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,748,866,000
国庫債券	利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	2,051,084,000
国庫債券	利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,172,834,000
国庫債券	利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	2,092,020,000
国庫債券	利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,254,616,000
国庫債券	利付（３０年）第４９回	2,900,000,000	3,442,329,000
国庫債券	利付（３０年）第５０回	1,600,000,000	1,677,056,000
国庫債券	利付（３０年）第５１回	2,650,000,000	2,464,341,000
国庫債券	利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	1,853,735,000
国庫債券	利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,696,192,000
国庫債券	利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,776,670,000
国庫債券	利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,566,435,000
国庫債券	利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	1,982,574,000
国庫債券	利付（３０年）第５７回	1,600,000,000	1,668,160,000
国庫債券	利付（３０年）第５８回	2,100,000,000	2,187,633,000

国庫債券 利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,626,112,000	
国庫債券 利付（３０年）第６０回	1,150,000,000	1,224,405,000	
国庫債券 利付（３０年）第６１回	1,000,000,000	1,012,970,000	
国庫債券 利付（３０年）第６２回	500,000,000	480,475,000	
国庫債券 利付（３０年）第６３回	1,400,000,000	1,306,872,000	
国庫債券 利付（３０年）第６４回	1,500,000,000	1,397,805,000	
国庫債券 利付（３０年）第６５回	1,200,000,000	1,116,300,000	
国庫債券 利付（３０年）第６６回	2,700,000,000	2,510,352,000	
国庫債券 利付（３０年）第６７回	1,300,000,000	1,274,559,000	
国庫債券 利付（３０年）第６８回	1,950,000,000	1,911,565,500	
国庫債券 利付（３０年）第６９回	500,000,000	503,100,000	
国庫債券 利付（２０年）第５５回	231,000,000	236,317,620	
国庫債券 利付（２０年）第５６回	120,000,000	123,400,800	
国庫債券 利付（２０年）第５７回	210,000,000	215,670,000	
国庫債券 利付（２０年）第５８回	180,000,000	185,783,400	
国庫債券 利付（２０年）第５９回	230,000,000	237,688,900	
国庫債券 利付（２０年）第６０回	780,000,000	801,777,600	
国庫債券 利付（２０年）第６１回	300,000,000	307,002,000	
国庫債券 利付（２０年）第６２回	440,000,000	449,411,600	
国庫債券 利付（２０年）第６３回	300,000,000	313,428,000	
国庫債券 利付（２０年）第６４回	400,000,000	420,884,000	
国庫債券 利付（２０年）第６５回	455,000,000	481,053,300	
国庫債券 利付（２０年）第６６回	300,000,000	316,326,000	
国庫債券 利付（２０年）第６７回	310,000,000	329,303,700	
国庫債券 利付（２０年）第６８回	290,000,000	310,746,600	
国庫債券 利付（２０年）第６９回	560,000,000	598,332,000	
国庫債券 利付（２０年）第７０回	540,000,000	585,316,800	
国庫債券 利付（２０年）第７１回	200,000,000	215,448,000	
国庫債券 利付（２０年）第７２回	1,470,000,000	1,586,585,700	
国庫債券 利付（２０年）第７３回	1,200,000,000	1,296,960,000	
国庫債券 利付（２０年）第７４回	800,000,000	867,712,000	
国庫債券 利付（２０年）第７５回	600,000,000	653,934,000	
国庫債券 利付（２０年）第７６回	910,000,000	984,347,000	
国庫債券 利付（２０年）第７７回	700,000,000	760,053,000	
国庫債券 利付（２０年）第７８回	800,000,000	869,224,000	
国庫債券 利付（２０年）第７９回	860,000,000	938,156,800	
国庫債券 利付（２０年）第８０回	1,400,000,000	1,533,322,000	
国庫債券 利付（２０年）第８１回	360,000,000	394,628,400	
国庫債券 利付（２０年）第８２回	820,000,000	902,647,800	
国庫債券 利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,514,891,200	
国庫債券 利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,321,092,000	
国庫債券 利付（２０年）第８５回	400,000,000	444,360,000	

国庫債券	利付（２０年）第８６回	1,400,000,000	1,569,526,000
国庫債券	利付（２０年）第８７回	500,000,000	557,995,000
国庫債券	利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,239,513,000
国庫債券	利付（２０年）第８９回	470,000,000	527,090,900
国庫債券	利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,690,380,000
国庫債券	利付（２０年）第９１回	250,000,000	283,132,500
国庫債券	利付（２０年）第９２回	650,000,000	732,179,500
国庫債券	利付（２０年）第９３回	300,000,000	337,605,000
国庫債券	利付（２０年）第９４回	200,000,000	226,290,000
国庫債券	利付（２０年）第９５回	100,000,000	114,926,000
国庫債券	利付（２０年）第９６回	400,000,000	454,620,000
国庫債券	利付（２０年）第９７回	300,000,000	344,358,000
国庫債券	利付（２０年）第９８回	300,000,000	342,378,000
国庫債券	利付（２０年）第９９回	1,100,000,000	1,260,853,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１００回	820,000,000	949,724,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０１回	250,000,000	293,097,500
国庫債券 回	利付（２０年）第１０２回	500,000,000	588,840,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０３回	600,000,000	702,204,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０４回	400,000,000	462,260,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,204,247,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０６回	400,000,000	467,088,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０７回	300,000,000	349,347,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,838,112,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,037,313,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,285,592,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１１回	800,000,000	944,664,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,110,518,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,353,420,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１４回	1,700,000,000	2,007,343,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,189,590,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,313,158,000
国庫債券 回	利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,658,650,000

国庫債券 利付（２０年）第１１８回	500,000,000	589,735,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１９回	800,000,000	928,736,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２０回	800,000,000	913,896,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２１回	1,200,000,000	1,408,380,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２２回	900,000,000	1,047,717,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２３回	500,000,000	598,245,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,186,730,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２５回	900,000,000	1,089,144,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２６回	800,000,000	952,152,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２７回	900,000,000	1,062,180,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２８回	1,800,000,000	2,129,130,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２９回	2,900,000,000	3,400,656,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３０回	1,400,000,000	1,645,798,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３１回	800,000,000	932,096,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,518,023,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３３回	1,400,000,000	1,649,746,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,653,540,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３５回	700,000,000	819,133,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３６回	700,000,000	811,496,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,172,700,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３８回	800,000,000	920,328,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３９回	1,000,000,000	1,161,560,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４０回	2,300,000,000	2,702,822,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	3,061,422,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,129,616,500	
国庫債券 利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,518,231,000	
	1,300,000,000	1,502,865,000	

国庫債券 利付（２０年）第１４４回			
国庫債券 利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,718,462,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,841,864,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４７回	4,000,000,000	4,694,760,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,441,733,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４９回	3,850,000,000	4,482,439,500	
国庫債券 利付（２０年）第１５０回	3,330,000,000	3,838,124,700	
国庫債券 利付（２０年）第１５１回	2,500,000,000	2,815,650,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５２回	2,650,000,000	2,986,285,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５３回	1,600,000,000	1,826,112,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５４回	1,220,000,000	1,376,294,200	
国庫債券 利付（２０年）第１５５回	5,350,000,000	5,881,790,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５６回	3,450,000,000	3,489,675,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５７回	2,990,000,000	2,931,126,900	
国庫債券 利付（２０年）第１５８回	2,100,000,000	2,149,707,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５９回	2,000,000,000	2,076,560,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６０回	2,300,000,000	2,420,681,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６１回	2,100,000,000	2,174,382,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,758,344,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６３回	2,600,000,000	2,686,242,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,641,548,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,232,032,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６６回	2,300,000,000	2,407,410,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６７回	2,600,000,000	2,627,950,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６８回	2,700,000,000	2,677,428,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６９回	2,530,000,000	2,459,463,600	
	2,000,000,000	1,941,880,000	

		国庫債券 利付（２０年）第１７０回			
		国庫債券 利付（２０年）第１７１回	1,300,000,000	1,260,662,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７２回	3,840,000,000	3,789,580,800	
		国庫債券 利付（２０年）第１７３回	3,250,000,000	3,203,980,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７４回	3,340,000,000	3,289,198,600	
		国庫債券 利付（２０年）第１７５回	2,000,000,000	2,005,420,000	
		メキシコ合衆国 第２５回円貨社債（２０１８）	100,000,000	99,621,000	
		銘柄数：266	539,266,000,000	577,173,063,270	
		組入時価比率：79.5%		80.3%	
	小計				
合計				577,173,063,270	
地方債証券	日本円	東京都 公募第７０７回	100,000,000	100,920,000	
		東京都 公募第７０８回	100,000,000	101,166,000	
		東京都 公募第７１０回	100,000,000	101,060,000	
		東京都 公募第７１２回	100,000,000	101,197,000	
		東京都 公募第７１５回	100,000,000	101,367,000	
		東京都 公募第７１６回	200,000,000	202,770,000	
		東京都 公募第７３１回	100,000,000	101,908,000	
		東京都 公募第７３６回	100,000,000	101,756,000	
		東京都 公募第７４５回	300,000,000	306,729,000	
		東京都 公募第７６０回	100,000,000	99,833,000	
		東京都 公募第７６１回	100,000,000	100,000,000	
		東京都 公募第７６９回	500,000,000	503,300,000	
		東京都 公募第７７８回	100,000,000	100,322,000	
		東京都 公募（３０年）第７回	100,000,000	133,764,000	
		東京都 公募第１０回	200,000,000	262,660,000	
		東京都 公募第１回	300,000,000	310,674,000	
		東京都 公募（２０年）第３回	200,000,000	213,818,000	
		東京都 公募第７回	100,000,000	109,848,000	
		東京都 公募（２０年）第１３回	100,000,000	113,838,000	
		東京都 公募（２０年）第１６回	200,000,000	228,892,000	
		東京都 公募（２０年）第１７回	200,000,000	230,132,000	
		東京都 公募第２３回	100,000,000	118,860,000	
		東京都 公募（２０年）第２６回	100,000,000	116,411,000	
		東京都 公募（２０年）第２９回	200,000,000	230,798,000	
		北海道 公募平成２４年度第６回	100,000,000	101,239,000	
		北海道 公募平成２４年度第９回	100,000,000	101,290,000	
		北海道 公募平成２５年度第１回	300,000,000	303,600,000	
		北海道 公募平成２６年度第１３回	100,000,000	101,658,000	

北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	102,271,000	
北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	200,756,000	
北海道	公募平成29年度第6回	700,000,000	699,790,000	
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	100,583,000	
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,530,000	
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	100,167,000	
神奈川県	公募第188回	200,000,000	202,228,000	
神奈川県	公募第196回	100,000,000	101,380,000	
神奈川県	公募第200回	100,000,000	102,095,000	
神奈川県	公募第205回	100,000,000	101,997,000	
神奈川県	公募第206回	100,000,000	102,132,000	
神奈川県	公募第210回	200,000,000	203,342,000	
神奈川県	公募第212回	100,000,000	101,651,000	
神奈川県	公募第231回	200,000,000	201,424,000	
神奈川県	公募第247回	200,000,000	198,624,000	
神奈川県	公募（30年）第3回	100,000,000	133,832,000	
神奈川県	公募第7回	300,000,000	338,529,000	
神奈川県	公募（20年）第14回	100,000,000	116,557,000	
神奈川県	公募（20年）第17回	200,000,000	235,782,000	
神奈川県	公募（20年）第26回	100,000,000	114,719,000	
大阪府	公募第378回	104,000,000	105,932,320	
大阪府	公募第381回	100,000,000	101,973,000	
大阪府	公募第382回	100,000,000	101,997,000	
大阪府	公募第383回	100,000,000	102,116,000	
大阪府	公募第384回	100,000,000	102,095,000	
大阪府	公募第387回	300,000,000	305,184,000	
大阪府	公募第389回	100,000,000	101,845,000	
大阪府	公募第396回	200,000,000	204,470,000	
大阪府	公募第417回	102,000,000	102,841,500	
大阪府	公募第423回	100,000,000	100,421,000	
大阪府	公募第429回	179,000,000	179,843,090	
大阪府	公募第452回	100,000,000	98,787,000	
大阪府	公募第5回	100,000,000	117,998,000	
大阪府	公募第8回	100,000,000	116,735,000	
大阪府	公募（5年）第137回	1,024,000,000	1,023,641,600	
大阪府	公募（5年）第141回	230,000,000	229,896,500	
大阪府	公募（5年）第178回	400,000,000	399,436,000	
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,193,000	
京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	101,311,000	
京都府	公募平成25年度第15回	200,000,000	203,970,000	
京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	114,509,000	
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	203,932,000	

京都府 公募（２０年）平成２７年度第５回	200,000,000	223,654,000	
京都府 公募（１５年）平成２７年度第８回	100,000,000	105,736,000	
京都府 公募（２０年）平成２８年度第５回	100,000,000	98,507,000	
京都府 公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,535,000	
兵庫県 公募平成２６年度第１７回	100,000,000	101,727,000	
兵庫県 公募平成２９年度第２２回	100,000,000	100,379,000	
兵庫県 公募（３０年）第２回	200,000,000	265,870,000	
兵庫県 公募（１５年）第１回	300,000,000	325,587,000	
兵庫県 公募（１５年）第３回	200,000,000	215,702,000	
兵庫県 公募（１２年）第３回	300,000,000	306,597,000	
兵庫県 公募（１５年）第１１回	100,000,000	104,784,000	
兵庫県 公募第２回	100,000,000	114,720,000	
兵庫県 公募第９回	100,000,000	117,880,000	
兵庫県 公募（２０年）第１１回	200,000,000	231,188,000	
兵庫県 公募（２０年）第１４回	100,000,000	116,033,000	
兵庫県 公募（２０年）第２２回	100,000,000	113,730,000	
静岡県 公募平成２４年度第５回	100,060,000	101,240,708	
静岡県 公募平成２４年度第１０回	100,000,000	101,383,000	
静岡県 公募平成２５年度第５回	101,000,000	103,235,130	
静岡県 公募平成２６年度第３回	165,000,000	168,582,150	
静岡県 公募平成２６年度第８回	100,000,000	101,975,000	
静岡県 公募平成２６年度第９回	200,000,000	203,964,000	
静岡県 公募平成２７年度第１１回	115,400,000	115,604,258	
静岡県 公募平成２８年度第２回	300,000,000	300,075,000	
静岡県 公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,422,000	
静岡県 公募（３１年）第１回	174,000,000	173,166,540	
静岡県 公募（１５年）第５回	200,000,000	214,442,000	
静岡県 公募（１５年）第９回	100,000,000	105,316,000	
静岡県 公募（２０年）第１１回	100,000,000	115,882,000	
静岡県 公募（２０年）第１４回	200,000,000	232,734,000	
静岡県 公募（２０年）第１８回	100,000,000	114,726,000	
静岡県 公募（２０年）第３０回	200,000,000	196,758,000	
愛知県 公募平成２０年度第８回	100,000,000	114,679,000	
愛知県 公募平成２３年度第１９回	100,000,000	101,018,000	
愛知県 公募平成２４年度第２回	100,000,000	101,147,000	
愛知県 公募（２０年）平成２４年度第４回	100,000,000	115,802,000	
愛知県 公募平成２４年度第８回	150,000,000	151,876,500	
愛知県 公募（１５年）平成２４年度第１４回	400,000,000	432,432,000	
愛知県 公募平成２４年度第１７回	100,000,000	118,079,000	
	120,000,000	154,852,800	

愛知県 公募（３０年）平成２５年度第８回			
愛知県 公募平成２６年度第８回	100,000,000	125,118,000	
愛知県 公募平成２６年度第１３回	100,000,000	113,423,000	
愛知県 公募平成２６年度第１７回	300,000,000	305,400,000	
愛知県 公募（１５年）平成２７年度第２回	100,000,000	105,058,000	
愛知県 公募平成２７年度第１５回	100,000,000	102,180,000	
愛知県 公募平成２９年度第８回	100,000,000	100,583,000	
愛知県 公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,261,000	
広島県 公募平成２４年度第４回	100,000,000	101,411,000	
広島県 公募平成２５年度第３回	200,000,000	204,082,000	
広島県 公募平成２６年度第５回	109,650,000	111,009,660	
広島県 公募平成２６年度第７回	200,000,000	203,642,000	
広島県 公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,229,000	
広島県 公募平成２９年度第４回	211,300,000	212,787,552	
広島県 公募令和２年度第２回	100,000,000	99,722,000	
埼玉県 公募平成２４年度第４回	300,000,000	303,537,000	
埼玉県 公募平成２５年度第４回	100,000,000	102,198,000	
埼玉県 公募平成２５年度第６回	148,000,000	151,050,280	
埼玉県 公募平成２５年度第１０回	100,000,000	101,978,000	
埼玉県 公募平成２５年度第１１回	100,000,000	101,982,000	
埼玉県 公募平成２６年度第３回	100,000,000	102,129,000	
埼玉県 公募平成２６年度第６回	200,000,000	203,882,000	
埼玉県 公募平成２６年度第７回	400,000,000	407,092,000	
埼玉県 公募平成２６年度第９回	100,000,000	101,662,000	
埼玉県 公募平成２７年度第９回	100,000,000	101,103,000	
埼玉県 公募平成２８年度第５回	100,000,000	99,864,000	
埼玉県 公募平成３０年度第４回	200,000,000	201,018,000	
埼玉県 公募平成３０年度第７回	200,000,000	200,028,000	
埼玉県 公募（１５年）第１回	100,000,000	106,583,000	
埼玉県 公募（１５年）第２回	200,000,000	212,444,000	
埼玉県 公募（１５年）第３回	100,000,000	101,865,000	
埼玉県 公募（２０年）第６回	100,000,000	115,960,000	
埼玉県 公募（２０年）第１６回	100,000,000	111,628,000	
埼玉県 公募（２０年）第２０回	100,000,000	102,742,000	
福岡県 公募平成２６年度第１回	100,000,000	102,143,000	
福岡県 公募平成２７年度第１回	300,000,000	307,347,000	
福岡県 公募平成２９年度第１回	100,000,000	100,598,000	
福岡県 公募平成２３年度第１回	100,000,000	108,137,000	
福岡県 公募（１５年）平成２７年度第１回	200,000,000	211,592,000	
福岡県 公募（１５年）令和元年度第１回	100,000,000	98,843,000	

福岡県 公募（３０年）平成１９年度第１回	100,000,000	134,405,000	
福岡県 公募（３０年）平成２６年度第１回	100,000,000	125,384,000	
福岡県 公募（３０年・定時償還）平成２９年度第２回	100,000,000	105,223,000	
福岡県 公募（２０年）平成２０年度第２回	100,000,000	114,756,000	
福岡県 公募（２０年）平成２４年度第２回	100,000,000	115,337,000	
千葉県 公募平成２４年度第１回	100,000,000	101,222,000	
千葉県 公募平成２４年度第２回	100,000,000	101,123,000	
千葉県 公募平成２４年度第７回	100,000,000	101,334,000	
千葉県 公募平成２４年度第８回	100,000,000	101,595,000	
千葉県 公募平成２５年度第３回	100,000,000	102,049,000	
千葉県 公募平成２５年度第４回	100,000,000	102,199,000	
千葉県 公募平成２６年度第３回	200,000,000	204,090,000	
千葉県 公募平成２７年度第６回	200,000,000	204,398,000	
千葉県 公募平成２８年度第４回	200,000,000	200,110,000	
千葉県 公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,229,000	
千葉県 公募平成２９年度第８回	100,000,000	100,534,000	
千葉県 公募（２０年）第１回	400,000,000	439,500,000	
千葉県 公募（２０年）第８回	100,000,000	118,134,000	
千葉県 公募（２０年）第１６回	200,000,000	231,328,000	
千葉県 公募（２０年）第１７回	100,000,000	113,937,000	
群馬県 公募第１２回	100,000,000	102,273,000	
群馬県 公募（２０年）第３回	100,000,000	115,853,000	
岐阜県 公募平成２６年度第１回	186,670,000	190,302,598	
共同発行市場地方債 公募第１０８回	200,000,000	202,180,000	
共同発行市場地方債 公募第１１０回	200,000,000	202,208,000	
共同発行市場地方債 公募第１１１回	200,000,000	202,352,000	
共同発行市場地方債 公募第１１２回	100,000,000	101,179,000	
共同発行市場地方債 公募第１１３回	800,000,000	809,144,000	
共同発行市場地方債 公募第１１４回	243,700,000	246,821,797	
共同発行市場地方債 公募第１１５回	100,000,000	101,320,000	
共同発行市場地方債 公募第１１６回	200,000,000	202,772,000	
共同発行市場地方債 公募第１１８回	100,000,000	101,595,000	
共同発行市場地方債 公募第１１９回	200,000,000	203,164,000	
	300,000,000	304,173,000	

共同発行市場地方債 公募第 1 2 0 回			
共同発行市場地方債 公募第 1 2 1 回	100,000,000	101,209,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 2 回	400,000,000	405,472,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 4 回	300,000,000	306,522,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 6 回	100,000,000	102,067,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 8 回	700,000,000	712,474,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 2 9 回	100,000,000	101,979,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 0 回	100,000,000	102,185,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 2 回	100,000,000	101,996,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 6 回	200,000,000	204,090,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 7 回	200,000,000	203,866,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 9 回	155,000,000	158,016,300	
共同発行市場地方債 公募第 1 4 3 回	540,000,000	549,390,600	
共同発行市場地方債 公募第 1 4 5 回	1,000,000,000	1,016,330,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 4 回	300,000,000	305,760,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 6 回	200,000,000	200,252,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 7 回	300,000,000	300,075,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 6 1 回	300,000,000	299,751,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 7 2 回	600,000,000	604,398,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 4 回	100,000,000	100,294,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 6 回	400,000,000	403,156,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 8 回	300,000,000	302,622,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 0 回	610,000,000	610,237,900	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 1 回	100,000,000	99,921,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 0 0 回	100,000,000	99,051,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 1 3 回	300,000,000	298,260,000	
堺市 公募平成 2 2 年度第 1 回	100,000,000	117,149,000	

堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	121,976,000	
島根県 公募（30年）平成29年度第1回	100,000,000	104,998,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,028,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	203,622,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	101,763,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	144,571,620	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,379,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	101,763,000	
熊本市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,504,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	237,884,988	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,611,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,256,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	101,873,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,082,000	
大阪市 公募（15年）第1回	100,000,000	109,037,000	
大阪市 公募（20年）第1回	300,000,000	343,947,000	
大阪市 公募（20年）第5回	100,000,000	117,537,000	
大阪市 公募（20年）第6回	100,000,000	115,996,000	
大阪市 公募（20年）第17回	100,000,000	116,648,000	
大阪市 公募（20年）第26回	100,000,000	102,712,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	101,128,000	
名古屋市 公募第481回	100,000,000	101,338,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	306,267,000	
名古屋市 公募第489回	100,000,000	101,709,000	
名古屋市 公募第501回	200,000,000	200,786,000	
名古屋市 公募第503回	100,000,000	100,569,000	
名古屋市 公募第504回	200,000,000	201,088,000	
名古屋市 公募第512回	300,000,000	298,761,000	
名古屋市 公募（12年）第1回	200,000,000	208,818,000	
名古屋市 公募（15年）第2回	100,000,000	106,284,000	
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,646,000	
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	102,050,740	
京都市 公募（20年）第2回	100,000,000	109,665,000	
京都市 公募（20年）第5回	200,000,000	226,524,000	
京都市 公募（20年）第6回	100,000,000	114,860,000	
京都市 公募（20年）第13回	100,000,000	113,321,000	
京都市 公募（20年）第15回	200,000,000	201,538,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	303,129,000	
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	200,050,000	
神戸市 公募平成30年度第2回	200,000,000	205,880,000	
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	202,656,000	
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	202,914,000	

横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	203,512,000
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	203,478,000
横浜市 公募平成28年度第5回	300,000,000	302,778,000
横浜市 公募平成29年度第3回	100,000,000	100,707,000
横浜市 公募（30年）第2回	200,000,000	257,944,000
横浜市 公募（20年）第18回	100,000,000	116,810,000
横浜市 公募（20年）第26回	100,000,000	117,355,000
横浜市 公募（20年）第30回	100,000,000	113,528,000
札幌市 公募（15年）平成23年度第9回	200,000,000	216,890,000
札幌市 公募（20年）平成24年度第1回	100,000,000	116,804,000
札幌市 公募（20年）平成24年度第11回	100,000,000	117,682,000
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	101,753,000
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	203,180,000
川崎市 公募第85回	100,000,000	101,294,000
川崎市 公募（20年）第17回	100,000,000	114,662,000
川崎市 公募（20年）第19回	100,000,000	113,343,000
川崎市 公募（30年）第11回	100,000,000	102,305,000
北九州市 公募（10年）令和2年度第2回	200,000,000	198,648,000
北九州市 公募（20年）第3回	200,000,000	228,964,000
北九州市 公募（20年）第14回	100,000,000	116,558,000
福岡市 公募（20年）平成21年度第3回	200,000,000	233,512,000
福岡市 公募（20年）平成23年度第4回	100,000,000	117,138,000
福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	114,885,000
福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	101,932,000
福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	162,945,600
広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	101,696,000
広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	510,875,000
広島市 公募（10年）平成30年度第6回	241,000,000	240,922,880
千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	101,222,000
千葉市 公募平成26年度第2回	200,000,000	203,694,000
三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	142,519,525
三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	155,812,200
福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	100,971,000
福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	200,102,000
山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	202,652,000
岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	169,925,223
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	115,659,000
	300,000,000	351,735,000

	小計	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回			
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	115,002,000	
		福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	104,618,000	
		銘柄数：291 組入時価比率：7.1%	49,410,820,000	51,647,590,559 7.2%	
		合計		51,647,590,559	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券（2014）	100,000,000	101,891,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	152,890,520	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	194,963,250	
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,533,520	
		新関西国際空港社債 財投機関債第6回	300,000,000	328,959,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第9回	100,000,000	108,244,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	107,227,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,028,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	105,246,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	303,690,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	107,115,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第78回	200,000,000	201,650,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第82回	100,000,000	101,080,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	302,574,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	200,000,000	200,658,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	103,357,620	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	161,195,790	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,500,615,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	301,524,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第55回	300,000,000	299,640,000	
		道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	308,454,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第4回	100,000,000	130,661,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8回	200,000,000	224,146,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回	100,000,000	112,642,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	300,000,000	343,794,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回	200,000,000	304,302,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	200,000,000	233,124,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	100,000,000	117,945,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第84回	400,000,000	404,332,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	202,000,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回	100,000,000	115,646,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第100回	200,000,000	202,860,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第102回	100,000,000	101,355,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	350,000,000	405,975,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	117,958,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第107回	100,000,000	102,146,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第116回	400,000,000	407,316,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第122回	100,000,000	102,089,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	102,046,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	200,000,000	203,570,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第134回	200,000,000	203,364,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	203,998,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	300,000,000	351,219,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	100,000,000	118,867,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	100,000,000	105,873,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	100,000,000	110,018,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	91,814,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回	100,000,000	101,825,000	
	200,000,000	233,782,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	234,288,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	236,412,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	235,576,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	232,594,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	128,927,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	141,323,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第163回	1,000,000,000	1,011,770,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	124,629,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	101,237,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	115,651,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	220,740,260	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	114,872,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	379,077,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	202,706,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	202,754,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	202,800,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	900,000,000	914,994,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	117,127,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	198,320,640	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	405,516,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	1,000,000,000	1,020,820,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	277,720,160	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	305,940,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	139,716,710	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	147,882,600	
	100,000,000	115,086,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 6回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 7回	100,000,000	123,144,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 9回	100,000,000	115,117,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 0回	100,000,000	102,148,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 4回	100,000,000	123,217,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 5回	190,000,000	193,693,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 9回	630,000,000	642,442,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 3 4回	100,000,000	101,777,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 3 9回	500,000,000	556,000,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 6 1回	401,000,000	408,218,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 7 1回	151,000,000	150,806,720	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 9 7回	100,000,000	100,116,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 0 6回	403,000,000	404,837,680	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 1 5回	100,000,000	100,348,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 2 1回	600,000,000	603,114,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 2 4回	100,000,000	100,065,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 5回	100,000,000	103,155,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 9回	500,000,000	503,865,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 4 2回	131,000,000	131,516,140	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 1回	100,000,000	100,328,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 4回	200,000,000	200,442,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 7回	100,000,000	100,777,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第1 3回	130,000,000	134,691,700	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第2 8回	400,000,000	523,428,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第3 3回	100,000,000	132,774,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第3 8回	1,000,000,000	1,080,070,000	
	100,000,000	132,972,000	

公営企業債券 30年第4回財投機 関債			
地方公営企業等金融機構債券（20 年）第1回	100,000,000	114,689,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第4回	100,000,000	116,859,000	
地方公共団体金融機構債券 F16 回	100,000,000	111,458,000	
地方公共団体金融機構債券 20年 第6回	300,000,000	355,080,000	
地方公共団体金融機構債券 F24 回	100,000,000	103,454,000	
地方公共団体金融機構債券（20 年）第10回	300,000,000	343,341,000	
地方公共団体金融機構債券 F10 4回	100,000,000	105,231,000	
地方公共団体金融機構債券 F10 6回	100,000,000	103,829,000	
地方公共団体金融機構債券 F12 2回	100,000,000	108,284,000	
地方公共団体金融機構債券 F12 4回	100,000,000	108,271,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第37回	604,000,000	611,320,480	
地方公共団体金融機構債券 第37 回	400,000,000	404,592,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	196,335,760	
地方公共団体金融機構債券 F13 2回	500,000,000	523,800,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	101,221,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	102,334,210	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	103,374,960	
地方公共団体金融機構債券 第41 回	600,000,000	608,076,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 2回	100,000,000	103,777,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 5回	200,000,000	208,468,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 7回	100,000,000	107,293,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第42回	108,000,000	109,547,640	
地方公共団体金融機構債券 第42 回	100,000,000	101,413,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回	202,000,000	204,777,500	
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回	145,000,000	147,378,000	
	100,000,000	101,524,000	

地方公共団体金融機構債券 第44回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	223,000,000	226,719,640	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	106,560,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第48回	500,000,000	506,770,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回	13,000,000	13,266,370	
地方公共団体金融機構債券（20年） 第29回	100,000,000	116,765,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	102,186,000	
地方公共団体金融機構債券 第51回	600,000,000	612,504,000	
地方公共団体金融機構債券 第52回	300,000,000	306,156,000	
地方公共団体金融機構債券（15年） 第2回	200,000,000	215,366,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回	591,000,000	603,877,890	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	118,423,240	
地方公共団体金融機構債券（20年） 第38回	100,000,000	114,443,000	
地方公共団体金融機構債券 F240回	300,000,000	323,112,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	101,923,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	102,014,000	
地方公共団体金融機構債券（20年） 第39回	100,000,000	113,665,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	407,808,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	320,000,000	325,228,800	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	193,054,050	
地方公共団体金融機構債券 第74回	300,000,000	306,663,000	
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,220,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	518,126,370	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	408,996,000	
政保 地方公共団体金融機構債券（8年） 第5回	500,000,000	502,545,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	115,850,360	
	200,000,000	201,352,000	

地方公共団体金融機構債券 第95回			
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	403,588,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回	157,000,000	157,568,340	
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	100,000,000	100,220,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	110,909,700	
公営企業債券（20年） 第2回財投機関債	100,000,000	102,652,000	
公営企業債券（20年） 第5回財投機関債	200,000,000	210,834,000	
公営企業債券（20年） 第19回財投機関債	100,000,000	113,287,000	
公営企業債券（20年） 第20回財投機関債	100,000,000	113,121,000	
公営企業債券（20年） 第24回財投機関債	100,000,000	115,287,000	
公営企業債券（20年） 第25回財投機関債	100,000,000	117,130,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	204,112,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,030,000	
都市再生債券 財投機関債第101回	100,000,000	106,367,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	106,431,000	
都市再生債券 財投機関債第113回	300,000,000	317,916,000	
都市再生債券 財投機関債第121回	200,000,000	204,832,000	
都市再生債券 財投機関債第127回	100,000,000	100,000,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	109,486,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	366,714,000	
東京交通債券 第342回	200,000,000	206,348,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	166,457,680	
関西国際空港債券 政府保証第54回	300,000,000	350,541,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	101,234,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	368,000,000	373,129,920	
預金保険機構債券 政府保証第231回	300,000,000	301,032,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	400,000,000	452,612,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回	200,000,000	229,752,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	105,521,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	107,759,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第49回	100,000,000	117,434,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	116,494,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	118,381,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	326,781,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	118,354,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第85回	200,000,000	232,920,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	217,580,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	117,406,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	100,000,000	116,857,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	131,849,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	213,422,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	108,453,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	107,776,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	255,415,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	301,305,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	100,944,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	131,194,700	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第301回	300,000,000	300,072,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	203,024,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	406,936,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第6回	200,000,000	217,352,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,297,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	300,777,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,294,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,316,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	301,056,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,440,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	200,106,000	

商工債券 利付第 8 3 3 回い号	100,000,000	99,889,000
しんきん中金債券 利付第 3 3 5 回	200,000,000	200,252,000
商工債券 利付（3 年）第 2 3 1 回	200,000,000	200,118,000
商工債券 利付（3 年）第 2 3 6 回	500,000,000	499,915,000
商工債券 利付（1 0 年）第 1 5 回	200,000,000	203,604,000
国際協力機構債券 第 6 回財投機関債	200,000,000	236,196,000
東日本高速道路 第 6 1 回	200,000,000	198,756,000
中日本高速道路 第 6 3 回	100,000,000	102,469,000
中日本高速道路 第 7 9 回	300,000,000	299,949,000
西日本高速道路 第 2 0 回	200,000,000	203,796,000
西日本高速道路 第 2 2 回	400,000,000	408,720,000
西日本高速道路 第 2 3 回	100,000,000	101,857,000
西日本高速道路 第 3 0 回	300,000,000	301,332,000
西日本高速道路 第 5 0 回	200,000,000	199,972,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 5 7 回	300,000,000	305,739,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 2 回	100,000,000	101,981,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 8 回	200,000,000	203,882,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 9 回	100,000,000	113,799,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 7 1 回	500,000,000	509,420,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 9 0 回	300,000,000	298,212,000
貸付債権担保第 1 2 回住宅金融公庫債券	28,797,000	28,845,954
貸付債権担保第 1 9 回住宅金融公庫債券	54,005,000	54,696,264
貸付債権担保第 5 回 S 種住宅金融公庫債券	32,400,000	32,736,960
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融公庫債券	36,042,000	37,129,026
貸付債権担保第 7 回 S 種住宅金融公庫債券	11,249,000	11,459,356
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	24,394,000	24,992,140
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	28,224,000	29,441,865
貸付債権担保第 1 5 回住宅金融公庫債券	31,149,000	31,374,518
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	50,432,000	51,629,255
貸付債権担保第 2 0 回住宅金融公庫債券	54,200,000	55,053,108
貸付債権担保第 4 4 回住宅金融公庫債券	48,532,000	49,903,029
	78,552,000	80,920,342

貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	13,501,000	13,981,095	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	20,889,000	22,394,052	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	67,302,000	71,614,039	
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	12,119,000	12,259,701	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	65,880,000	69,357,146	
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	24,358,000	24,662,231	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	81,672,000	86,628,673	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	65,270,000	68,885,958	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	37,068,000	39,502,626	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	81,081,000	86,135,589	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	82,446,000	86,179,979	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	126,039,000	131,918,719	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	122,076,000	128,541,144	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	78,842,000	82,697,373	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	29,958,000	31,677,888	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	65,416,000	69,376,284	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	40,667,000	42,306,693	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	88,694,000	92,374,801	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	39,612,000	41,217,078	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	22,524,000	22,874,473	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	118,914,000	124,625,439	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	25,315,000	26,997,688	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	27,509,000	29,372,184	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	25,606,000	27,223,274	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	28,586,000	30,418,362	
	80,040,000	84,569,463	

貸付債権担保第 5 5 回住宅金融支援 機構債券			
貸付債権担保第 5 6 回住宅金融支援 機構債券	113,403,000	119,625,422	
貸付債権担保第 5 7 回住宅金融支援 機構債券	37,903,000	40,014,955	
貸付債権担保第 7 6 回住宅金融支援 機構債券	77,356,000	80,892,716	
貸付債権担保 S 種第 3 回住宅金融公 庫債券	10,385,000	10,474,830	
貸付債権担保 S 種第 1 4 回住宅金融 支援機構債券	48,380,000	48,474,824	
貸付債権担保 S 種第 1 5 回住宅金融 支援機構債券	19,752,000	19,790,911	
貸付債権担保第 2 3 回住宅金融支援 機構債券	73,164,000	77,649,684	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融支援 機構債券	73,737,000	78,345,562	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援 機構債券	136,265,000	143,162,734	
貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援 機構債券	81,382,000	85,908,466	
貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援 機構債券	132,996,000	139,026,038	
貸付債権担保第 7 1 回住宅金融支援 機構債券	116,118,000	120,739,496	
貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援 機構債券	90,370,000	95,152,380	
貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援 機構債券	76,518,000	80,212,289	
貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援 機構債券	186,532,000	194,079,084	
貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援 機構債券	322,959,000	335,554,401	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援 機構債券	49,074,000	50,807,293	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援 機構債券	51,047,000	52,912,257	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援 機構債券	52,380,000	54,077,112	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援 機構債券	110,008,000	112,828,605	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援 機構債券	115,538,000	117,609,596	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援 機構債券	61,167,000	62,941,454	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援 機構債券	64,874,000	66,550,344	
貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援 機構債券	193,065,000	199,030,708	
貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援 機構債券	199,131,000	206,090,628	
	133,688,000	138,210,665	

貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	65,218,000	67,307,584	
貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	65,877,000	68,173,472	
貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券	244,176,000	245,479,899	
貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	163,864,000	165,566,546	
貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	164,812,000	166,272,234	
貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	82,528,000	83,321,094	
貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	164,834,000	166,301,022	
貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	83,101,000	83,518,998	
貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	83,472,000	84,044,617	
貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	84,822,000	85,551,469	
貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	339,520,000	341,489,216	
貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	256,239,000	257,858,430	
貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	171,090,000	172,054,947	
貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	173,808,000	175,214,106	
貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	177,664,000	178,198,768	
貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券	88,752,000	89,011,155	
貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券	89,503,000	90,136,681	
貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券	90,156,000	90,387,700	
貸付債権担保第 1 4 2 回住宅金融支援機構債券	274,947,000	274,353,114	
貸付債権担保第 1 4 4 回住宅金融支援機構債券	276,129,000	275,645,774	
貸付債権担保第 1 5 0 回住宅金融支援機構債券	473,305,000	467,540,145	
貸付債権担保第 1 5 2 回住宅金融支援機構債券	191,444,000	191,013,251	
貸付債権担保第 1 5 4 回住宅金融支援機構債券	193,134,000	192,172,192	
貸付債権担保第 1 6 4 回住宅金融支援機構債券	299,616,000	298,720,148	
貸付債権担保第 1 6 5 回住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,906,000	
	300,000,000	300,252,000	

	小計	貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券			
		銘柄数：320	59,953,563,000	62,722,661,305	
		組入時価比率：8.6%		8.7%	
	合計			62,722,661,305	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（BFCM）第29回円貨社債	200,000,000	199,032,000	
		フランス相互信用連合銀行（BFCM）第31回円貨社債	100,000,000	98,922,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	100,000,000	100,197,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債（2014）	100,000,000	102,198,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債（2018）	100,000,000	99,734,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債（2018）	100,000,000	99,464,000	
		スタンダード・チャータード 第3回円貨社債（2015）	100,000,000	100,615,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	100,774,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	100,727,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第6回円貨社債	100,000,000	100,409,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	99,491,000	
		サンタンデール銀行 第1回円貨社債	100,000,000	99,996,000	
		フランス電力 第4回円貨社債（2017）	100,000,000	102,371,000	
		現代キャピタル・サービスズ・インク 第15回円貨社債	200,000,000	195,900,000	
		ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債（2017）	100,000,000	100,868,000	
		ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社	200,000,000	199,858,000	
		オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債	200,000,000	200,292,000	
		ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債（2017）	100,000,000	99,893,000	
		長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,602,000	
		長谷工コーポレーション 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,888,000	
		大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,544,000	
		日揮ホールディングス 第6回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,684,000	
		味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,212,000	
		日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,000,000	

三越伊勢丹ホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,808,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,256,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	200,000,000	197,050,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,364,000	
セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,999,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,000,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,498,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,280,000	
王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,446,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,907,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,654,000	
三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,336,000	
三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,989,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,116,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,969,000	
オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,012,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,151,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,702,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,126,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,968,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	297,378,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,963,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,967,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,228,000	
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,526,000	
荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,804,000	
	200,000,000	215,288,000	

日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付			
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,661,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,186,000	
パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,928,000	
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,822,000	
ソニー 第32回	100,000,000	100,284,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,357,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,650,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,180,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	100,125,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	101,814,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,069,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,290,000	
ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,729,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,633,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,250,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,001,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,835,000	
住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,970,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,996,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,321,000	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,285,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,967,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	101,619,000	
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,010,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	203,422,000	
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,467,000	

東京三菱銀行 第57回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	103,633,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	303,465,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	101,446,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	105,081,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約 付	300,000,000	305,541,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,458,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,478,000	
セブン銀行 第12回社債間限定同 順位特約付	300,000,000	303,609,000	
みずほフィナンシャルグループ 第 1回劣後特約付	200,000,000	202,746,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	112,879,000	
芙蓉総合リース 第26回社債間限 定同順位特約付	200,000,000	199,148,000	
みずほリース 第3回社債間限定同 順位特約付	300,000,000	299,901,000	
N T Tファイナンス 第2回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,457,000	
N T Tファイナンス 第15回日本 電信電話保証付	100,000,000	99,957,000	
トヨタファイナンス 第81回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,771,000	
リコーリース 第28回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,751,000	
アコム 第77回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,845,000	
ジャックス 第19回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,102,000	
日立キャピタル 第61回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,308,000	
日立キャピタル 第80回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	98,848,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,771,000	
三菱U F Jリース 第52回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,408,000	
三菱U F Jリース 第76回社債間 限定同順位特約付	300,000,000	298,902,000	
大和証券グループ本社 第23回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	102,071,000	
三井不動産 第71回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	197,150,000	
三菱地所 第120回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	99,411,000	
東京建物 第25回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,086,000	

ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,925,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,297,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	101,941,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限	100,000,000	114,951,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,466,000	
東武鉄道 第124回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,629,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	202,512,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,215,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,581,000	
東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,512,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	213,636,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,953,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	232,760,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,305,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,270,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,284,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,047,000	
東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付	200,000,000	186,702,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,859,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	341,553,000	
西日本旅客鉄道 第65回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,444,000	
西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,784,000	
東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,116,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	234,874,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,148,000	
東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	300,000,000	320,298,000	
	100,000,000	118,927,000	

東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付			
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,125,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	101,135,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	104,558,000	
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,240,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,448,000	
阪急阪神ホールディングス 第47回	200,000,000	214,392,000	
阪急阪神ホールディングス 第49回	100,000,000	102,999,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,417,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,514,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,641,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,344,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,468,000	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,708,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,654,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	90,356,000	
澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,379,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,800,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,012,000	
東京電力 第548回	100,000,000	110,661,000	
東京電力 第560回	100,000,000	109,639,000	
中部電力 第500回	200,000,000	204,974,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,987,000	
中部電力 第530回	200,000,000	199,334,000	
関西電力 第509回	100,000,000	101,200,000	
関西電力 第511回	100,000,000	100,742,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,952,000	
関西電力 第535回	200,000,000	200,000,000	
中国電力 第377回	100,000,000	102,600,000	
中国電力 第378回	100,000,000	102,446,000	
中国電力 第400回	100,000,000	100,584,000	
中国電力 第402回	100,000,000	100,439,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	102,252,000	

北陸電力 第307回	100,000,000	104,551,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	102,289,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	101,137,000	
東北電力 第475回	100,000,000	102,432,000	
東北電力 第481回	200,000,000	205,628,000	
東北電力 第484回	100,000,000	102,353,000	
東北電力 第491回	100,000,000	101,128,000	
東北電力 第521回	100,000,000	100,852,000	
四国電力 第281回	200,000,000	205,324,000	
九州電力 第424回	100,000,000	103,137,000	
九州電力 第428回	105,000,000	107,891,700	
九州電力 第449回	200,000,000	202,126,000	
九州電力 第451回	100,000,000	101,233,000	
九州電力 第476回	100,000,000	100,723,000	
九州電力 第484回	200,000,000	200,340,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	102,796,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	108,460,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	102,719,000	
北海道電力 第345回	300,000,000	301,341,000	
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,438,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,505,000	
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,240,000	
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,915,000	
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,670,000	
東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,509,000	
東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	102,022,000	
東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	304,524,000	
東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,639,000	
東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	102,595,000	
東京電力パワーグリッド 第35回	100,000,000	104,020,000	
東京電力パワーグリッド 第38回	200,000,000	202,104,000	
東京電力パワーグリッド 第40回	400,000,000	421,284,000	
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	124,650,000	
東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,188,000	
大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,294,000	
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,213,000	
北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,978,000	

	小計	広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,305,000	
		東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,844,000	
		ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,011,000	
		ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,537,000	
		銘柄数：204 組入時価比率：3.7%	26,705,000,000	27,221,484,700 3.8%	
	合計			27,221,484,700	
合計				718,764,799,834	

(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)	
(2021年 2月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	3,984,911,522
コール・ローン	866,326,621
株式	855,020,069,055
投資証券	18,631,425,967
派生商品評価勘定	266,624,875
未収入金	250,840
未収配当金	785,569,415
差入委託証拠金	4,996,807,590
流動資産合計	884,551,985,885
資産合計	884,551,985,885
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,637,944
未払解約金	647,531,241
未払利息	795
その他未払費用	1,774,600
流動負債合計	652,944,580
負債合計	652,944,580
純資産の部	
元本等	
元本	245,379,120,410
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	638,519,920,895
元本等合計	883,899,041,305
純資産合計	883,899,041,305
負債純資産合計	884,551,985,885

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 2月18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	3.6022円
(10,000口当たり純資産額)	(36,022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19日
至 2021年 2月18日

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月18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

2021年 2月18日現在

期首	2020年 2月19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	219,212,456,718円
同期中における追加設定元本額	66,704,590,197円

同期中における一部解約元本額	40,537,926,505円
期末元本額	245,379,120,410円
期末元本額の内訳※	
バランスセレクト30	39,995,918円
バランスセレクト50	119,993,251円
バランスセレクト70	136,721,731円
野村外国株式インデックスファンド	480,614,463円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,986,497,764円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	5,091,133,789円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	4,085,629,699円
野村資産設計ファンド2015	12,789,317円
野村資産設計ファンド2020	12,894,813円
野村資産設計ファンド2025	23,741,597円
野村資産設計ファンド2030	32,153,816円
野村資産設計ファンド2035	25,948,010円
野村資産設計ファンド2040	50,972,088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）	46,923,776,820円
のむラップ・ファンド（保守型）	842,053,808円
のむラップ・ファンド（普通型）	7,401,513,965円
のむラップ・ファンド（積極型）	5,728,040,142円
野村資産設計ファンド2045	7,805,219円
野村インデックスファンド・外国株式	5,042,564,925円
マイ・ロード	1,126,712,839円
ネクストコア	26,409,082円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	128,464,706円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	1,858,272,755円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	941,490,456円
野村資産設計ファンド2050	12,626,164円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,273,468円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,205,703円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,612,203円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,240,970円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	178,056,516円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	473,502,633円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,210,275円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,832,044円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	18,221,313円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	7,356,555円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	29,563,986円
野村6資産均等バランス	944,463,645円
野村つみたて外国株投信	6,821,087,341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）	4,394,095,352円
世界6資産分散ファンド	45,503,339円
野村資産設計ファンド2060	5,719,970円
野村スリーゼロ先進国株式投信	137,910,091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	1,539,172,212円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,442,075,052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）	192,015,634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）	94,941,471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）	893,855,797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）	1,758,940,978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）	1,922,645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）	6,046,799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）	1,026,630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）	2,043,523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）	31,678,779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）	10,455,099円
野村世界インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	9,807,391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）	35,162,339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）	123,742,556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）	2,660,799,146円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	34,376,144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）	236,555,437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）	13,891,247,528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）	1,335,974円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	1,638,946円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	9,848,384円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	10,095,998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）	73,121,271,959円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	2,575,250,221円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	9,097,341,697円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	8,294,763,664円
マイバランスＤＣ３０	898,356,297円
マイバランスＤＣ５０	1,947,562,505円
マイバランスＤＣ７０	1,567,545,014円
野村ＤＣ外国株式インデックスファンド・ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ	25,844,191,615円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	517,223,021円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	41,113,648円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	338,251,050円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	282,927,779円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	248,168,915円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	13,935,310円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	6,829,673円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	32,964,562円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	5,129,139円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	4,342,845円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	3,779,687円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	130,186,890円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	95,243,394円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	51,129,030円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	62,212,108円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	1,943,384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(2021年2月18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	111,000	23.55	2,614,050.00	
		HALLIBURTON CO	150,000	20.55	3,082,500.00	
		SCHLUMBERGER LTD	234,000	26.87	6,287,580.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	64,000	18.58	1,189,120.00	
		CHENIERE ENERGY INC	36,400	69.29	2,522,156.00	
		CHEVRON CORP	322,000	95.92	30,886,240.00	
		CONOCOPHILLIPS	227,600	49.36	11,234,336.00	
		DEVON ENERGY CORP	100,000	21.73	2,173,000.00	
		EOG RESOURCES INC	98,100	63.54	6,233,274.00	
		EXXON MOBIL CORP	707,200	52.85	37,375,520.00	
		HESS CORP	47,300	61.82	2,924,086.00	
		KINDER MORGAN INC	344,000	15.13	5,204,720.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	106,000	51.89	5,500,340.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	158,000	26.73	4,223,340.00	
		ONEOK INC	74,000	45.99	3,403,260.00	
		PHILLIPS 66	71,100	80.64	5,733,504.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34,900	136.20	4,753,380.00	
		VALERO ENERGY CORP	69,400	68.12	4,727,528.00	
		WILLIAMS COS	206,000	23.09	4,756,540.00	
		AIR PRODUCTS	37,200	260.01	9,672,372.00	
		ALBEMARLE CORP	19,700	157.47	3,102,159.00	
		AXALTA COATING SYSTEMS LTD	36,000	27.03	973,080.00	
		CELANESE CORP-SERIES A	19,500	132.42	2,582,190.00	
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	45.06	1,590,618.00	
		CORTEVA INC	126,200	44.98	5,676,476.00	
		DOW INC	124,500	58.54	7,288,230.00	

DUPONT DE NEMOURS INC	91,989	69.99	6,438,310.11	
EASTMAN CHEMICAL CO.	23,000	110.25	2,535,750.00	
ECOLAB INC	43,000	208.79	8,977,970.00	
FMC CORP	21,200	106.75	2,263,100.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	37,178	137.67	5,118,295.26	
LINDE PLC	87,200	249.28	21,737,216.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	45,200	97.81	4,421,012.00	
MOSAIC CO/THE	56,000	30.43	1,704,080.00	
PPG INDUSTRIES	39,800	136.60	5,436,680.00	
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	86.00	1,814,600.00	
SHERWIN-WILLIAMS	13,720	721.40	9,897,608.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	10,500	325.30	3,415,650.00	
VULCAN MATERIALS CO	22,300	161.88	3,609,924.00	
AMCOR PLC	268,000	11.30	3,028,400.00	
AVERY DENNISON CORP	13,400	175.48	2,351,432.00	
BALL CORP	55,100	89.86	4,951,286.00	
CROWN HOLDINGS INC	22,800	98.99	2,256,972.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	60,100	48.50	2,914,850.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	16,100	133.42	2,148,062.00	
SEALED AIR CORP	26,500	43.41	1,150,365.00	
WESTROCK CO	43,200	44.00	1,900,800.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	244,000	34.15	8,332,600.00	
NEWMONT CORP	135,400	56.99	7,716,446.00	
NUCOR CORP	50,900	57.00	2,901,300.00	
STEEL DYNAMICS	33,400	40.71	1,359,714.00	
BOEING CO	89,400	215.52	19,267,488.00	
GENERAL DYNAMICS	41,000	164.49	6,744,090.00	
HEICO CORP	6,300	128.34	808,542.00	
HEICO CORP-CLASS A	12,300	117.66	1,447,218.00	
HOWMET AEROSPACE INC	66,000	28.64	1,890,240.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	178.42	1,159,730.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	36,300	188.46	6,841,098.00	
LOCKHEED MARTIN	42,000	337.00	14,154,000.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	26,700	297.18	7,934,706.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	253,700	73.06	18,535,322.00	

TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,810	403.24	2,342,824.40	
TEXTRON INC	37,900	50.78	1,924,562.00	
TRANSDIGM GROUP INC	8,680	570.37	4,950,811.60	
ALLEGION PLC	14,800	109.30	1,617,640.00	
CARRIER GLOBAL CORP	139,000	37.24	5,176,360.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	23,400	85.74	2,006,316.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	125,100	55.20	6,905,520.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	293.60	1,673,520.00	
MASCO CORP	42,500	54.22	2,304,350.00	
OWENS CORNING INC	16,800	83.49	1,402,632.00	
SMITH (A.O.) CORP	21,800	59.26	1,291,868.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	40,300	151.30	6,097,390.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	21,300	112.81	2,402,853.00	
AMETEK INC	37,300	120.21	4,483,833.00	
EATON CORP PLC	67,400	125.03	8,427,022.00	
EMERSON ELEC	100,700	84.87	8,546,409.00	
GENERAC HOLDINGS INC	10,200	355.32	3,624,264.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	19,600	248.10	4,862,760.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	58.57	1,434,965.00	
SUNRUN INC	18,500	74.20	1,372,700.00	
3M CORP	95,600	176.65	16,887,740.00	
GENERAL ELEC CO	1,453,000	11.86	17,232,580.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	116,500	201.90	23,521,350.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	35,400	51.64	1,828,056.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	40,300	24.35	981,305.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	17,590	387.12	6,809,440.80	
CATERPILLAR INC DEL	89,900	202.30	18,186,770.00	
CUMMINS INC	24,900	241.81	6,021,069.00	
DEERE & COMPANY	49,400	312.08	15,416,752.00	
DOVER CORP	24,300	120.63	2,931,309.00	
FORTIVE CORP	51,800	67.60	3,501,680.00	
IDEX CORP	12,300	193.50	2,380,050.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	52,900	198.24	10,486,896.00	
INGERSOLL-RAND INC	58,000	42.99	2,493,420.00	

NORDSON CORP	8,700	183.76	1,598,712.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	69,600	62.69	4,363,224.00	
PACCAR	58,300	96.04	5,599,423.50	
PARKER HANNIFIN CORP	21,600	272.01	5,875,416.00	
PENTAIR PLC	27,500	54.88	1,509,200.00	
SNAP-ON INC	8,400	188.87	1,586,508.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	25,900	170.47	4,415,173.00	
WABTEC CORP	28,800	79.35	2,285,280.00	
XYLEM INC	30,300	98.19	2,975,157.00	
FASTENAL CO	96,900	46.95	4,549,455.00	
GRAINGER(W.W.) INC	7,440	372.18	2,769,019.20	
UNITED RENTALS INC	12,200	277.81	3,389,282.00	
CINTAS CORP	14,300	339.11	4,849,273.00	
COPART INC	35,800	117.99	4,224,042.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	36,100	90.08	3,251,888.00	
ROLLINS INC	35,850	36.60	1,312,110.00	
WASTE CONNECTIONS INC	44,500	98.24	4,371,680.00	
WASTE MANAGEMENT INC	71,200	112.21	7,989,352.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	22,000	89.95	1,978,900.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	27,100	94.42	2,558,782.00	
FEDEX CORPORATION	41,700	259.09	10,804,053.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	117,400	161.00	18,901,400.00	
XPO LOGISTICS INC	14,300	119.00	1,701,700.00	
DELTA AIR LINES INC	25,200	44.39	1,118,628.00	
SOUTHWEST AIRLINES	24,900	52.44	1,305,756.00	
AMERCO	1,720	504.23	867,275.60	
CSX CORP	127,900	89.99	11,509,721.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	143.82	1,898,424.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	16,100	209.85	3,378,585.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,800	42.93	892,944.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	42,700	253.03	10,804,381.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,300	207.99	3,182,247.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	161,500	60.81	9,820,815.00	
UNION PAC CORP	112,700	211.23	23,805,621.00	

APTIV PLC	45,400	156.57	7,108,278.00	
AUTOLIV INC	14,000	91.67	1,283,380.00	
BORGWARNER INC	40,400	44.57	1,800,628.00	
LEAR CORP	9,700	163.25	1,583,525.00	
FORD MOTOR COMPANY	656,000	11.48	7,530,880.00	
GENERAL MOTORS CO	215,300	52.89	11,387,217.00	
TESLA INC	124,450	798.15	99,329,767.50	
DR HORTON INC	56,100	78.39	4,397,679.00	
GARMIN LTD	24,200	129.51	3,134,142.00	
LENNAR CORP-A	46,500	87.25	4,057,125.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	168.45	1,718,190.00	
NEWELL BRANDS INC	66,000	24.08	1,589,280.00	
NVR INC	559	4,704.40	2,629,759.60	
PULTEGROUP INC	43,000	46.17	1,985,310.00	
WHIRLPOOL CORP	10,300	193.97	1,997,891.00	
HASBRO INC	21,400	90.88	1,944,832.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	33,000	139.23	4,594,590.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	20,800	337.52	7,020,416.00	
NIKE INC-B	208,300	143.99	29,993,117.00	
V F CORP	56,300	79.52	4,476,976.00	
ARAMARK	39,000	37.05	1,444,950.00	
CARNIVAL CORP	85,000	23.20	1,972,000.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,460	1,459.50	6,509,370.00	
DARDEN RESTAURANTS INC	22,000	128.27	2,821,940.00	
DOMINOS PIZZA INC	6,310	376.49	2,375,651.90	
DRAFTKINGS INC - CL A	27,700	58.86	1,630,422.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	46,800	111.43	5,214,924.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	58,600	57.99	3,398,214.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	46,400	131.34	6,094,176.00	
MCDONALD'S CORP	123,600	213.45	26,382,420.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	18.59	632,060.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	80,000	34.96	2,796,800.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	29,300	75.11	2,200,723.00	
STARBUCKS CORP	194,900	104.44	20,355,356.00	
VAIL RESORTS INC	6,700	296.32	1,985,344.00	

WYNN RESORTS LTD	15,500	122.17	1,893,635.00	
YUM BRANDS INC	50,800	104.34	5,300,472.00	
GENUINE PARTS CO	23,200	98.94	2,295,408.00	
LKQ CORP	49,000	36.78	1,802,220.00	
POOL CORP	6,500	330.17	2,146,105.00	
AMAZON.COM INC	71,040	3,308.64	235,045,785.60	
BOOKING HOLDINGS INC	6,840	2,233.77	15,278,986.80	
CHEWY INC - CLASS A	12,300	110.49	1,359,027.00	
EBAY INC	117,600	63.05	7,414,680.00	
ETSY INC	19,400	222.41	4,314,754.00	
EXPEDIA GROUP INC	22,300	154.04	3,435,092.00	
MERCADOLIBRE INC	7,430	1,890.25	14,044,557.50	
WAYFAIR INC - CLASS A	10,400	273.26	2,841,904.00	
DOLLAR GENERAL CORP	41,800	201.50	8,422,700.00	
DOLLAR TREE INC	40,400	108.32	4,376,128.00	
TARGET CORP	83,600	193.60	16,184,960.00	
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	161.82	1,763,838.00	
AUTOZONE	3,950	1,192.97	4,712,231.50	
BEST BUY COMPANY INC	39,300	118.34	4,650,762.00	
BURLINGTON STORES INC	11,400	264.79	3,018,606.00	
CARMAX INC	27,900	122.51	3,418,029.00	
CARVANA CO	10,200	295.61	3,015,222.00	
HOME DEPOT	179,600	280.92	50,453,232.00	
LOWES COS INC	125,500	177.13	22,229,815.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	12,540	447.46	5,611,148.40	
ROSS STORES INC	59,800	119.47	7,144,306.00	
TJX COS INC	200,300	66.83	13,386,049.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	19,500	170.25	3,319,875.00	
ULTA BEAUTY INC	8,600	324.55	2,791,130.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	73,310	358.04	26,247,912.40	
KROGER CO	132,000	34.37	4,536,840.00	
SYSCO CORP	81,300	74.89	6,088,557.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	124,500	49.56	6,170,220.00	
WALMART INC	236,800	147.20	34,856,960.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	52,700	75.98	4,004,146.00	

COCA COLA CO	682,500	50.13	34,213,725.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	32,600	53.43	1,741,818.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	28,300	228.46	6,465,418.00	
KEURIG DR PEPPER INC	92,000	31.66	2,912,720.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	31,400	45.38	1,424,932.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	66,600	92.16	6,137,856.00	
PEPSICO INC	231,600	134.46	31,140,936.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	93,800	55.92	5,245,296.00	
BUNGE LIMITED	22,000	78.00	1,716,000.00	
CAMPBELL SOUP CO	30,900	46.38	1,433,142.00	
CONAGRA BRANDS INC	82,100	33.97	2,788,937.00	
GENERAL MILLS	102,800	56.81	5,840,068.00	
HERSHEY CO/THE	25,100	151.29	3,797,379.00	
HORMEL FOODS CORP	50,000	46.96	2,348,000.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,600	115.44	2,147,184.00	
KELLOGG CO	43,300	58.03	2,512,699.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	109,000	37.02	4,035,180.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,900	77.09	1,842,451.00	
MCCORMICK & CO INC.	40,200	85.95	3,455,190.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	238,600	54.92	13,103,912.00	
TYSON FOODS INC-CL A	50,100	67.22	3,367,722.00	
ALTRIA GROUP INC	310,500	43.60	13,537,800.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	258,600	86.61	22,397,346.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	39,800	82.76	3,293,848.00	
CLOROX CO	21,300	187.76	3,999,288.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	136,300	78.44	10,691,372.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	57,200	130.77	7,480,044.00	
PROCTER & GAMBLE CO	415,400	128.46	53,362,284.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	37,800	289.59	10,946,502.00	
ABBOTT LABORATORIES	295,800	127.24	37,637,592.00	
ABIOMED INC	7,200	316.30	2,277,360.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	12,570	599.53	7,536,092.10	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	85,500	77.68	6,641,640.00	
BECTON,DICKINSON	48,400	256.82	12,430,088.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	241,000	37.50	9,037,500.00	

DANAHER CORP	106,000	239.91	25,430,460.00	
DENTSPLY SIRONA INC	35,200	52.69	1,854,688.00	
DEXCOM INC	16,100	414.12	6,667,332.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	104,200	85.07	8,864,294.00	
HOLOGIC INC	43,400	82.50	3,580,500.00	
IDEXX LABORATORIES INC	14,290	540.35	7,721,601.50	
INSULET CORP	10,600	279.69	2,964,714.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	19,430	780.06	15,156,565.80	
MASIMO CORP	8,200	267.38	2,192,516.00	
MEDTRONIC PLC	223,000	118.16	26,349,680.00	
NOVOCURE LTD	14,000	180.89	2,532,460.00	
RESMED INC	24,500	199.73	4,893,385.00	
STERIS PLC	13,800	185.00	2,553,000.00	
STRYKER CORP	56,500	246.57	13,931,205.00	
TELEFLEX INC	7,560	403.30	3,048,948.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	9,100	384.65	3,500,315.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	15,300	176.18	2,695,554.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	12,400	293.99	3,645,476.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	34,900	158.58	5,534,442.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	25,700	105.31	2,706,467.00	
ANTHEM INC	42,000	290.25	12,190,500.00	
CARDINAL HEALTH INC	47,200	51.72	2,441,184.00	
CENTENE CORP	97,500	58.61	5,714,475.00	
CIGNA CORP	61,300	208.02	12,751,626.00	
CVS HEALTH CORP	218,400	72.71	15,879,864.00	
DAVITA INC	12,500	103.11	1,288,875.00	
HCA HEALTHCARE INC	45,400	176.44	8,010,376.00	
HENRY SCHEIN INC	23,100	64.87	1,498,497.00	
HUMANA INC	22,300	377.52	8,418,696.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,800	242.95	3,838,610.00	
MCKESSON CORP	27,400	181.29	4,967,346.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	9,700	216.90	2,103,930.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	21,900	121.85	2,668,515.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	158,600	326.86	51,839,996.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	13,000	129.02	1,677,260.00	

ABBVIE INC	295,200	106.29	31,376,808.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	36,900	157.02	5,794,038.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	18,700	156.53	2,927,111.00	
AMGEN INC	97,200	235.61	22,901,292.00	
BIOGEN INC	26,600	276.67	7,359,422.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	30,600	85.80	2,625,480.00	
EXACT SCIENCES CORP	25,800	140.99	3,637,542.00	
GILEAD SCIENCES INC	208,200	65.10	13,553,820.00	
INCYTE CORP	31,200	83.77	2,613,624.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	21,400	58.30	1,247,620.00	
MODERNA INC	46,300	176.76	8,183,988.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,200	115.29	1,637,118.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	17,520	481.68	8,439,033.60	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	12,600	89.60	1,128,960.00	
SEAGEN INC	20,700	158.83	3,287,781.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	43,600	214.85	9,367,460.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	374,200	60.59	22,672,778.00	
CATALENT INC	28,000	120.95	3,386,600.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	74,000	30.04	2,222,960.00	
ELI LILLY & CO.	144,000	206.46	29,730,240.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	35,900	87.17	3,129,403.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,000	164.28	1,478,520.00	
JOHNSON & JOHNSON	439,300	165.66	72,774,438.00	
MERCK & CO INC	423,100	75.54	31,960,974.00	
PERRIGO CO PLC	23,500	44.05	1,035,175.00	
PFIZER INC	930,000	34.89	32,447,700.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	18,500	47.38	876,530.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	173,000	11.30	1,954,900.00	
VIATRIS INC	200,723	18.52	3,717,389.96	
ZOETIS INC	79,400	168.90	13,410,660.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,301,000	34.41	44,767,410.00	
CITIGROUP	345,700	64.76	22,387,532.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	70,000	41.83	2,928,100.00	
FIFTH THIRD BANCORP	120,000	33.53	4,023,600.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	29,000	163.15	4,731,350.00	

HUNTINGTON BANCSHARES INC	172,000	14.97	2,574,840.00	
JPMORGAN CHASE & CO	508,500	145.10	73,783,350.00	
KEYCORP	158,000	19.72	3,115,760.00	
M & T BANK CORP	21,700	148.20	3,215,940.00	
PNC FINANCIAL	71,000	167.55	11,896,050.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	162,000	20.02	3,243,240.00	
SVB FINANCIAL GROUP	8,700	530.12	4,612,044.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	225,300	55.65	12,537,945.00	
US BANCORP	228,000	49.30	11,240,400.00	
WELLS FARGO CO	650,000	36.59	23,783,500.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	233,800	245.25	57,339,450.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	69,000	27.87	1,923,030.00	
VOYA FINANCIAL INC	21,700	56.00	1,215,200.00	
AFLAC INC	114,800	47.04	5,400,192.00	
ALLEGHANY CORP	2,300	608.99	1,400,677.00	
ALLSTATE CORP	52,900	104.86	5,547,094.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	107.92	1,349,000.00	
AMERICAN INTL GROUP	145,000	43.27	6,274,150.00	
AON PLC	39,000	229.20	8,938,800.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	65,000	35.35	2,297,750.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	31,900	117.66	3,753,354.00	
ASSURANT INC	10,200	125.72	1,282,344.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	45.30	960,360.00	
BROWN & BROWN INC	38,800	44.25	1,716,900.00	
CHUBB LTD	75,500	166.38	12,561,690.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24,600	93.80	2,307,480.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,400	256.64	1,129,216.00	
EVEREST RE GROUP LTD	6,200	242.72	1,504,864.00	
FNF GROUP	45,400	39.54	1,795,116.00	
GLOBE LIFE INC	15,700	94.68	1,486,476.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	58,900	50.10	2,950,890.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	54.52	1,630,148.00	
LOEWS CORP	43,100	48.52	2,091,212.00	
MARKEL CORP	2,330	1,093.90	2,548,787.00	
MARSH & MCLENNAN COS	84,800	117.68	9,979,264.00	

METLIFE INC	129,700	55.41	7,186,677.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,400	54.27	2,409,588.00
PROGRESSIVE CO	98,600	86.25	8,504,250.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	66,600	83.42	5,555,772.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10,500	118.19	1,240,995.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,800	160.59	1,252,602.00
TRAVELERS COS INC/THE	42,600	148.45	6,323,970.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	21,800	229.89	5,011,602.00
WR BERKLEY CORP	23,900	67.88	1,622,332.00
ACCENTURE PLC-CL A	106,500	258.78	27,560,070.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	27,400	101.95	2,793,430.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	71,900	167.13	12,016,647.00
BLACK KNIGHT INC	27,000	80.29	2,167,830.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	80.70	1,823,820.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	19,400	147.43	2,860,142.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	91,600	76.43	7,000,988.00
EPAM SYSTEMS INC	9,500	391.70	3,721,150.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	103,500	132.99	13,764,465.00
FISERV INC	95,200	111.07	10,573,864.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	14,300	271.99	3,889,457.00
GARTNER INC	14,100	178.24	2,513,184.00
GLOBAL PAYMENTS INC	50,300	192.85	9,700,355.00
GODADDY INC - CLASS A	26,900	83.06	2,234,314.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	148,500	119.97	17,815,545.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12,700	148.88	1,890,776.00
LEIDOS HOLDINGS INC	21,500	105.48	2,267,820.00
MASTERCARD INC	149,100	337.33	50,295,903.00
MONGODB INC	8,100	410.80	3,327,480.00
OKTA INC	20,300	284.09	5,767,027.00
PAYCHEX INC	54,800	89.18	4,887,064.00
PAYPAL HOLDINGS INC	186,100	297.20	55,308,920.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	5,600	288.78	1,617,168.00
SQUARE INC - A	62,000	270.94	16,798,280.00
TWILIO INC - A	21,900	411.65	9,015,135.00
VERISIGN INC	17,600	199.11	3,504,336.00

VISA INC-CLASS A SHARES	281,300	207.51	58,372,563.00	
WESTERN UNION CO	66,000	23.87	1,575,420.00	
WIX.COM LTD	9,400	302.16	2,840,304.00	
ADOBE INC	80,040	491.23	39,318,049.20	
ANSYS INC	14,500	393.90	5,711,550.00	
AUTODESK INC.	36,700	302.52	11,102,484.00	
AVALARA INC	13,100	171.21	2,242,851.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	46,900	141.78	6,649,482.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	21,600	95.90	2,071,440.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	18,700	116.92	2,186,404.00	
CITRIX SYSTEMS INC	19,800	134.08	2,654,784.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	25,100	84.40	2,118,440.00	
COUPA SOFTWARE INC	11,400	359.75	4,101,150.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	24,200	238.56	5,773,152.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	7,100	152.89	1,085,519.00	
DATADOG INC - CLASS A	24,700	103.08	2,546,076.00	
DOCUSIGN INC	29,300	254.98	7,470,914.00	
DROPBOX INC-CLASS A	51,000	24.10	1,229,100.00	
DYNATRACE INC	29,000	52.50	1,522,500.00	
FAIR ISAAC CORP	4,630	469.24	2,172,581.20	
FORTINET INC	22,400	166.23	3,723,552.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	125.33	1,704,488.00	
HUBSPOT INC	7,040	523.33	3,684,243.20	
INTUIT INC	43,300	415.81	18,004,573.00	
MICROSOFT CORP	1,199,600	244.20	292,942,320.00	
NORTONLIFELOCK INC	91,000	21.15	1,924,650.00	
ORACLE CORPORATION	331,200	62.09	20,564,208.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	16,200	395.42	6,405,804.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	8,100	391.75	3,173,175.00	
PTC INC	18,700	144.19	2,696,353.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	12,500	420.38	5,254,750.00	
SALESFORCE.COM INC	151,900	247.66	37,619,554.00	
SERVICENOW INC	31,850	580.94	18,502,939.00	
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	66,500	43.46	2,890,090.00	

SPLUNK INC	27,000	170.50	4,603,500.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	39,900	65.99	2,633,001.00	
SYNOPSYS INC	25,500	283.76	7,235,880.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,860	844.42	5,792,721.20	
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,520	469.04	3,058,140.80	
VMWARE INC - CLASS A	14,200	141.31	2,006,602.00	
WORKDAY INC-CLASS A	29,100	271.05	7,887,555.00	
ZENDESK INC	18,800	153.43	2,884,484.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	28,900	429.42	12,410,238.00	
ZSCALER INC	11,900	224.83	2,675,477.00	
ARISTA NETWORKS INC	9,600	312.21	2,997,216.00	
CISCO SYSTEMS	706,200	46.25	32,661,750.00	
F5 NETWORKS INC	10,400	204.14	2,123,056.00	
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	24.20	1,282,600.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	28,800	181.79	5,235,552.00	
APPLE INC	2,853,700	130.84	373,378,108.00	
DELL TECHNOLOGIES-C	40,700	79.26	3,225,882.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	220,000	14.00	3,080,000.00	
HP INC	242,000	26.28	6,359,760.00	
NETAPP INC	35,200	68.24	2,402,048.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	37,300	71.41	2,663,593.00	
WESTERN DIGITAL CORP	51,600	67.30	3,472,680.00	
AMPHENOL CORP-CL A	50,200	133.97	6,725,294.00	
ARROW ELECTRS INC	12,100	106.51	1,288,771.00	
CDW CORPORATION	23,900	157.86	3,772,854.00	
COGNEX CORP	27,800	87.14	2,422,492.00	
CORNING INC	129,000	37.89	4,887,810.00	
IPG PHOTONICS CORP	5,900	237.59	1,401,781.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	30,400	149.06	4,531,424.00	
TE CONNECTIVITY LTD	55,400	129.71	7,185,934.00	
TRIMBLE INC	42,200	72.48	3,058,656.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,900	479.58	4,268,262.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	194,900	89.94	17,529,306.00	
ANALOG DEVICES INC	61,800	159.75	9,872,550.00	
APPLIED MATERIALS	152,400	115.71	17,634,204.00	

BROADCOM INC	67,280	482.48	32,461,254.40
ENPHASE ENERGY INC	19,500	189.34	3,692,130.00
INTEL CORP	709,700	61.85	43,894,945.00
KLA CORP	26,100	330.30	8,620,830.00
LAM RESEARCH	24,340	585.91	14,261,049.40
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	112,800	50.40	5,685,120.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	45,200	95.63	4,322,476.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	42,700	163.05	6,962,235.00
MICRON TECHNOLOGY	184,500	86.05	15,876,225.00
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6,900	380.28	2,623,932.00
NVIDIA CORP	102,950	596.24	61,382,908.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	46,800	189.69	8,877,492.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	68,000	41.08	2,793,440.00
QORVO INC	19,400	174.61	3,387,434.00
QUALCOMM INC	188,800	144.75	27,328,800.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	28,200	192.09	5,416,938.00
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	8,200	334.80	2,745,360.00
TERADYNE INC	27,200	139.30	3,788,960.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	152,100	178.53	27,154,413.00
XILINX INC	41,200	139.32	5,739,984.00
AT & T INC	1,192,000	29.57	35,247,440.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	26.17	628,080.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	25.98	1,662,720.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	147,000	11.77	1,730,190.00
VERIZON COMMUNICATIONS	690,500	56.99	39,351,595.00
T-MOBILE US INC	93,100	121.30	11,293,030.00
ALLIANT ENERGY CORP	40,900	48.22	1,972,402.50
AMERICAN ELECTRIC POWER	83,400	78.49	6,546,066.00
DUKE ENERGY CORP	123,000	89.20	10,971,600.00
EDISON INTERNATIONAL	61,200	56.49	3,457,188.00
ENTERGY CORP	33,600	93.19	3,131,184.00
EVERGY INC	35,900	54.80	1,967,320.00
EVERSOURCE ENERGY	56,400	82.34	4,643,976.00
EXELON CORPORATION	163,700	42.17	6,903,229.00
FIRSTENERGY CORP	86,600	31.95	2,766,870.00

NEXTERA ENERGY INC	325,200	80.68	26,237,136.00
NRG ENERGY INC	40,500	39.77	1,610,685.00
OGE ENERGY CORP	32,500	31.76	1,032,200.00
PG&E CORP	237,000	11.71	2,775,270.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	19,100	77.15	1,473,565.00
PPL CORPORATION	129,000	28.07	3,621,030.00
SOUTHERN CO.	176,700	59.27	10,473,009.00
XCEL ENERGY INC	88,500	60.90	5,389,650.00
ATMOS ENERGY CORP	20,200	92.43	1,867,086.00
UGI CORP	36,000	40.25	1,449,000.00
AMEREN CORPORATION	41,500	73.30	3,041,950.00
CENTERPOINT ENERGY INC	94,000	21.53	2,023,820.00
CMS ENERGY CORP	48,200	55.83	2,691,006.00
CONSOLIDATED EDISON INC	57,000	70.16	3,999,120.00
DOMINION ENERGY INC	140,600	72.39	10,178,034.00
DTE ENERGY COMPANY	32,800	120.15	3,940,920.00
NISOURCE INC	65,000	22.67	1,473,550.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	85,800	58.01	4,977,258.00
SEMPRA ENERGY	47,300	124.61	5,894,053.00
WEC ENERGY GROUP INC	53,600	82.03	4,396,808.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	30,600	160.78	4,919,868.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	39,600	45.39	1,797,444.00
ALLY FINANCIAL INC	63,000	41.74	2,629,620.00
AMERICAN EXPRESS CO	113,600	128.56	14,604,416.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	76,600	118.91	9,108,506.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	52,000	91.70	4,768,400.00
SYNCHRONY FINANCIAL	86,000	37.47	3,222,420.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,400	218.39	4,455,156.00
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	27,500	51.95	1,428,625.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	134,300	42.90	5,761,470.00
BLACKROCK INC	25,430	721.39	18,344,947.70
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	112,600	69.88	7,868,488.00
CARLYLE GROUP INC/THE	22,000	36.55	804,100.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	96.02	1,718,758.00
CME GROUP INC	60,000	191.14	11,468,400.00

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,400	315.04	2,016,256.00
FRANKLIN RESOURCES INC	51,000	27.68	1,411,680.00
GOLDMAN SACHS GROUP	54,300	312.74	16,981,782.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	90,900	112.78	10,251,702.00
INVESCO LTD	68,000	22.58	1,535,440.00
KKR & CO INC-A	85,500	47.55	4,065,525.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,130	535.71	3,283,902.30
MOODYS CORP	28,300	280.55	7,939,565.00
MORGAN STANLEY	225,100	75.45	16,983,795.00
MSCI INC	13,720	439.32	6,027,470.40
NASDAQ INC	18,400	144.69	2,662,296.00
NORTHERN TRUST CORP	32,100	97.46	3,128,466.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,600	116.90	2,291,240.00
S&P GLOBAL INC	40,300	338.93	13,658,879.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	253,900	61.30	15,564,070.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	57.80	1,103,980.00
STATE STREET CORP	59,600	75.16	4,479,536.00
T ROWE PRICE GROUP INC	38,200	163.24	6,235,768.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	16,400	67.86	1,112,904.00
AES CORP	110,000	28.76	3,163,600.00
VISTRA CORP	70,000	22.01	1,540,700.00
CERNER CORP	52,000	72.49	3,769,480.00
TELADOC HEALTH INC	19,300	287.86	5,555,698.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	22,700	316.29	7,179,783.00
IOX GENOMICS INC-CLASS A	10,000	187.55	1,875,500.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	51,900	130.12	6,753,228.00
AVANTOR INC	84,000	29.63	2,488,920.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	655.72	2,386,820.80
ILLUMINA INC	24,430	494.24	12,074,283.20
IQVIA HOLDINGS INC	32,200	188.93	6,083,546.00
METTLER-TOLEDO INTL	4,070	1,166.46	4,747,492.20
PERKINELMER INC	18,800	144.42	2,715,096.00
PPD INC	20,000	36.90	738,000.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	66,170	498.46	32,983,098.20
WATERS CORP	10,500	282.58	2,967,090.00
	6,620	910.75	6,029,165.00

COSTAR GROUP INC				
EQUIFAX INC	19,700	176.59	3,478,823.00	
IHS MARKIT LTD	63,800	93.15	5,942,970.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	76.50	1,552,950.00	
TRUNSON	31,100	88.51	2,752,661.00	
VERISK ANALYTICS INC	26,000	188.56	4,902,560.00	
CBRE GROUP INC	54,800	69.72	3,820,656.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	4.58	842,720.00	
ALTICE USA INC-A	46,000	34.05	1,566,300.00	
CABLE ONE INC	820	2,104.09	1,725,353.80	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,950	624.12	14,947,674.00	
COMCAST CORP-CL A	760,700	52.99	40,309,493.00	
DISCOVERY INC - A	24,500	49.36	1,209,320.00	
DISCOVERY INC - C	56,000	41.62	2,330,720.00	
DISH NETWORK CORP-A	38,400	32.50	1,248,000.00	
FOX CORP-CLASS A	58,000	31.75	1,841,500.00	
FOX CORP-CLASS B	25,400	30.66	778,764.00	
INTERPUBRIC GROUP	67,000	25.16	1,685,720.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	147.83	591,320.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	25,900	151.21	3,916,339.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	29,900	42.65	1,275,235.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	43.41	559,989.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	67,000	23.18	1,553,060.00	
OMNICOM GROUP	34,500	67.10	2,314,950.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	6.01	1,051,750.00	
VIACOMCBS INC-CLASS B	95,100	61.00	5,801,100.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	129,000	102.35	13,203,150.00	
DISNEY (WALT) CO	301,500	186.44	56,211,660.00	
ELECTRONIC ARTS	48,500	145.83	7,072,755.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	34,000	45.46	1,545,640.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	26,600	84.86	2,257,276.00	
NETFLIX INC	73,590	551.34	40,573,110.60	
ROKU INC	17,580	456.97	8,033,532.60	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	19,400	195.93	3,801,042.00	
ALPHABET INC-CL A	50,140	2,118.62	106,227,606.80	

		ALPHABET INC-CL C	50,100	2,128.31	106,628,331.00	
		FACEBOOK INC-A	401,200	273.57	109,756,284.00	
		IAC/INTERACTIVE CORP	13,600	263.29	3,580,744.00	
		MATCH GROUP INC	41,600	160.80	6,689,280.00	
		PINTEREST INC- CLASS A	78,200	86.30	6,748,660.00	
		SNAP INC-A	152,200	62.72	9,545,984.00	
		TWITTER INC	132,800	71.79	9,533,712.00	
		ZILLOW GROUP INC - A	9,800	193.55	1,896,790.00	
		ZILLOW GROUP INC - C	24,600	189.76	4,668,096.00	
	小計	銘柄数：592			5,811,155,600.13	
					(614,471,593,157)	
		組入時価比率：69.5%			71.8%	
カナダドル		CAMECO CORP	72,000	21.24	1,529,280.00	
		CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	199,000	35.20	7,004,800.00	
		CENOVUS ENERGY INC	216,000	8.81	1,902,960.00	
		ENBRIDGE INC	339,000	43.81	14,851,590.00	
		IMPERIAL OIL	37,500	26.69	1,000,875.00	
		INTER PIPELINE LTD	75,000	17.51	1,313,250.00	
		KEYERA CORP	34,000	26.09	887,060.00	
		PARKLAND CORP	21,700	37.66	817,222.00	
		PEMBINA PIPELINE CORP	88,000	35.46	3,120,480.00	
		SUNCOR ENERGY INC	259,000	24.18	6,262,620.00	
		TC ENERGY CORP	158,000	56.55	8,934,900.00	
		NUTRIEN LTD	96,100	70.90	6,813,490.00	
		CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	66.15	1,633,905.00	
		AGNICO EAGLE MINES LTD	41,000	78.28	3,209,480.00	
		B2GOLD CORP	175,000	6.14	1,074,500.00	
		BARRICK GOLD	299,000	26.41	7,896,590.00	
		FIRST QUANTUM MINERALS LTD	93,000	25.98	2,416,140.00	
		FRANCO-NEVADA CORP	32,300	145.22	4,690,606.00	
		KINROSS GOLD CORP	217,000	8.68	1,883,560.00	
		KIRKLAND LAKE GOLD LTD	42,700	45.78	1,954,806.00	
		LUNDIN MINING CORP	118,000	14.00	1,652,000.00	
		PAN AMERICAN SILVER CORP	35,300	40.40	1,426,120.00	
		SSR MINING INC	34,000	19.35	657,900.00	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	79,000	26.32	2,079,280.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	76,100	48.26	3,672,586.00	
YAMANA GOLD INC	164,000	5.80	951,200.00	
WEST FRASER TIMBER	14,000	89.50	1,253,000.00	
CAE INC	50,000	31.71	1,585,500.00	
WSP GLOBAL INC	19,800	116.23	2,301,354.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	12,800	89.85	1,150,080.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	30,000	36.99	1,109,700.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	18,300	72.91	1,334,253.00	
AIR CANADA	32,000	23.56	753,920.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	118,600	138.28	16,400,008.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	22,700	461.44	10,474,688.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	48,200	99.06	4,774,692.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	35.01	1,113,318.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	49,400	75.48	3,728,712.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	10,200	175.97	1,794,894.00	
DOLLARAMA INC	46,600	47.85	2,229,810.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	145,000	38.80	5,626,000.00	
EMPIRE CO LTD A	26,000	36.87	958,620.00	
LOBLAW COMPANIES	28,500	62.18	1,772,130.00	
METRO INC	43,500	54.00	2,349,000.00	
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	95.33	1,172,559.00	
SAPUTO INC	41,000	37.86	1,552,260.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	40.66	2,073,660.00	
CANOPY GROWTH CORP	41,000	51.61	2,116,010.00	
BANK OF MONTREAL	107,800	99.37	10,712,086.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	203,600	71.00	14,455,600.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	75,000	114.02	8,551,500.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	55,000	73.99	4,069,450.00	
ROYAL BANK OF CANADA	237,300	107.37	25,478,901.00	
TORONTO DOMINION BANK	300,700	75.51	22,705,857.00	
ONEX CORPORATION	13,200	73.25	966,900.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,140	521.87	2,160,541.80	
GREAT-WEST LIFE CO INC	42,000	31.32	1,315,440.00	

	IA FINANCIAL CORP INC	18,300	63.80	1,167,540.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	24,500	145.60	3,567,200.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	326,000	25.08	8,176,080.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	97,000	30.76	2,983,720.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	98,800	61.60	6,086,080.00	
	CGI INC	37,200	99.28	3,693,216.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	18,040	1,804.18	32,547,407.20	
	BLACKBERRY LTD	94,000	14.37	1,350,780.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,410	1,686.95	5,752,499.50	
	OPEN TEXT CORP	47,000	59.64	2,803,080.00	
	BCE INC	25,600	55.89	1,430,784.00	
	TELUS CORP	58,600	26.33	1,542,938.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	58,200	56.57	3,292,374.00	
	EMERA INC	42,500	51.12	2,172,600.00	
	FORTIS INC	75,300	51.40	3,870,420.00	
	HYDRO ONE LTD	55,000	28.46	1,565,300.00	
	ALTAGAS LTD	42,000	19.84	833,280.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	97,000	21.98	2,132,060.00	
	ATCO LTD CL1	13,000	38.22	496,860.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	32.08	651,224.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	215,300	55.84	12,022,352.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	18.38	617,568.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	35.08	526,200.00	
	TMX GROUP LTD	9,500	126.66	1,203,270.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	18,750	61.53	1,153,687.50	
	NORTHLAND POWER INC	30,000	48.72	1,461,600.00	
	THOMSON REUTERS CORP	27,800	104.21	2,897,038.00	
	FIRSTSERVICE CORP	6,000	190.26	1,141,560.00	
	QUEBECOR INC-CL B	27,000	32.02	864,540.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,000	22.44	1,727,880.00	
小計	銘柄数：87			357,408,782.00	
				(29,768,577,452)	
	組入時価比率：3.4%			3.5%	
ユーロ	TENARIS SA	71,000	7.37	523,412.00	
	ENI SPA	432,000	9.16	3,958,416.00	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	9.57	775,818.00	
NESTE OYJ	71,400	57.58	4,111,212.00	
OMV AG	25,000	39.30	982,500.00	
REPSOL SA	244,896	9.45	2,315,736.57	
TOTAL SE	420,400	36.96	15,540,086.00	
VOPAK	11,400	42.24	481,536.00	
AIR LIQUIDE SA	79,100	133.55	10,563,805.00	
AKZO NOBEL	33,000	85.90	2,834,700.00	
ARKEMA	11,600	91.46	1,060,936.00	
BASF SE	153,500	67.16	10,309,060.00	
COVESTRO AG	30,500	58.96	1,798,280.00	
EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	27.84	918,720.00	
FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	48.14	505,470.00	
KONINKLIJKE DSM NV	29,100	145.75	4,241,325.00	
LANXESS	15,200	62.90	956,080.00	
SOLVAY SA	13,100	96.20	1,260,220.00	
SYMRISE AG	20,900	102.00	2,131,800.00	
UMICORE	34,300	47.03	1,613,129.00	
CRH PLC	132,200	36.45	4,818,690.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	24,900	63.40	1,578,660.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	42,300	41.52	1,756,296.00	
ARCELORMITTAL	119,000	19.58	2,330,496.00	
VOESTALPINE AG	20,000	31.56	631,200.00	
STORA ENSO OYJ-R	96,000	16.44	1,578,720.00	
UPM-KYMMENE OYJ	91,000	32.44	2,952,040.00	
AIRBUS SE	98,400	93.90	9,239,760.00	
DASSAULT AVIATION SA	330	918.00	302,940.00	
MTU AERO ENGINES AG	9,200	198.30	1,824,360.00	
SAFRAN SA	53,800	111.00	5,971,800.00	
THALES SA	18,600	77.64	1,444,104.00	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	87,500	42.29	3,700,375.00	
KINGSPAN GROUP PLC	26,400	54.65	1,442,760.00	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	43,599	25.25	1,100,874.75	
BOUYGUES	40,000	34.46	1,378,400.00	
EIFFAGE SA	14,100	81.78	1,153,098.00	

FERROVIAL SA	79,790	20.08	1,602,183.20	
HOCHTIEF AG	3,800	76.30	289,940.00	
VINCI	87,300	85.24	7,441,452.00	
LEGRAND SA	45,200	75.00	3,390,000.00	
PRYSMIAN SPA	43,000	27.90	1,199,700.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	90,000	127.05	11,434,500.00	
SIEMENS ENERGY AG	66,000	33.10	2,184,600.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	34.33	1,304,540.00	
SIEMENS AG	127,500	130.78	16,674,450.00	
ALSTOM	43,300	41.62	1,802,146.00	
CNH INDUSTRIAL NV	170,000	11.94	2,029,800.00	
GEA GROUP AG	24,200	30.08	727,936.00	
KION GROUP AG	11,000	75.38	829,180.00	
KNORR-BREMSE AG	12,700	107.42	1,364,234.00	
KONE OYJ	57,400	68.24	3,916,976.00	
RATIONAL AG	830	804.00	667,320.00	
WARTSILA OYJ	83,000	8.36	693,880.00	
BRENNTAG SE	26,800	65.32	1,750,576.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	165,900	42.30	7,017,570.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	56,000	10.94	612,640.00	
ADP	4,700	96.80	454,960.00	
AENA SME SA	11,700	132.40	1,549,080.00	
ATLANTIA SPA	79,000	15.30	1,209,095.00	
GETLINK	72,000	13.46	969,120.00	
CONTINENTAL AG	18,900	118.05	2,231,145.00	
FAURECIA	15,000	45.38	680,700.00	
MICHELIN (CGDE)	28,700	116.25	3,336,375.00	
VALEO SA	37,300	32.40	1,208,520.00	
BAYER MOTOREN WERK	55,900	70.86	3,961,074.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	55.90	570,180.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	143,100	65.44	9,364,464.00	
FERRARI NV	21,300	166.00	3,535,800.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25,400	60.24	1,530,096.00	
RENAULT SA	33,700	39.49	1,330,813.00	
STELLANTIS NV	346,974	13.21	4,583,526.54	

VOLKSWAGEN AG	5,100	182.10	928,710.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	31,200	161.38	5,035,056.00	
SEB SA	3,800	164.10	623,580.00	
ADIDAS AG	31,900	290.90	9,279,710.00	
ESSILORLUXOTTICA	47,800	136.95	6,546,210.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,330	930.40	4,959,032.00	
KERING SA	12,700	524.90	6,666,230.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	46,320	535.00	24,781,200.00	
MONCLER SPA	32,100	50.64	1,625,544.00	
PUMA SE	16,300	85.86	1,399,518.00	
ACCOR SA	32,000	31.04	993,280.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	26,600	159.70	4,248,020.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	36.98	569,492.00	
SODEXO	15,700	76.00	1,193,200.00	
DELIVERY HERO SE	22,100	124.00	2,740,400.00	
HELLOFRESH SE	24,000	71.90	1,725,600.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	20,600	87.04	1,793,024.00	
PROSUS NV	81,600	109.05	8,898,480.00	
ZALANDO SE	24,900	95.72	2,383,428.00	
INDITEX SA	184,000	25.85	4,756,400.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	95,000	14.72	1,398,400.00	
COLRUYT SA	8,700	50.66	440,742.00	
JERONIMO MARTINS	38,000	13.32	506,160.00	
KESKO OYJ-B SHS	44,000	21.80	959,200.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	186,000	23.04	4,285,440.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	127,700	53.31	6,807,687.00	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	9.76	888,524.00	
HEINEKEN HOLDING NV	20,000	75.00	1,500,000.00	
HEINEKEN NV	43,800	85.88	3,761,544.00	
PERNOD RICARD SA	34,300	163.30	5,601,190.00	
REMY COINTREAU	3,900	162.30	632,970.00	
DANONE	103,800	55.88	5,800,344.00	
JDE PEET'S BV	11,000	32.70	359,700.00	
KERRY GROUP PLC-A	25,900	105.20	2,724,680.00	
HENKEL AG & CO KGAA	18,000	76.10	1,369,800.00	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	28,900	85.56	2,472,684.00	
BEIERSDORF AG	16,000	86.00	1,376,000.00	
LOREAL-ORD	42,000	317.00	13,314,000.00	
BIOMERIEUX	6,900	121.40	837,660.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	134.10	965,520.00	
DIASORIN SPA	4,000	183.50	734,000.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	152,700	47.44	7,244,088.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,790	488.40	2,827,836.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	46,000	47.59	2,189,370.00	
AMPLIFON SPA	20,300	35.87	728,161.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	36,600	60.98	2,231,868.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	67,300	36.06	2,426,838.00	
ORPEA	9,300	110.80	1,030,440.00	
ARGENX SE	7,600	302.20	2,296,720.00	
GALAPAGOS NV	7,000	69.98	489,860.00	
GRIFOLS SA	46,800	22.65	1,060,020.00	
BAYER AG-REG	164,400	53.98	8,874,312.00	
IPSEN	5,500	70.95	390,225.00	
MERCK KGAA	21,100	141.10	2,977,210.00	
ORION OYJ	16,500	35.93	592,845.00	
RECORDATI SPA	16,800	44.00	739,200.00	
SANOFI	189,000	78.78	14,889,420.00	
UCB SA	20,600	86.42	1,780,252.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	9.12	638,820.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,124,000	4.44	4,999,552.00	
BANCO SANTANDER SA	2,910,000	2.89	8,422,995.00	
BNP PARIBAS	188,400	47.65	8,977,260.00	
CAIXABANK	600,000	2.33	1,402,200.00	
COMMERZBANK AG	158,000	5.24	828,552.00	
CREDIT AGRICOLE SA	184,000	11.18	2,058,040.00	
ERSTE GROUP BANK AG	49,000	26.76	1,311,240.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	101,000	14.90	1,504,900.00	
ING GROEP NV	656,000	8.92	5,854,800.00	
INTESA SANPAOLO	2,780,000	2.09	5,826,880.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	

KBC GROEP NV	40,900	58.68	2,400,012.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	9.02	965,354.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	16.98	341,298.00	
SOCIETE GENERALE	129,000	19.06	2,458,740.00	
UNICREDIT SPA	361,000	8.30	2,996,300.00	
EURAZEO SE	5,953	61.65	367,002.45	
EXOR NV	17,200	65.32	1,123,504.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	19,500	83.96	1,637,220.00	
SOFINA SA	2,300	289.50	665,850.00	
WENDEL	4,300	94.85	407,855.00	
AEGON NV	293,000	3.86	1,132,152.00	
AGEAS	28,900	45.68	1,320,152.00	
ALLIANZ SE-REG	69,600	197.86	13,771,056.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	188,000	15.65	2,943,140.00	
AXA SA	325,000	19.70	6,403,800.00	
CNP ASSURANCES	28,000	14.25	399,000.00	
HANNOVER RUECK SE	9,600	141.20	1,355,520.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	23,600	233.90	5,520,040.00	
NN GROUP NV	47,000	37.31	1,753,570.00	
POSTE ITALIANE SPA	88,000	9.48	834,416.00	
SAMPO OYJ-A SHS	80,400	36.87	2,964,348.00	
SCOR SE	23,200	28.00	649,600.00	
ADYEN NV	3,050	2,160.00	6,588,000.00	
AMADEUS IT GROUP SA	76,000	53.82	4,090,320.00	
ATOS SE	15,300	66.34	1,015,002.00	
BECHTLE AG	4,400	167.50	737,000.00	
CAPGEMINI SA	27,300	135.50	3,699,150.00	
EDENRED	42,400	47.36	2,008,064.00	
NEXI SPA	74,000	15.88	1,175,120.00	
WORLDLINE SA	38,699	77.24	2,989,110.76	
DASSAULT SYSTEMES SA	22,300	186.80	4,165,640.00	
NEMETSCHEK SE	9,200	56.25	517,500.00	
SAP SE	174,000	104.42	18,169,080.00	
TEAMVIEWER AG	25,200	48.64	1,225,728.00	
NOKIA OYJ	923,000	3.40	3,139,584.50	

ASML HOLDING NV	71,170	484.35	34,471,189.50	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	218,800	35.23	7,708,324.00	
STMICROELECTRONICS NV	107,800	34.44	3,712,632.00	
CELLNEX TELECOM SA	53,900	45.47	2,450,833.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	558,000	14.76	8,236,080.00	
ELISA OYJ	22,100	50.70	1,120,470.00	
ILIAD SA	2,400	154.60	371,040.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	55,000	9.21	506,825.00	
KONINKLIJKE KPN NV	560,000	2.86	1,602,720.00	
ORANGE SA	325,000	10.05	3,266,250.00	
PROXIMUS	26,000	17.76	461,760.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,170,000	0.38	445,419.00	
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.42	370,480.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.39	358,800.00	
TELEFONICA SA	863,000	3.78	3,265,592.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	38.25	642,600.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	109,000	10.58	1,153,765.00	
ELIA GROUP SA/NV	4,800	96.00	460,800.00	
ENDESA S.A.	50,000	21.86	1,093,000.00	
ENEL SPA	1,358,000	8.30	11,275,474.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	476,000	4.95	2,357,628.00	
FORTUM OYJ	72,000	21.64	1,558,080.00	
IBERDROLA SA	1,022,000	10.70	10,935,400.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	14.91	1,043,700.00	
TERNA SPA	222,000	6.04	1,341,324.00	
VERBUND AG	11,000	69.95	769,450.00	
ENAGAS SA	39,000	17.33	676,065.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	50,000	20.72	1,036,000.00	
SNAM SPA	350,000	4.43	1,550,500.00	
E.ON SE	380,000	8.78	3,339,440.00	
ENGIE	308,000	12.98	3,999,380.00	
RWE AG	108,500	32.89	3,568,565.00	
SUEZ	52,000	16.83	875,420.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	87,000	22.57	1,963,590.00	
AMUNDI SA	10,000	65.90	659,000.00	

		DEUTSCHE BANK AG-REG	334,000	9.32	3,112,880.00	
		DEUTSCHE BOERSE AG	32,000	136.60	4,371,200.00	
		NATIXIS	158,000	4.05	639,900.00	
		UNIPER SE	31,100	29.62	921,182.00	
		EUROFINS SCIENTIFIC SE	21,600	81.57	1,761,912.00	
		QIAGEN N.V.	39,400	45.46	1,791,124.00	
		SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,540	412.00	1,870,480.00	
		BUREAU VERITAS SA	47,000	22.27	1,046,690.00	
		RANDSTAD NV	18,400	54.56	1,003,904.00	
		TELEPERFORMANCE	9,600	286.50	2,750,400.00	
		WOLTERS KLUWER	44,400	70.16	3,115,104.00	
		AROUNDTOWN SA	173,000	5.89	1,019,662.00	
		DEUTSCHE WOHNEN SE	55,500	40.32	2,237,760.00	
		LEG IMMOBILIEN AG	12,500	117.86	1,473,250.00	
		VONOVIA SE	87,800	54.18	4,757,004.00	
		PUBLICIS GROUPE	38,000	47.51	1,805,380.00	
		SES FDR	56,000	6.89	386,176.00	
		BOLLORE	138,000	4.10	566,076.00	
		UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	73.28	1,055,232.00	
		VIVENDI SA	140,000	30.25	4,235,000.00	
		SCOUT24 AG	17,100	66.40	1,135,440.00	
		小計銘柄数：233			717,644,230.27 (91,435,051,378)	
		組入時価比率：10.3%			10.7%	
英ポンド		BP PLC	3,390,000	2.80	9,512,340.00	
		ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	685,000	14.38	9,854,410.00	
		ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	620,000	13.76	8,536,160.00	
		CRODA INTERNATIONAL PLC	22,300	65.60	1,462,880.00	
		JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	30.51	921,402.00	
		ANGLO AMERICAN PLC	206,000	27.79	5,725,770.00	
		ANTOFAGASTA PLC	70,000	17.14	1,200,150.00	
		BHP GROUP PLC	354,000	22.44	7,945,530.00	
		EVRAZ PLC	76,000	5.29	402,192.00	
		FRESNILLO PLC	30,000	9.73	291,900.00	
		GLENCORE PLC	1,680,000	2.88	4,841,760.00	
		RIO TINTO PLC-REG	187,300	62.35	11,678,155.00	

MONDI PLC	84,000	18.31	1,538,460.00	
BAE SYSTEMS PLC	547,000	4.81	2,635,993.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,380,000	1.02	1,411,740.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	850,000	1.71	1,456,900.00	
DCC PLC	16,000	59.54	952,640.00	
SMITHS GROUP PLC	61,000	14.85	905,850.00	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,600	116.70	1,353,720.00	
ASHTED GROUP PLC	73,500	38.72	2,845,920.00	
BUNZLE	55,000	23.11	1,271,050.00	
FERGUSON PLC	38,200	86.84	3,317,288.00	
RENTOKIL INTIAL PLC	318,000	5.14	1,635,792.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	159,000	6.80	1,081,200.00	
PERSIMMON PLC	52,600	27.59	1,451,234.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	620,000	1.60	995,410.00	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	19,500	43.36	845,520.00	
BURBERRY GROUP PLC	66,000	18.60	1,227,600.00	
COMPASS GROUP PLC	301,000	14.48	4,358,480.00	
ENTAIN PLC	102,000	13.47	1,374,450.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	28,800	50.06	1,441,728.00	
WHITBREAD PLC	31,650	33.66	1,065,339.00	
OCADO GROUP PLC	83,000	25.93	2,152,190.00	
NEXT PLC	21,900	77.50	1,697,250.00	
JD SPORTS FASHION PLC	93,000	8.31	773,016.00	
KINGFISHER PLC	349,000	2.75	961,146.00	
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	1.73	641,950.00	
SAINSBURY	299,000	2.31	692,484.00	
TESCO PLC	1,302,631	2.37	3,095,702.57	
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	23.44	796,960.00	
DIAGEO PLC	390,100	30.46	11,882,446.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	62,000	23.08	1,430,960.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	383,000	26.40	10,111,200.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	161,000	15.05	2,423,050.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	119,000	62.84	7,477,960.00	
UNILEVER PLC	440,200	39.80	17,519,960.00	
SMITH & NEPHEW PLC	150,000	15.67	2,351,250.00	

NMC HEALTH PLC	13,300	0.24	3,192.00
ASTRAZENECA PLC	217,900	74.21	16,170,359.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	838,000	12.76	10,696,232.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29,600	23.92	708,032.00
BARCLAYS PLC	2,920,000	1.54	4,507,312.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,397,000	4.32	14,683,532.50
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,980,000	0.38	4,663,215.00
NATWEST GROUP PLC	770,000	1.78	1,371,755.00
STANDARD CHARTERED PLC	443,000	4.97	2,203,925.00
M&G PLC	440,000	1.87	824,120.00
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	30.60	942,480.00
AVIVA PLC	670,000	3.61	2,422,720.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	3.12	684,156.00
LEGAL & GENERAL	1,010,000	2.66	2,690,640.00
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	89,000	7.13	634,748.00
PRUDENTIAL PLC	438,000	13.99	6,127,620.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	162,000	6.76	1,095,444.00
AVEVA GROUP PLC	19,911	38.38	764,184.18
SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	5.96	1,043,350.00
HALMA PLC	65,000	25.19	1,637,350.00
BT GROUP PLC	1,530,000	1.29	1,986,705.00
VODAFONE GROUP PLC	4,500,000	1.32	5,971,500.00
SSE PLC	177,000	14.28	2,527,560.00
NATIONAL GRID PLC	591,000	8.64	5,109,786.00
SEVERN TRENT PLC	37,000	23.34	863,580.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	106,000	9.34	990,464.00
3I GROUP PLC	167,000	11.56	1,931,355.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	52,000	15.39	800,540.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	53,200	98.10	5,218,920.00
SCHRODERS PLC	19,700	35.49	699,153.00
ST JAMES S PLACE PLC	95,000	12.05	1,145,225.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	3.23	1,182,180.00
EXPERIAN PLC	152,900	26.10	3,990,690.00
INTERTEK GROUP PLC	25,600	58.84	1,506,304.00
RELX PLC	324,000	18.30	5,929,200.00

スイスフラン	INFORMA PLC	248,000	5.10	1,266,288.00	
	PEARSON	126,000	7.58	955,332.00	
	WPP PLC	200,000	8.30	1,661,200.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	171,000	5.93	1,014,372.00	
	小計 銘柄数：86			278,171,208.25	
				(40,804,934,538)	
	組入時価比率：4.6%			4.8%	
	CLARIANT AG-REG	32,000	19.16	613,120.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,440	875.00	1,260,000.00	
	GIVAUDAN-REG	1,550	3,562.00	5,521,100.00	
	SIKA AG-REG	23,800	249.80	5,945,240.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	88,400	49.41	4,367,844.00	
	GEBERIT AG-REG	6,280	551.80	3,465,304.00	
	ABB LTD	309,000	26.26	8,114,340.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	243.60	730,800.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,700	246.10	1,648,870.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	207.90	1,746,360.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	88,000	87.66	7,714,080.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	263.90	1,240,330.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	51.00	377,400.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,990.00	915,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	177	8,205.00	1,452,285.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	16	85,900.00	1,374,400.00	
	NESTLE SA-REG	480,700	100.36	48,243,052.00	
	ALCON INC	82,700	65.00	5,375,500.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	8,858	238.00	2,108,204.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,790	1,135.00	2,031,650.00	
	NOVARTIS AG-REG	371,400	80.80	30,009,120.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	117,200	308.10	36,109,320.00	
	VIFOR PHARMA AG	7,600	117.10	889,960.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	5,400	99.10	535,140.00	
	BALOISE HOLDING AG	7,400	155.20	1,148,480.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,220	439.20	2,292,624.00	
	SWISS RE LTD	48,300	83.38	4,027,254.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	25,170	376.30	9,471,471.00	
		10,400	107.80	1,121,120.00	

	TEMENOS AG-REG				
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	27,000	102.65	2,771,550.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,450	468.00	2,082,600.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	412,000	12.70	5,232,400.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	35,800	54.30	1,943,940.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	3,170	1,102.00	3,493,340.00	
	UBS GROUP AG	617,000	13.98	8,625,660.00	
	LONZA AG-REG	12,180	609.40	7,422,492.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	24,900	57.18	1,423,782.00	
	SGS SA-REG	980	2,745.00	2,690,100.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	13,500	88.15	1,190,025.00	
小計	銘柄数：39			226,725,657.00	
				(26,694,678,855)	
	組入時価比率：3.0%			3.1%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN ENERGY AB	28,800	262.20	7,551,360.00	
	BOLIDEN AB	44,000	313.00	13,772,000.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B	100,000	151.65	15,165,000.00	
	ASSA ABLOY AB-B	170,000	217.10	36,907,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	51,000	290.80	14,830,800.00	
	SKANSKA AB-B SHS	60,000	205.30	12,318,000.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	204.00	5,304,000.00	
	ALFA LAVAL AB	51,000	251.00	12,801,000.00	
	ATLAS COPCO AB-A	112,900	492.70	55,625,830.00	
	ATLAS COPCO AB-B	62,700	421.60	26,434,320.00	
	EPIROC AB - A	113,000	174.00	19,662,000.00	
	EPIROC AB - B	69,000	157.85	10,891,650.00	
	SANDVIK AB	192,000	218.50	41,952,000.00	
	SKF AB-B SHARES	67,000	223.20	14,954,400.00	
	VOLVO AB-B SHS	240,000	212.10	50,904,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	54,000	125.00	6,750,000.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	206.60	7,024,400.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	102.30	7,467,900.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	27,300	1,057.00	28,856,100.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	130,000	185.05	24,056,500.00	
	ICA GRUPPEN AB	17,100	415.30	7,101,630.00	

	SWEDISH MATCH AB	26,000	606.80	15,776,800.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	103,000	263.60	27,150,800.00	
	NORDEA BANK ABP	548,000	75.06	41,132,880.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	267,000	96.30	25,712,100.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	267,000	85.96	22,951,320.00	
	SWEDBANK AB	148,000	146.84	21,732,320.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	15,000	287.60	4,314,000.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	274.40	6,860,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	76,700	634.20	48,643,140.00	
	KINNEVIK AB - B	39,000	417.70	16,290,300.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	431.60	5,438,160.00	
	ERICSSON LM-B	491,000	109.55	53,789,050.00	
	HEXAGON AB-B SHS	45,600	722.40	32,941,440.00	
	TELIA CO AB	428,000	35.14	15,039,920.00	
	TELE 2 AB-B SHS	78,000	109.10	8,509,800.00	
	EQT AB	42,000	251.60	10,567,200.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	15,100	408.00	6,160,800.00	
小計	銘柄数：38			783,339,920.00	
				(9,964,083,782)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	160,000	156.30	25,008,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	414.50	12,269,200.00	
	NORSK HYDRO	218,000	43.01	9,376,180.00	
	MOWI ASA	77,000	190.90	14,699,300.00	
	ORKLA ASA	133,000	80.00	10,640,000.00	
	DNB ASA	155,000	168.00	26,040,000.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	203.80	6,317,800.00	
	TELENOR ASA	116,000	141.45	16,408,200.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	18,100	296.20	5,361,220.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	10,600	353.40	3,746,040.00	
	ADEVINTA ASA	45,000	129.90	5,845,500.00	
小計	銘柄数：11			135,711,440.00	
				(1,690,964,542)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク	CHR HANSEN HOLDING A/S	18,200	566.40	10,308,480.00	

ローネ

NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	400.00	13,480,000.00	
ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS	1,120	2,270.00	2,542,400.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	33,200	1,335.50	44,338,600.00	
DSV PANALPINA A S	34,900	1,129.00	39,402,100.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	560	11,700.00	6,552,000.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	12,690.00	13,197,600.00	
PANDORA A/S	16,000	611.40	9,782,400.00	
CARLSBERG B	16,800	1,009.50	16,959,600.00	
AMBU A/S-B	29,000	309.50	8,975,500.00	
COLOPLAST-B	19,400	1,008.50	19,564,900.00	
DEMANT A/S	16,000	262.90	4,206,400.00	
GN STORE NORD A/S	21,200	543.40	11,520,080.00	
GENMAB A/S	11,060	2,503.00	27,683,180.00	
H LUNDBECK A/S	10,500	255.90	2,686,950.00	
NOVO NORDISK A/S-B	287,000	466.10	133,770,700.00	
DANSKE BANK AS	109,000	112.70	12,284,300.00	
TRYG A/S	28,000	200.40	5,611,200.00	
ORSTED A/S	31,800	1,031.00	32,785,800.00	
小計銘柄数：19			415,652,190.00	
			(7,120,122,014)	
組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル				
AMPOL LTD	40,000	27.32	1,092,800.00	
OIL SEARCH LTD	350,000	4.31	1,508,500.00	
ORIGIN ENERGY LTD	265,000	4.60	1,219,000.00	
SANTOS LTD.	310,000	7.04	2,182,400.00	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	29.53	502,010.00	
WOODSIDE PETROLEUM	163,000	25.96	4,231,480.00	
ORICA LTD	59,000	15.24	899,160.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	73,000	40.70	2,971,100.00	
BHP GROUP LIMITED	492,000	48.60	23,911,200.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	90,000	18.19	1,637,100.00	
EVOLUTION MINING LTD	272,000	4.21	1,145,120.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	286,000	24.41	6,981,260.00	
NEWCREST MINING	132,000	24.52	3,236,640.00	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	194,000	10.74	2,083,560.00	

RIO TINTO LTD	62,600	127.47	7,979,622.00	
SOUTH32 LTD	780,000	2.71	2,113,800.00	
CIMIC GROUP LTD	18,000	20.95	377,100.00	
BRAMBLES LTD	247,000	10.58	2,613,260.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	4.73	804,100.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	3.96	1,207,800.00	
SYDNEY AIRPORT	200,621	5.68	1,139,527.28	
TRANSURBAN GROUP	462,000	12.84	5,932,080.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	99,000	33.34	3,300,660.00	
CROWN RESORTS LTD	55,000	9.69	532,950.00	
TABCORP HOLDINGS	370,909	4.41	1,635,708.69	
WESFARMERS LIMITED	190,200	54.15	10,299,330.00	
COLES GROUP LTD	227,000	17.20	3,904,400.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	212,000	39.41	8,354,920.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	13.37	1,029,490.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	10.14	1,125,540.00	
COCHLEAR LTD	10,300	204.36	2,104,908.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	29,500	62.28	1,837,260.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	78,000	33.58	2,619,240.00	
CSL LIMITED	75,800	281.17	21,312,686.00	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	475,000	25.82	12,264,500.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	295,100	84.28	24,871,028.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	551,000	25.60	14,105,600.00	
WESTPAC BANKING CORP	605,000	23.54	14,241,700.00	
AMP LIMITED	530,000	1.38	731,400.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	430,000	5.14	2,210,200.00	
MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	2.82	1,269,000.00	
QBE INSURANCE	244,000	8.76	2,137,440.00	
SUNCORP GROUP LTD	222,000	10.24	2,273,280.00	
AFTERPAY LTD	34,800	147.77	5,142,396.00	
COMPUTERSHARE LTD	76,000	14.18	1,077,680.00	
WISETECH GLOBAL LTD	21,000	31.69	665,490.00	
XERO LIMITED	19,800	127.86	2,531,628.00	
TELSTRA CORP LTD	730,000	3.31	2,416,300.00	
TPG TELECOM LTD	52,000	7.26	377,520.00	

	AUSNET SERVICES	330,000	1.69	559,350.00	
	APA GROUP	205,000	9.31	1,908,550.00	
	AGL ENERGY LTD	105,000	10.36	1,087,800.00	
	ASX LTD	30,700	69.78	2,142,246.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	56,800	145.67	8,274,056.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	47.49	911,808.00	
	REA GROUP LTD	8,800	154.36	1,358,368.00	
	SEEK LTD	60,000	30.80	1,848,000.00	
小計	銘柄数：57			238,231,051.97	
				(19,542,093,193)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	6.97	1,554,310.00	
	A2 MILK CO LTD	117,000	10.98	1,284,660.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	93,000	32.25	2,999,250.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	74,000	15.80	1,169,200.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.64	1,426,015.00	
	MERCURY NZ LTD	100,000	6.60	660,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	6.15	1,236,150.00	
小計	銘柄数：7			10,329,585.00	
				(785,771,530)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	280,000	22.50	6,300,000.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	460,040	55.55	25,555,222.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	233,000	130.20	30,336,600.00	
	MTR CORP	272,000	44.95	12,226,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	356,000	69.80	24,848,800.00	
	SANDS CHINA LTD	424,000	36.15	15,327,600.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	10.20	2,754,000.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	14.92	3,401,760.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	290,000	26.95	7,815,500.00	
	WH GROUP LIMITED	1,610,000	6.53	10,513,300.00	
	BANK OF EAST ASIA	220,060	18.66	4,106,319.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	610,000	24.25	14,792,500.00	
	HANG SENG BANK	131,000	152.00	19,912,000.00	

	AIA GROUP LTD	2,024,000	105.60	213,734,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	125.00	6,000,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	10.48	6,283,808.00	
	PCCW LTD	750,000	4.53	3,397,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	42.95	4,595,650.00	
	CLP HLDGS	281,000	72.20	20,288,200.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	41.45	9,326,250.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,740,365	11.06	19,248,436.90	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	201,200	563.50	113,376,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	445,040	41.20	18,335,648.00	
	ESR CAYMAN LTD	260,000	28.25	7,345,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	21.85	7,866,000.00	
	HENDERSON LAND	229,443	32.20	7,388,064.60	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	268,916	37.40	10,057,458.40	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	11.62	5,577,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	222,000	111.00	24,642,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	75,000	55.20	4,140,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	23.75	4,108,750.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	279,000	48.85	13,629,150.00	
小計	銘柄数：32			677,230,117.50	
				(9,237,418,802)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.77	938,730.00	
	KEPPEL CORP.	232,000	5.12	1,187,840.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	240,000	4.39	1,053,600.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.85	960,500.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	340,000	5.49	1,866,600.00	
	DBS GROUP HLDGS	302,000	26.00	7,852,000.00	
	OCBC-ORD	559,000	10.65	5,953,350.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	190,000	23.95	4,550,500.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	20.28	912,600.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,400,000	2.40	3,360,000.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	9.95	1,283,550.00	

	小計	CAPITALAND LIMITED	430,000	3.15	1,354,500.00	
		CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	7.20	504,000.00	
		UOL GROUP LIMITED	87,000	7.36	640,320.00	
		銘柄数：14			32,418,090.00	
		組入時価比率：0.3%			(2,582,749,230)	0.3%
	新シエケル	ICL GROUP LTD	125,000	19.43	2,428,750.00	
		ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	461.00	2,305,000.00	
		BANK HAPOALIM BM	183,000	23.75	4,346,250.00	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	238,000	20.43	4,862,340.00	
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	12.57	2,162,040.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	80.12	1,842,760.00	
		NICE LTD	10,600	867.30	9,193,380.00	
		AZRIELI GROUP	6,500	204.00	1,326,000.00	
	小計	銘柄数：8			28,466,520.00	
		組入時価比率：0.1%			(922,030,582)	0.1%
	合計				855,020,069,055	
					(855,020,069,055)	

(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(2021年2月18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	93,000	1,516,830.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,600	3,491,700.00	
		AMERICAN TOWER CORP	73,700	16,679,047.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	238,000	1,989,680.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,000	4,296,000.00	
		BOSTON PROPERTIES	25,000	2,318,750.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	1,680,960.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	72,100	11,761,673.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	45,200	6,250,256.00	
		DUKE REALTY CORP	62,200	2,563,884.00	

	EQUINIX INC	14,810	10,284,508.30	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,400	1,826,916.00	
	EQUITY RESIDENTIAL	60,300	4,031,658.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,700	2,854,439.00	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	2,438,046.00	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	88,000	2,666,400.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	1,706,940.00	
	INVITATION HOMES INC	92,000	2,792,200.00	
	IRON MOUNTAIN INC	49,000	1,604,260.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	99,000	2,168,100.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,300	2,657,996.00	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	1,347,580.00	
	PROLOGIS INC	122,700	12,985,341.00	
	PUBLIC STORAGE	26,500	6,202,855.00	
	REALTY INCOME CORP	55,600	3,433,856.00	
	REGENCY CENTERS CORP	26,200	1,394,102.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	18,900	4,905,684.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	54,800	5,931,004.00	
	SUN COMMUNITIES INC	15,900	2,374,824.00	
	UDR INC	46,100	1,950,030.00	
	VENTAS INC	63,900	3,235,896.00	
	VEREIT INC	37,000	1,377,510.00	
	VICI PROPERTIES INC	87,000	2,375,970.00	
	VORNADO REALTY TRUST	27,000	1,002,780.00	
	WELLTOWER INC	70,900	4,770,861.00	
	WEYERHAEUSER CO	121,000	4,133,360.00	
	WP CAREY INC	27,400	1,880,188.00	
小計	銘柄数：37	2,099,410	146,882,084.30	
			(15,531,311,593)	
	組入時価比率：1.8%		83.5%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	756,622.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	395,340.00	
小計	銘柄数：2	36,900	1,151,962.00	
			(95,946,914)	
	組入時価比率：0.0%		0.5%	
ユーロ	COVIVIO	8,500	550,800.00	

小計	GECINA SA	7,100	850,580.00	
	KLEPIERRE	32,300	597,550.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	24,200	1,396,340.00	
	銘柄数：4	72,100	3,395,270.00	
	組入時価比率：0.0%		(432,591,350)	2.3%
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	601,344.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	706,182.00	
	SEGRO PLC	193,000	1,867,468.00	
	銘柄数：3	432,000	3,174,994.00	
	組入時価比率：0.1%		(465,739,869)	2.5%
豪ドル	DEXUS	171,000	1,472,310.00	
	GOODMAN GROUP	283,000	4,924,200.00	
	GPT GROUP	330,000	1,442,100.00	
	LENDLEASE GROUP	111,000	1,315,350.00	
	MIRVAC GROUP	660,000	1,465,200.00	
	SCENTRE GROUP	910,000	2,529,800.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	400,000	1,804,000.00	
	VICINITY CENTRES	670,000	1,058,600.00	
	銘柄数：8	3,535,000	16,011,560.00	
	組入時価比率：0.1%		(1,313,428,266)	7.0%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,562,600.00	
	LINK REIT	353,000	24,268,750.00	
	銘柄数：2	823,000	27,831,350.00	
	組入時価比率：0.0%		(379,619,614)	2.0%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	539,240	1,650,074.40	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	706,779	1,498,371.48	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	758,500.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	427,980	830,281.20	
	SUNTEC REIT	300,000	444,000.00	
	銘柄数：5	2,343,999	5,181,227.08	
小計			(412,788,361)	

		組入時価比率：0.0%		2.2%	
合計				18,631,425,967	(18,631,425,967)

(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	2021年 2月18日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	9,428,519,363	—	9,691,791,852	263,272,489
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	137,734,558	—	137,449,000	△285,558
米ドル	137,734,558	—	137,449,000	△285,558
合計	—	—	—	262,986,931

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	608,365,010
コール・ローン	515,647,112
国債証券	564,579,425,024
派生商品評価勘定	740,943
未収入金	908,446,286
未収利息	4,382,866,855
前払費用	230,293,771
その他未収収益	7,036,682
流動資産合計	571,232,821,683
資産合計	571,232,821,683
負債の部	
流動負債	
未払解約金	431,624,705
未払利息	473
その他未払費用	3,403,555
流動負債合計	435,028,733
負債合計	435,028,733
純資産の部	
元本等	
元本	230,944,321,776
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	339,853,471,174
元本等合計	570,797,792,950
純資産合計	570,797,792,950
負債純資産合計	571,232,821,683

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2021年 2月18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	2,4716円
(10,000口当たり純資産額)	(24,716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	
	155,797,893,908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	163,442,654,684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19日 至 2021年 2月18日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月18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

2021年 2月18日現在

期首	2020年 2月19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	254,119,180,473円
同期中における追加設定元本額	35,370,890,964円
同期中における一部解約元本額	58,545,749,661円
期末元本額	230,944,321,776円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	82,860,900円
バランスセレクト50	82,689,863円
バランスセレクト70	74,986,687円
野村外国債券インデックスファンド	278,376,313円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,670,084,373円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	23,435,220,667円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,612,006,476円
野村資産設計ファンド2015	20,136,191円
野村資産設計ファンド2020	20,305,119円
野村資産設計ファンド2025	36,970,851円
野村資産設計ファンド2030	37,451,298円
野村資産設計ファンド2035	26,943,637円
野村資産設計ファンド2040	47,409,021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）	81,591,670,666円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,581,450,930円
のむラップ・ファンド（普通型）	13,003,648,989円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,745,091,321円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	572,868,778円
野村資産設計ファンド2045	6,078,611円
野村インデックスファンド・外国債券	827,917,954円
マイ・ロード	8,950,213,455円
ネクストコア	261,561,784円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	177,402,418円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	8,312,345,441円

野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	755,077,096円
野村資産設計ファンド2050	7,552,503円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,926,636円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,023,583円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,324,827円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	939,107円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	532,803,765円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	430,865,064円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,590,907円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,110,606円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	4,528,418円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,368,629円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	3,387,665円
野村6資産均等バランス	1,304,250,404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）	6,361,094,995円
世界6資産分散ファンド	62,837,522円
野村資産設計ファンド2060	2,554,385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	4,355,015,935円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	2,020,690,213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）	8,162,715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）	1,272,780,927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）	209,724,282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）	1,443,465,242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）	1,217,063,329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）	2,654,987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）	9,107,562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）	257,754円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,234,169,775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）	12,698,185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）	65,608,222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）	13,540,988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）	169,950,148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）	170,842,047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）	1,837,206,142円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	94,950,591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）	1,294,866,714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）	1,000,000,340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）	5,535,313円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,351,371円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	6,801,163円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	5,880,133円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	584,830,901円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	5,226,179,421円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	6,093,974,981円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	4,570,700,051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）	17,599,267,121円

マイバランスDC30	1,830,280,344円
マイバランスDC50	1,323,034,408円
マイバランスDC70	868,254,996円
野村DC外国債券インデックスファンド	6,923,351,376円
野村DC運用戦略ファンド	5,039,842,450円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	576,781,399円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	192,680,964円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	307,524,236円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	149,544,914円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	12,829,238円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	31,437,962円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	13,006,334円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	5,974,346円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	4,039,793円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,260,846円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	81,329,333円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	55,469,547円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	28,242,496円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	34,364,522円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	867,864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(2021年2月18日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2021年2月18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	38,800,000.00	44,700,327.64	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	48,366,223.18	
		US TREASURY BOND	50,700,000.00	64,353,347.76	
		US TREASURY BOND	12,000,000.00	16,143,750.00	
		US TREASURY BOND	46,200,000.00	61,341,324.66	
		US TREASURY BOND	48,000,000.00	63,183,748.80	
		US TREASURY BOND	28,200,000.00	37,316,529.84	
		US TREASURY BOND	100,000.00	140,093.75	

US TREASURY BOND	500,000.00	584,960.90	
US TREASURY BOND	4,300,000.00	5,735,460.83	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,371,425.45	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,847,687.36	
US TREASURY N/B	600,000.00	607,382.76	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,423,967.52	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,394.53	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,916,343.24	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,564,257.55	
US TREASURY N/B	400,000.00	409,765.60	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,972,058.35	
US TREASURY N/B	500,000.00	509,921.85	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,332,347.64	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,450,873.36	
US TREASURY N/B	26,200,000.00	26,758,796.22	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,470,538.44	
US TREASURY N/B	200,000.00	204,562.50	
US TREASURY N/B	900,000.00	918,984.33	
US TREASURY N/B	33,400,000.00	34,129,319.06	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,189,514.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,257.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,750.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,025,703.10	
US TREASURY N/B	900,000.00	920,390.58	
US TREASURY N/B	32,400,000.00	33,275,810.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,320.31	
US TREASURY N/B	900,000.00	923,906.25	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,645,749.92	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,992.18	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,548,046.80	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,287,206.41	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,367.18	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,750,000.00	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,642,312.48	
US TREASURY N/B	50,900,000.00	52,522,437.50	

US TREASURY N/B	100,000.00	104,398.43	
US TREASURY N/B	400,000.00	414,968.72	
US TREASURY N/B	75,600,000.00	77,705,573.40	
US TREASURY N/B	16,100,000.00	16,916,319.91	
US TREASURY N/B	400,000.00	411,593.72	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,031.25	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,491,014.50	
US TREASURY N/B	400,000.00	422,937.48	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,056,060.76	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,511,937.04	
US TREASURY N/B	9,100,000.00	9,641,733.92	
US TREASURY N/B	800,000.00	823,124.96	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,859.37	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,414,554.58	
US TREASURY N/B	47,100,000.00	50,087,906.25	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,879,335.45	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,232,108.83	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,065,234.30	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,305,498.24	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,070,625.00	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	11,013,233.58	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,072,578.10	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	45,591,981.18	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,695,218.52	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	31,488,343.75	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	45,526,250.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	855,562.48	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,558,335.83	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,387,648.34	
US TREASURY N/B	800,000.00	860,687.44	
US TREASURY N/B	400,000.00	425,968.72	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,799,476.52	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	22,418,514.58	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,720,514.74	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,038,390.34	

US TREASURY N/B	300,000.00	316,570.29	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	45,465,491.12	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,569,124.88	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	36,628,733.52	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,452,195.14	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,083,671.80	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	19,052,312.50	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,079,312.50	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	17,806,834.64	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	35,663,437.50	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	38,014,687.50	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	8,626,078.12	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,103,593.70	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,508,398.13	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,753,718.36	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	28,841,483.70	
US TREASURY N/B	700,000.00	771,093.75	
US TREASURY N/B	29,200,000.00	32,539,750.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	111,546.87	
US TREASURY N/B	50,600,000.00	54,703,341.22	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,107,031.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	11,000,000.00	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	16,512,889.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,103,906.20	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,377,359.16	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,893,234.24	
US TREASURY N/B	300,000.00	323,460.93	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,049,500.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,457,500.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,513,281.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,887,000.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,941,483.40	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	31,537,500.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,835.93	
US TREASURY N/B	200,000.00	208,703.12	

US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,287,866.34	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,690,545.60	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	41,651,560.60	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	9,472,125.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,089,140.60	
US TREASURY N/B	500,000.00	561,718.75	
US TREASURY N/B	40,600,000.00	46,020,733.36	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	11,238,819.57	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,386,562.44	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,204,671.77	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,744,890.54	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	18,821,562.50	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	15,722,014.38	
US TREASURY N/B	44,700,000.00	62,160,937.50	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	15,046,593.48	
US TREASURY N/B	200,000.00	296,500.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	142,210.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	127,304.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	139,296.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,484.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	141,734.37	
US TREASURY N/B	100,000.00	146,156.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	142,164.06	
US TREASURY N/B	200,000.00	267,812.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	140,390.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	149,343.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,074.21	
US TREASURY N/B	100,000.00	132,367.18	
US TREASURY N/B	300,000.00	364,382.79	
US TREASURY N/B	100,000.00	121,617.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	119,257.81	
US TREASURY N/B	200,000.00	229,328.12	
US TREASURY N/B	600,000.00	687,656.22	
US TREASURY N/B	290,000.00	352,463.27	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,007.81	

小計	US TREASURY N/B	4,300,000.00	5,642,406.25	
	US TREASURY N/B	15,200,000.00	19,218,500.00	
	US TREASURY N/B	25,000,000.00	30,437,500.00	
	US TREASURY N/B	35,100,000.00	41,892,397.56	
	US TREASURY N/B	39,900,000.00	43,743,491.19	
	US TREASURY N/B	23,400,000.00	27,972,140.04	
	US TREASURY N/B	17,500,000.00	20,491,406.25	
	US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,430,750.00	
	US TREASURY N/B	51,500,000.00	56,472,968.75	
	US TREASURY N/B	28,200,000.00	30,914,250.00	
	US TREASURY N/B	34,500,000.00	36,047,107.65	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	16,668,359.02	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,403,593.60	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,044,117.06	
	US TREASURY N/B	11,400,000.00	13,105,546.02	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	10,693,546.41	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	11,439,335.70	
	US TREASURY N/B	5,100,000.00	6,283,359.12	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	12,668,906.25	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	7,867,570.16	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,982,525.00	
	US TREASURY N/B	100,000.00	118,101.56	
	US TREASURY N/B	11,250,000.00	11,743,066.12	
	US TREASURY N/B	300,000.00	321,398.43	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	987,031.20	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,799,702.96	
	US TREASURY N/B	9,100,000.00	7,690,921.42	
	US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,026,702.54	
	銘柄数：176	2,080,760,000.00	2,303,753,734.89	
			(243,598,919,927)	
	組入時価比率：42.7%		43.1%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	14,350,000.00	14,830,294.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,194.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	300,441.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,000,000.00	12,155,040.00	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,134,826.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,590,365.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,148,730.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	529,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,278,516.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,533,460.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,972,727.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	313,260.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	9,679,758.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	203,532.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	108,532.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,380,000.00	15,759,706.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,107,770.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	15,416,280.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	5,797,090.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,800,000.00	6,859,536.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	13,733,189.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,617,707.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	431,868.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	133,357.00	
	銘柄数：24	111,840,000.00	134,936,580.10	
			(11,238,867,756)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,795,736.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	315,414.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	87,300,000.00	97,513,227.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	77,585,300.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	53,500,770.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	127,366,751.96	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	54,736,180.26	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,100,000.00	78,928,376.70	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	463,007.40	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	77,298,554.43	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	31,191,033.84	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,200,000.00	58,399,360.74	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	49,187,700.00	

小計	MEXICAN FIXED RATE BONDS	122,700,000.00	134,730,735.00	
	銘柄数：14	774,400,000.00	887,012,147.53 (4,647,943,653)	
	組入時価比率：0.8%		0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	841,470.40	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	647,880.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,200,000.00	4,489,561.44	
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,943,510.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,435,200.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,041,229.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,802,632.40	
	BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	8,443,326.60	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,568,554.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,157,016.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,085,586.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	7,136,473.50	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	5,799,040.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	4,510,345.00	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	114,760.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	596,029.00	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	127,296.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,600,000.00	2,788,838.40	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	6,938,036.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,463,870.40	
	BELGIUM KINGDOM	3,200,000.00	4,100,630.40	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,780,272.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,503,580.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,383,279.50	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	12,000,000.00	20,263,191.60	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	1,007,638.30	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,650,000.00	4,702,359.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	5,793,195.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,300,000.00	22,640,313.92	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,284,638.40	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,002,986.70	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	16,884,243.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,837,020.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	502,551.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	974,016.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,469,740.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,582,293.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,461,508.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	29,917,328.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,600,000.00	8,377,860.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,207,165.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,519,500.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,956,760.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,330,628.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,649,020.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,177,223.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	2,966,958.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	6,388,082.19	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000,000.00	18,942,440.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,569,593.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	14,626,672.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	5,008,848.00	
BUNDES Obligation	250,000.00	252,827.50	
BUNDES Obligation	1,000,000.00	1,015,380.00	
BUNDES Obligation	2,000,000.00	2,051,900.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	413,412.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	310,251.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	407,351.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,300,000.00	8,715,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,756,626.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	25,100,000.00	30,208,101.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,827,381.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,800,000.00	11,584,404.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	8,167,390.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,831,301.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,798,152.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,800,000.00	22,031,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,036,080.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	737,219.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	29,559,872.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	214,520.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,200,000.00	26,176,150.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	645,888.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,236,060.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	30,037,512.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	10,243,456.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,400,000.00	15,862,753.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	17,912,292.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,800,000.00	6,888,556.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	10,336,325.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,933,142.98	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,201,004.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,600,000.00	18,820,884.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,850,000.00	15,546,370.50	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	200,000.00	201,406.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,583,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,200,000.00	10,380,744.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,938,190.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	917,865.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	407,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	8,938,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,189,531.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	32,400,000.00	35,618,616.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,914,763.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	3,591,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,217,353.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	562,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	23,380,610.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,816,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	320,040.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	639,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,605,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,984,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,100,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,279,952.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	851,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,204,906.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,844,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,292,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,900,000.00	14,588,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,220,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,479,370.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,500,000.00	31,855,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,709,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,900,000.00	42,221,790.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,104,948.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	24,566,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	552,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	17,159,870.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,677,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,400,000.00	31,189,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	10,846,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,883,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	649,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	8,245,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	265,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,100,000.00	16,815,490.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	14,900,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,714,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	4,081,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	10,922,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,500,000.00	10,469,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,899,451.28	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	503,852.50	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	103,660.00	

FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	104,745.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	407,029.84	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	759,080.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,337,820.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	106,824.55	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,110,848.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,080,092.28	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,562,928.80	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	876,672.00	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	229,564.00	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,012,480.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	600,835.24	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	381,127.80	
FRANCE (GOVT OF)	4,200,000.00	4,255,230.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,635,360.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,656,517.67	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,880.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	11,056,318.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,841,743.80	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	13,595,790.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,896,003.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,851,338.20	
FRANCE (GOVT OF)	7,700,000.00	8,399,160.00	
FRANCE (GOVT OF)	4,900,000.00	5,295,998.40	
FRANCE (GOVT OF)	11,600,000.00	12,564,888.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,127,192.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,500,000.00	10,641,218.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	11,649,885.40	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	115,800.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	126,074.71	
FRANCE (GOVT OF)	10,400,000.00	14,173,276.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,475,700.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	512,171.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	200,000.00	201,661.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,100,000.00	28,436,707.50	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,078,910.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,600,000.00	28,994,560.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,268,359.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	12,468,512.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,443,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	41,261,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,400,000.00	4,120,630.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,031,685.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,000,000.00	15,158,546.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,400,000.00	34,324,672.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,000,000.00	23,225,664.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	495,211.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,900,000.00	10,681,950.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,550,000.00	41,843,470.06	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,800,000.00	11,695,526.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	20,105,467.50	
IRISH GOVERNMENT	4,630,000.00	5,761,062.70	
IRISH GOVERNMENT	6,500,000.00	7,078,838.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,217,899.20	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	666,087.60	
IRISH TSY 1.3% 2033	3,200,000.00	3,694,739.20	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,294,750.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,856,895.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,400,000.00	4,192,132.00	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,955,874.40	
IRISH TSY 2.4% 2030	5,500,000.00	6,812,745.50	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	2,160,164.80	
IRISH TSY 2022	8,200,000.00	8,284,673.20	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,854,068.58	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	104,140.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	217,080.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	4,051,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	423,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,011.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,700,000.00	8,408,891.26	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,558,050.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	2,010,390.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,704,299.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	17,466,000.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,088,980.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,400,000.00	2,522,880.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	8,900,000.00	11,773,810.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	6,112,977.20	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	543,345.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	1,062,037.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,900,000.00	11,513,319.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,484,544.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,040.93	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	214,300.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	913,545.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	159,613.95	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,326,780.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	759,072.72	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,409,543.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,906,060.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,145,224.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	10,924,262.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	9,600,000.00	10,233,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	10,048,389.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	661,344.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,308,030.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,600,000.00	7,204,960.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,187,486.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	2,109,810.06	
	REPUBLIC OF IRELAND	4,450,000.00	4,871,130.64	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,578,492.80	
	SPANISH GOVERNMENT	27,800,000.00	44,699,620.00	
	SPANISH GOVERNMENT	2,500,000.00	3,864,792.50	
小計	銘柄数：239	1,397,650,000.00	1,833,996,342.75 (233,669,474,029)	

	組入時価比率：40.9%		41.4%	
英ポンド	UK TREASURY	1,050,000.00	1,094,681.70	
	UK TREASURY	400,000.00	411,170.60	
	UK TREASURY	2,500,000.00	2,506,259.00	
	UK TREASURY	16,700,000.00	17,011,558.54	
	UK TREASURY	2,300,000.00	2,432,242.18	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,649,833.92	
	UK TREASURY	7,450,000.00	8,165,803.45	
	UK TREASURY	14,000,000.00	16,782,612.00	
	UK TREASURY	200,000.00	204,527.20	
	UK TREASURY	200,000.00	217,130.00	
	UK TREASURY	160,000.00	171,364.22	
	UK TREASURY	400,000.00	424,648.80	
	UK TREASURY	12,130,000.00	15,363,615.40	
	UK TREASURY	200,000.00	218,782.40	
	UK TREASURY	7,900,000.00	11,280,805.00	
	UK TREASURY	7,200,000.00	10,066,432.32	
	UK TREASURY	7,000,000.00	9,706,555.60	
	UK TREASURY	12,300,000.00	18,119,991.00	
	UK TREASURY	1,050,000.00	1,545,474.00	
	UK TREASURY	100,000.00	161,879.72	
	UK TREASURY	600,000.00	929,144.64	
	UK TREASURY	500,000.00	786,601.40	
	UK TREASURY	400,000.00	411,630.56	
	UK TREASURY	570,000.00	948,329.52	
	UK TREASURY	18,440,000.00	27,625,369.68	
	UK TREASURY	5,900,000.00	10,011,301.72	
	UK TREASURY	8,200,000.00	8,870,802.64	
	UK TREASURY	16,100,000.00	18,451,340.60	
	UK TREASURY	5,350,000.00	9,441,155.70	
	UK TREASURY	6,750,000.00	11,422,134.00	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,136,632.00	
	UK TREASURY	700,000.00	834,834.70	
	UK TREASURY	750,000.00	1,442,167.50	
	UK TREASURY	100,000.00	150,329.00	

小計	UK TREASURY	200,000.00	381,670.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	26,400,000.00	37,803,216.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	6,500,000.00	12,361,180.00	
	銘柄数：37	193,300,000.00	260,543,206.71	
	組入時価比率：6.7%		(38,219,082,992)	6.8%
スウェーデン ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	32,050,000.00	33,622,373.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,290,662.90	
	SWEDISH GOVERNMENT	33,950,000.00	37,816,905.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,740,311.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,641,505.28	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	19,855,111.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,100,000.00	19,637,196.06	
	銘柄数：7	134,700,000.00	149,604,064.94	
	組入時価比率：0.3%		(1,902,963,706)	0.3%
ノルウェー クロネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,483,584.58	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	40,564,314.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,889,781.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,850,275.92	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,013,760.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,639,920.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,000,000.00	22,990,990.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	6,500,000.00	6,566,267.50	
	銘柄数：8	97,800,000.00	102,998,893.30	
デンマーク クロネ	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	405,040.00	
	KINGDOM OF DENMARK	24,270,000.00	25,614,558.00	
	KINGDOM OF DENMARK	29,300,000.00	32,426,310.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,604,320.00	
	KINGDOM OF DENMARK	26,300,000.00	28,048,950.00	
	KINGDOM OF DENMARK	35,800,000.00	65,185,810.66	
	銘柄数：6	131,770,000.00	168,284,988.66	
	組入時価比率：0.5%		(2,882,721,855)	0.5%

ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	35,300,000.00	36,254,692.03	
	POLAND GOVERNMENT BOND	33,100,000.00	35,443,231.75	
	POLAND GOVERNMENT BOND	51,800,000.00	58,122,190.00	
	銘柄数：3	120,200,000.00	129,820,113.78	
	組入時価比率：0.6%		(3,680,400,225)	0.7%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,640,000.00	13,643,616.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	83,020.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,126,406.92	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,797,240.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	19,600,000.00	21,973,879.48	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,213,764.41	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,400,000.00	15,411,337.52	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,599,045.44	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	14,000,000.00	15,274,000.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,367,678.18	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	11,791,535.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	15,015,700.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	24,578,350.38	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,511,776.31	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	10,243,802.03	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,465,490.65	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,250,000.00	12,905,661.22	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	828,520.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	439,069.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,009,670.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,582,700.00	
	銘柄数：21	166,750,000.00	189,862,265.18	
	組入時価比率：2.7%		(15,574,401,612)	2.8%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	406,520.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,981,595.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	308,190.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,100,000.00	4,328,780.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,516,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,065,300.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,183,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	750,190.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,504,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	557,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	342,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,850,000.00	3,288,387.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,468,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	2,122,147.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,272,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,213,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,052,940.00	
	銘柄数：17	27,270,000.00	30,362,399.70	
			(2,418,972,384)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,124,544.52	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	426,794.56	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,896,791.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,776,394.07	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	452,825.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,763,894.42	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	515,025.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,926,405.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,051,128.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,295,964.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,194,344.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	643,907.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,600,000.00	17,088,942.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,936,831.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,371,641.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,349,985.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	299,098.35	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	12,700,000.00	14,233,740.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,838,401.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	827,020.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,487,836.63	

	小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,088,012.77	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,519,582.11	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	348,518.10	
		銘柄数：24	100,380,000.00	108,457,633.68	
		組入時価比率：0.5%		(2,842,674,578)	0.5%
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	2,600,000.00	2,736,208.02	
		ISRAEL FIXED BOND	9,800,000.00	9,896,523.14	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,102,301.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,435,370.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,186,561.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,550,561.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,314,007.00	
		ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	8,607,905.80	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,434,233.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,545,041.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,500,000.00	5,503,428.15	
		ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	9,889,726.20	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,676,061.50	
		銘柄数：13	70,400,000.00	80,877,928.31	
		組入時価比率：0.5%		(2,619,636,097)	0.5%
	小計				
合計				564,579,425,024	
				(564,579,425,024)	

(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(2021年 2月18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	33,000,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	3,775,000	
		US TREASURY N/B	5,500,000	
		US TREASURY N/B	1,034,000	
		US TREASURY N/B	15,000,000	

US TREASURY N/B	6,400,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY BOND	425,000	
US TREASURY N/B	12,000,000	
US TREASURY N/B	7,586,000	
US TREASURY N/B	2,099,000	
US TREASURY N/B	18,000,000	
US TREASURY N/B	1,206,000	
US TREASURY N/B	10,000,000	
US TREASURY N/B	4,335,000	
US TREASURY N/B	12,000,000	
US TREASURY N/B	565,000	
US TREASURY BOND	5,000,000	
US TREASURY BOND	2,000,000	
US TREASURY BOND	40,000,000	
US TREASURY N/B	18,600,000	
US TREASURY BOND	36,000,000	
US TREASURY BOND	40,000,000	
US TREASURY BOND	1,000,000	
US TREASURY N/B	9,945,000	
US TREASURY N/B	9,980,000	
US TREASURY N/B	29,000,000	
US TREASURY N/B	9,265,000	
US TREASURY N/B	8,400,000	
US TREASURY N/B	17,000,000	
US TREASURY N/B	340,000	
US TREASURY N/B	1,700,000	
US TREASURY N/B	1,300,000	
US TREASURY N/B	230,000	
US TREASURY N/B	6,035,000	
US TREASURY N/B	12,500,000	
US TREASURY N/B	250,000	
US TREASURY N/B	25,000,000	
US TREASURY N/B	75,000	
US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	29,000,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	40,000,000	
US TREASURY N/B	16,000,000	
US TREASURY N/B	11,540,000	
US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	22,000,000	
US TREASURY N/B	950,000	
US TREASURY N/B	2,000,000	
US TREASURY N/B	1,098,000	
US TREASURY N/B	340,000	
US TREASURY N/B	15,000,000	
US TREASURY N/B	6,800,000	
US TREASURY N/B	85,000	

	US TREASURY N/B	5,000,000	
	US TREASURY N/B	15,045,000	
	US TREASURY N/B	7,820,000	
	US TREASURY N/B	36,000,000	
	US TREASURY N/B	7,369,000	
	US TREASURY N/B	1,020,000	
	US TREASURY N/B	7,395,000	
	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 N/B	1,550,000	
	US TREASURY BOND	335,000	
	US TREASURY N/B	30,000,000	
	US TREASURY N/B	2,000,000	
	US TREASURY N/B	300,000	
	US TREASURY N/B	4,186,000	
	US TREASURY N/B	1,339,000	
	US TREASURY N/B	17,000,000	
	US TREASURY N/B	765,000	
	US TREASURY N/B	1,105,000	
	US TREASURY N/B	85,000	
	US TREASURY N/B	12,000,000	
	US TREASURY N/B	155,000	
	US TREASURY N/B	12,750,000	
	US TREASURY N/B	26,000,000	
	US TREASURY N/B	680,000	
	US TREASURY N/B	425,000	
	US TREASURY N/B	36,000,000	
	US TREASURY N/B	210,000	
	US TREASURY N/B	8,415,000	
	US TREASURY N/B	1,300,000	
	US TREASURY N/B	10,000,000	
	US TREASURY N/B	2,000,000	
	US TREASURY N/B	24,000,000	
	US TREASURY N/B	23,000,000	
	US TREASURY N/B	16,000,000	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,500,000	
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	490,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,600,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	205,417	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,260,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,160,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,020,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,300,000	
	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,000,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,300,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,000,000	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	5,000,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,000,000	
	SPANISH GOVERNMENT	18,000,000	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,700,000	

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	2021年 2月18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	242,388,943	—	241,648,000	740,943
米ドル	74,220,748	—	74,011,000	209,748
メキシコペソ	78,557,205	—	78,450,000	107,205
ユーロ	89,610,990	—	89,187,000	423,990
合計	242,388,943	—	241,648,000	740,943

（注）時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

貸借対照表

(単位：円)

(2021年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	54,502,743
コール・ローン	154,626,282
投資証券	74,738,310,081
派生商品評価勘定	16,220,518
未収入金	57,875,179
未収配当金	147,227,836
差入委託証拠金	169,795,835
流動資産合計	75,338,558,474
資産合計	75,338,558,474
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,800
未払解約金	101,259,260
未払利息	141
その他未払費用	179,700
流動負債合計	101,469,901
負債合計	101,469,901
純資産の部	
元本等	
元本	41,352,191,880
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	33,884,896,693
元本等合計	75,237,088,573
純資産合計	75,237,088,573
負債純資産合計	75,338,558,474

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 国内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。 外国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。 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	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。 配当株式 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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。 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）

2021年 2月18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	1.8194円
(10,000口当たり純資産額)	(18,194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19日 至 2021年 2月18日	
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制	

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月18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

2021年 2月18日現在	
期首	2020年 2月19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	32,694,147,610円
同期中における追加設定元本額	16,686,515,441円
同期中における一部解約元本額	8,028,471,171円
期末元本額	41,352,191,880円
期末元本額の内訳＊	
野村世界REITインデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	11,070,044,141円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,656,790,066円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,027,161,187円
のむラップ・ファンド（積極型）	3,063,402,821円
マイ・ロード	1,078,113,813円
野村世界REITインデックス（野村SMA・EW向け）	1,957,354,724円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	232,011,450円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	355,096,821円
野村世界REITインデックスファンド（確定拠出年金向け）	13,912,216,857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(2021年2月18日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2021年2月18日現在)

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	149	18,893,200	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	179	20,280,700	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	241	31,980,700	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	243	141,426,000	
		MCUBS M i d C i t y 投資法 人 投資証券	899	97,991,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	818	117,873,800	
		産業ファンド投資法人 投資証券	1,024	193,126,400	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	679	214,564,000	
		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	463	85,469,800	
		アクティビア・プロパティーズ投資 法人 投資証券	339	153,397,500	
		G L P 投資法人 投資証券	2,133	379,460,700	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	301	93,009,000	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	1,216	409,792,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	108	60,048,000	
		O n e リート投資法人 投資証券	121	35,634,500	
		イオンリート投資法人 投資証券	747	109,062,000	
		ヒューリックリート投資法人 投資 証券	576	98,784,000	
		日本リート投資法人 投資証券	227	87,622,000	

インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	4,417	72,129,610	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	2,124	174,805,200	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	159	19,302,600	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	272	71,699,200	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	146	19,520,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	292	32,791,600	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2,324	392,988,400	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	141	11,773,500	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	822	134,643,600	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	816	41,860,800	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	63	7,434,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	253	130,801,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	131	10,021,500	
投資法人みらい 投資証券	787	34,864,100	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	160	21,184,000	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	169	69,543,500	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	195	29,737,500	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	109	11,946,400	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	221	24,464,700	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	220	28,534,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	816	521,424,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	681	442,650,000	

日本リテールファンド投資法人 投資証券	1,278	279,882,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	1,363	249,837,900	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	474	179,409,000	
プレミアム投資法人 投資証券	641	87,368,300	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	459	82,206,900	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	465	52,638,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	1,540	225,918,000	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	489	71,100,600	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	2,987	121,272,200	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	234	109,512,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	428	61,674,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	445	137,727,500	
福岡リート投資法人 投資証券	351	61,354,800	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	215	146,415,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	748	64,477,600	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	150	102,150,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	336	49,089,600	
スターツプロシード投資法人 投資証券	102	21,593,400	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	986	283,869,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	2,202	132,780,600	
大和証券リビング投資法人 投資証券	1,007	98,887,400	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	625	83,125,000	
小計	銘柄数：62	43,306	7,354,824,710

	組入時価比率：9.8%		9.8%	
米ドル	ACADIA REALTY TRUST	42,000	770,280.00	
	AGREE REALTY CORP	28,700	1,849,715.00	
	ALEXANDER & BALDWIN INC	35,500	620,185.00	
	ALEXANDERS INC	1,100	291,401.00	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	61,200	10,373,400.00	
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	24,600	718,320.00	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	68,600	2,939,510.00	
	AMERICAN FINANCE TRUST INC	51,000	428,400.00	
	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	132,000	4,168,560.00	
	AMERICOLD REALTY TRUST	100,700	3,589,955.00	
	APARTMENT INCOME REIT CO	73,100	3,096,516.00	
	APARTMENT INVT&MGMT CO-A	72,700	359,138.00	
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	102,000	1,436,160.00	
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	28,000	349,160.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	69,000	12,351,000.00	
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	12,000	136,680.00	
	BOSTON PROPERTIES	69,800	6,473,950.00	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	83,000	982,720.00	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	146,000	2,811,960.00	
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	19,000	353,590.00	
	BRT APARTMENTS CORP	5,000	78,150.00	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	48,000	5,042,880.00	
	CARETRUST REIT INC ACQUIRES	48,100	1,088,503.00	
	CENTERSPACE	6,400	456,704.00	
	CHATHAM LODGING TRUST	24,000	292,080.00	
	CIM COMMERCIAL TRUST CORP	5,000	58,350.00	
	CITY OFFICE REIT INC	21,000	213,150.00	
	CLIPPER REALTY INC	6,000	45,600.00	
	COLONY CAPITAL INC	242,000	1,280,180.00	
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	56,000	796,320.00	
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	10,700	506,538.00	
	COREPOINT LODGING INC	20,000	166,200.00	
	CORESITE REALTY CORP	21,100	2,556,687.00	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	55,100	1,443,620.00	

COUSINS PROPERTIES INC	74,100	2,482,350.00	
CTO REALTY GROWTH INC	2,300	112,930.00	
CUBESMART	96,200	3,454,542.00	
CYRUSONE INC	59,300	4,185,987.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	96,000	918,720.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	138,300	19,124,124.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	117,000	509,535.00	
DOUGLAS EMMETT INC	82,300	2,390,815.00	
DUKE REALTY CORP	183,700	7,572,114.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	240,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	40,900	894,483.00	
EASTGROUP PROPERTIES	19,500	2,786,355.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	68,000	672,520.00	
EPR PROPERTIES	36,500	1,535,920.00	
EQUINIX INC	43,980	30,541,031.40	
EQUITY COMMONWEALTH	60,800	1,738,880.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	83,500	5,188,690.00	
EQUITY RESIDENTIAL	169,300	11,319,398.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	51,700	1,175,141.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	32,220	8,595,329.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	63,700	7,502,586.00	
FARMLAND PARTNERS INC	12,000	137,040.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	33,800	3,455,036.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	63,400	2,709,082.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	36,200	1,009,980.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	44,000	182,600.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	106,400	4,698,624.00	
GEO GROUP INC/THE	58,000	497,640.00	
GETTY REALTY CORP	17,600	498,256.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16,200	311,040.00	
GLADSTONE LAND CORP	10,000	189,500.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,000	280,350.00	
GLOBAL NET LEASE INC	44,000	807,840.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	68,000	2,063,120.00	

HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	108,900	3,092,760.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	266,000	8,059,800.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	19,000	170,620.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	51,900	2,078,076.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	347,000	5,434,020.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	76,100	1,837,815.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	46,000	654,120.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	31,400	700,220.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,900	2,337,178.00	
INVITATION HOMES INC	277,000	8,406,950.00	
IRON MOUNTAIN INC	141,900	4,645,806.00	
JBG SMITH PROPERTIES	55,700	1,772,374.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	330,000	226,050.00	
KILROY REALTY CORP	51,500	3,049,830.00	
KIMCO REALTY CORP	215,000	3,829,150.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	42,000	769,020.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	135,000	1,468,800.00	
LIFE STORAGE INC	36,300	2,981,319.00	
LTC PROPERTIES INC	19,200	792,768.00	
MACERICH CO /THE	54,000	684,720.00	
MACK-CALI REALTY CORP	43,000	584,370.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	709,999	496,999.30	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	279,900	6,129,810.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	56,400	7,767,408.00	
MONMOUTH REIT-CLASS A	48,000	852,480.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	85,600	3,626,016.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	30,500	1,162,050.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	22,000	1,500,840.00	
NETSTREIT CORP	8,000	147,680.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	35,000	193,550.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10,900	462,814.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	23,200	579,536.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	111,700	4,123,964.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,032	168,832.64	

PARAMOUNT GROUP INC	81,000	728,190.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	116,000	2,329,280.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	64,000	1,447,680.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	102,000	1,815,600.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	62,000	1,063,300.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	11,000	165,550.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	26,000	203,060.00	
PRIME US REIT	220,000	178,200.00	
PROLOGIS INC	364,900	38,617,367.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	9,800	1,420,314.00	
PUBLIC STORAGE	74,990	17,552,909.30	
QTS REALTY TRUST INC CL A	32,100	2,015,880.00	
REALTY INCOME CORP	173,500	10,715,360.00	
REGENCY CENTERS CORP	77,600	4,129,096.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	57,000	892,620.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	108,000	1,121,040.00	
RETAIL VALUE INC	8,500	143,310.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	64,400	3,280,536.00	
RLJ LODGING TRUST	81,000	1,184,220.00	
RPT REALTY	41,000	431,320.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	27,500	2,015,750.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	103,000	1,818,980.00	
SAFEHOLD INC	6,900	578,979.00	
SAUL CENTERS INC	6,700	231,150.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	18,000	326,700.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	81,000	996,300.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	161,700	17,500,791.00	
SITE CENTERS CORP	75,000	939,750.00	
SL GREEN REALTY CORP	36,200	2,227,024.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	56,100	2,310,759.00	
STAG INDUSTRIAL INC	74,500	2,394,430.00	
STORE CAPITAL CORP	116,300	3,809,988.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	53,000	532,650.00	
SUN COMMUNITIES INC	53,100	7,931,016.00	

小計	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	105,000	1,261,050.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	46,000	658,260.00	
	TERRENO REALTY CORP	34,200	2,034,216.00	
	UDR INC	145,400	6,150,420.00	
	UMH PROPERTIES INC	18,000	292,500.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,300	385,875.00	
	URBAN EDGE PROPERTIES	53,000	870,260.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	14,000	212,520.00	
	VENTAS INC	185,100	9,373,464.00	
	VEREIT INC	107,400	3,998,502.00	
	VICI PROPERTIES INC	265,100	7,239,881.00	
	VORNADO REALTY TRUST	77,300	2,870,922.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	11,112	70,561.20	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	40,700	918,192.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	59,000	1,475,590.00	
	WELLTOWER INC	206,300	13,881,927.00	
	WHITESTONE REIT	20,000	176,800.00	
	WP CAREY INC	86,400	5,928,768.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	56,000	958,720.00	
	銘柄数：155	12,045,433	470,262,394.24	
			(49,725,545,566)	
	組入時価比率：66.1%		66.6%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	30,700	1,111,340.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	32,000	343,680.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	9,000	100,350.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,800	393,120.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	41,500	2,107,370.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	79,969	1,027,601.65	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	43,000	372,810.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	22,000	319,440.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	26,000	405,600.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	42,000	553,560.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	12,300	237,513.00	

小計	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	52,000	779,480.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	15,100	1,140,805.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	69,000	923,910.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	36,000	483,120.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	25,300	462,484.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	8,200	160,966.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	9,100	135,772.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	45,000	596,250.00	
	PLAZA RETAIL REIT	31,000	115,940.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	76,000	1,365,720.00	
	SLATE GROCERY REIT	8,500	98,685.00	
	SLATE OFFICE REIT	13,000	55,900.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	35,000	875,000.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	40,500	575,100.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	20,000	127,400.00	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	20,000	409,800.00	
	銘柄数：27	852,969	15,278,716.65	
			(1,272,564,309)	
	組入時価比率：1.7%		1.7%	
ユーロ	AEDIFICA	16,360	1,698,168.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	89,000	1,216,630.00	
	ALTAREA	1,800	251,280.00	
	BEFIMMO S.C.A.	12,400	432,760.00	
	CARE PROPERTY INVEST	11,700	309,465.00	
	CARMILA	23,000	265,880.00	
	COFINIMMO	13,400	1,758,080.00	
	COVIVIO	23,995	1,554,876.00	
	CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE	640,000	316,800.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	18,000	286,560.00	
	GECINA SA	26,900	3,222,620.00	
	HAMBORNER REIT AG	34,000	306,646.00	
	HIBERNIA REIT PLC	330,000	358,380.00	
	ICADE	15,200	910,480.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	27,563	107,771.33	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	125,000	976,250.00	

小計	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	11,200	244,160.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	208,570	322,449.22	
	KLEPIERRE	99,400	1,838,900.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	29,000	135,575.00	
	MERCIALYS	19,300	153,435.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	167,000	1,323,475.00	
	MONTEA	4,954	488,464.40	
	NSI NV	8,400	274,680.00	
	RETAIL ESTATES	5,300	325,950.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	68,700	3,963,990.00	
	VASTNED RETAIL NV	9,270	215,991.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	65,200	1,882,976.00	
	WERELDHAVE NV	20,000	255,400.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	7,000	353,500.00	
	銘柄数：30	2,131,612	25,751,591.95	
			(3,281,010,330)	
	組入時価比率：4.4%		4.4%	
英ボンド	AEW UK REIT PLC	70,000	57,400.00	
	ASSURA PLC	1,298,000	947,540.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	81,000	929,880.00	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	380,000	271,320.00	
	BRITISH LAND	466,000	2,189,268.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	410,000	690,440.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	300,000	322,200.00	
	CUSTODIAN REIT PLC	200,000	183,600.00	
	DERWENT LONDON PLC	55,000	1,750,100.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	289,285	208,285.20	
	GCP STUDENT LIVING PLC	230,000	353,740.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	130,000	845,000.00	
	HAMMERSON PLC	1,885,000	412,815.00	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	157,000	174,270.00	
	INTU PROPERTIES PLC	335,000	5,949.60	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	373,000	2,373,026.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	449,000	1,005,760.00	
	LXI REIT PLC	257,000	328,446.00	
	NEWRIVER REIT PLC	141,000	118,440.00	

小計	PICTON PROPERTY INCOME LTD	270,000	234,090.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	670,000	994,280.00	
	RDI REIT PLC	124,128	112,211.71	
	REGIONAL REIT LTD	205,000	156,210.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	104,000	852,800.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	300,000	120,300.00	
	SEGRO PLC	587,000	5,679,812.00	
	SHAFTESBURY PLC	149,000	915,605.00	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	200,000	126,000.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	340,000	370,600.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	180,000	194,400.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	842,000	1,567,804.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	360,000	247,680.00	
	UNITE GROUP PLC	194,000	1,868,220.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	64,000	476,480.00	
	銘柄数：34	12,095,413	27,083,972.51	
			(3,972,947,927)	
	組入時価比率：5.3%		5.3%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	212,000	555,440.00	
	APN INDUSTRIA REIT	60,411	170,963.13	
	ARENA REIT	166,550	507,977.50	
	AVENTUS GROUP	181,000	494,130.00	
	BWP TRUST	253,000	963,930.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	248,333	576,132.56	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	230,000	710,700.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	178,000	352,440.00	
	CHARTER HALL GROUP	228,000	2,922,960.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	244,000	1,149,240.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	257,000	943,190.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	160,000	494,400.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	909,230	754,660.90	
	DEXUS	539,000	4,640,790.00	
	GDI PROPERTY GROUP	262,730	294,257.60	
	GOODMAN GROUP	827,000	14,389,800.00	

小計	GPT GROUP	953,000	4,164,610.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	145,000	446,600.00	
	HOME CONSORTIUM	81,000	330,480.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	150,500	203,927.50	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	87,250	270,475.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	148,000	747,400.00	
	IRONGATE GROUP	270,000	340,200.00	
	MIRVAC GROUP	1,940,000	4,306,800.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	470,000	888,300.00	
	RURAL FUNDS GROUP	160,000	390,400.00	
	SCENTRE GROUP	2,563,000	7,125,140.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	550,000	1,298,000.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	1,181,000	5,326,310.00	
	VICINITY CENTRES	1,890,000	2,986,200.00	
	WAYPOINT REIT LTD	379,000	917,180.00	
	銘柄数：31	15,924,004	59,663,034.19	
			(4,894,158,694)	
	組入時価比率：6.5%		6.5%	
小計	ARGOSY PROPERTY LTD	410,000	629,350.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	540,000	1,193,400.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	770,000	947,100.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	530,000	858,600.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	206,000	648,900.00	
	銘柄数：5	2,456,000	4,277,350.00	
			(325,378,014)	
小計	組入時価比率：0.4%		0.4%	
香港ドル	CHAMPION REIT	960,000	4,425,600.00	
	FORTUNE REIT	700,000	5,299,000.00	
	LINK REIT	1,018,000	69,987,500.00	
	PROSPERITY REIT	610,000	1,506,700.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	500,000	2,005,000.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	740,000	2,849,000.00	
	銘柄数：6	4,528,000	86,072,800.00	
小計			(1,174,032,992)	
	組入時価比率：1.6%		1.6%	

シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	220,000	290,400.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	543,892	394,321.70	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,555,982	4,761,304.92	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	910,044	910,044.00	
	CAPITALAND CHINA TRUST	480,212	677,098.92	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,230,028	4,727,659.36	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	370,040	451,448.80	
	EC WORLD REIT	120,000	87,000.00	
	ESR REIT	1,140,037	450,314.61	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	490,000	289,100.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	530,838	119,438.55	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	670,007	1,701,817.78	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	310,000	159,650.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,299,990	1,858,985.70	
	IREIT GLOBAL	226,320	144,844.80	
	KEPPEL DC REIT	638,983	1,840,271.04	
	KEPPEL REIT	850,000	1,011,500.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	450,000	364,500.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,624,000	170,560.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,100,024	2,255,049.20	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	818,000	2,290,400.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,400,040	2,716,077.60	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,030,000	1,014,550.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,159,967	434,987.62	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	187,000	781,660.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	410,038	153,764.25	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	260,000	217,100.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	480,400	257,014.00	
	SPH REIT	480,000	398,400.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	670,000	341,700.00	
	SUNTEC REIT	1,050,000	1,554,000.00	
	小計	銘柄数：31	24,705,842	32,824,962.85
				(2,615,164,790)

有価証券報告書（内国役員信託）

		組入時価比率：3.5%		3.5%	
ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,000	43,965,000.00		
	JR REIT XXVII	53,000	275,070,000.00		
	LOTTE REIT CO LTD	40,000	202,400,000.00		
	LOTTE REIT CO LTD RTS	16,514	1,882,596.00		
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	45,000	179,775,000.00		
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	21,365	150,623,250.00		
	小計	銘柄数：6	184,879	853,715,846.00	(81,871,349)
	組入時価比率：0.1%		0.1%		
新シェケル	REIT 1 LTD	84,000	1,260,000.00		
小計	銘柄数：1	84,000	1,260,000.00	(40,811,400)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%		
合計			74,738,310,081	(67,383,485,371)	

(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	2021年 2月18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	417,159,370	—	433,382,968	16,220,518
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	14,833,000	—	14,802,200	△30,800
米ドル	14,833,000	—	14,802,200	△30,800
合計	—	—	—	16,189,718

(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。

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

のむラップ・ファンド（保守型）

2021年3月31日現在

I 資産総額	42,931,247,909円
II 負債総額	301,850,817円
III 純資産総額（I－II）	42,629,397,092円
IV 発行済口数	27,683,708,243口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.5399円

のむラップ・ファンド（やや保守型）

2021年3月31日現在

I 資産総額	4,317,107,156円
II 負債総額	5,933,676円
III 純資産総額（I－II）	4,311,173,480円
IV 発行済口数	3,482,226,218口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.2381円

のむラップ・ファンド（普通型）

2021年3月31日現在

I 資産総額	110,091,871,098円
II 負債総額	304,657,091円
III 純資産総額（I－II）	109,787,214,007円
IV 発行済口数	51,578,015,394口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.1286円

のむラップ・ファンド（やや積極型）

2021年3月31日現在

I 資産総額	4,843,977,674円
II 負債総額	14,714,455円
III 純資産総額（I－II）	4,829,263,219円
IV 発行済口数	3,449,966,137口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3998円

のむラップ・ファンド（積極型）

2021年3月31日現在

I 資産総額	43,081,430,878円
II 負債総額	174,608,969円
III 純資産総額（I－II）	42,906,821,909円
IV 発行済口数	16,888,899,600口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.5405円

（参考）国内株式マザーファンド

2021年3月31日現在

I 資産総額	441,631,323,074円
II 負債総額	24,702,649,295円
III 純資産総額（I－II）	416,928,673,779円
IV 発行済口数	204,294,556,209口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.0408円

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

2021年3月31日現在

I 資産総額	741,443,380,268円
II 負債総額	5,613,526,512円
III 純資産総額（I－II）	735,829,853,756円
IV 発行済口数	555,429,500,070口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3248円

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

2021年3月31日現在

I 資産総額	930,876,616,169円
II 負債総額	3,228,365,068円
III 純資産総額（I－II）	927,648,251,101円
IV 発行済口数	245,531,591,330口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	3.7781円

（参考）外国債券マザーファンド

2021年3月31日現在

I 資産総額	584,726,563,584円
II 負債総額	2,135,568,435円
III 純資産総額（I－II）	582,590,995,149円
IV 発行済口数	232,003,827,490口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.5111円

（参考）世界REITインデックス マザーファンド

2021年3月31日現在

I 資産総額	81,373,667,673円
II 負債総額	177,728,819円
III 純資産総額（I－II）	81,195,938,854円
IV 発行済口数	41,014,018,355口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.9797円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3)受益権の譲渡

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

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

③上記①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た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

2021年3月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

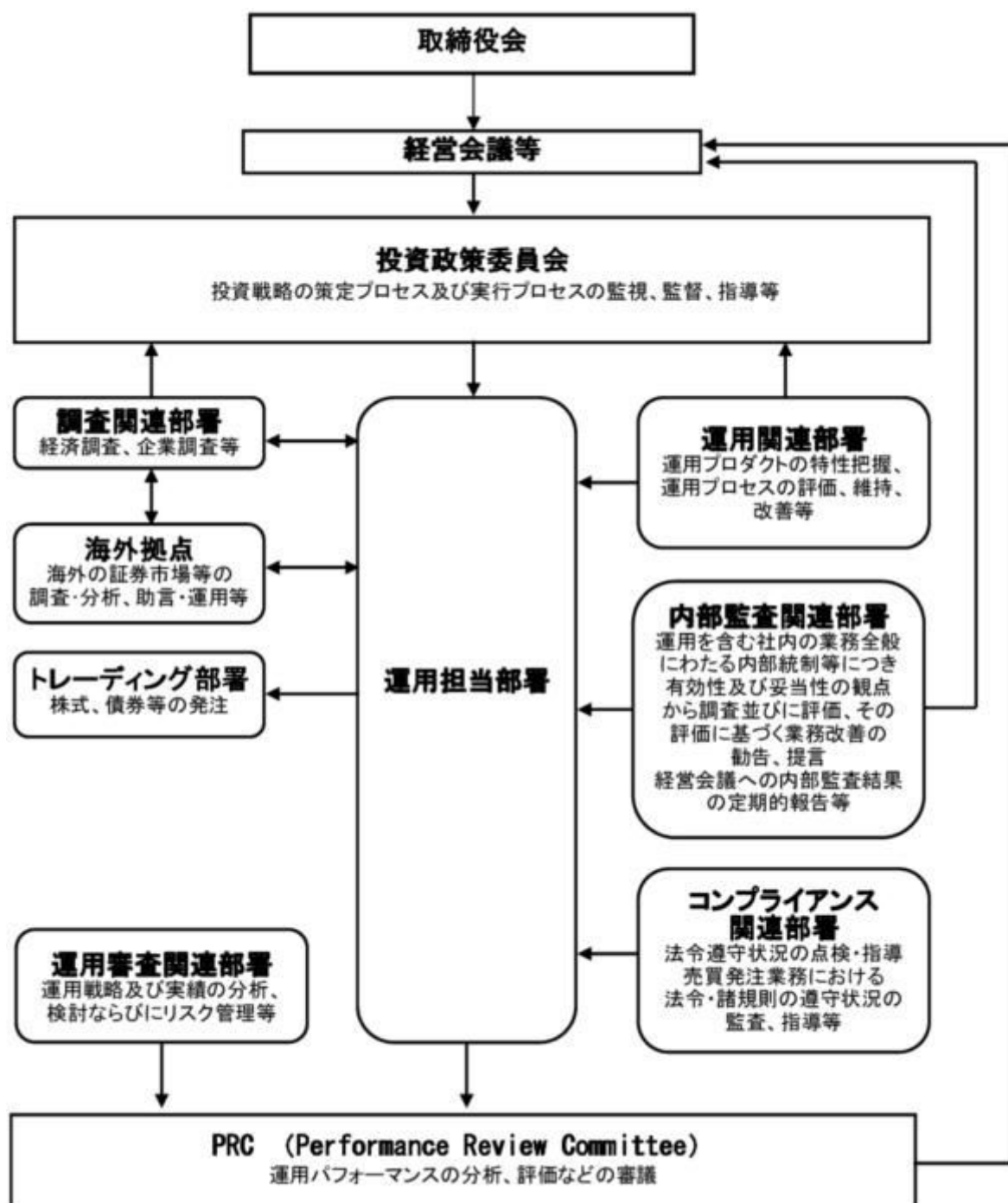
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2021年2月26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	992	36,245,919
単位型株式投資信託	195	823,799
追加型公社債投資信託	14	6,414,778
単位型公社債投資信託	496	1,632,331
合計	1,697	45,116,827

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。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57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. 財務諸表及び中間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)の財務諸表ならびに中間会計期間(2020年4月1日から2020年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

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

建物	※ 2	320		295	
器具備品	※ 2	393		349	
無形固定資産			6,438		5,894
ソフトウェア		6,437		5,893	
その他		0		0	
投資その他の資産			18,608		16,486
投資有価証券		1,562		1,437	
関係会社株式		12,631		10,171	
従業員長期貸付金		-		16	
長期差入保証金		235		329	
長期前払費用		22		19	
前払年金費用		2,001		1,545	
繰延税金資産		2,694		2,738	
その他		168		229	
貸倒引当金		-		△0	
投資損失引当金		△707		-	
固定資産計			25,761		23,026
資産合計			124,679		120,536

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

その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10
純資産合計			86,958		85,281
負債・純資産合計			124,679		120,536

(2) 【損益計算書】

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

		前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	※ 1	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	※ 1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
経常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	※ 3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	※ 2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		△34
当期純利益			25,672		23,996

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		

当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							△24,826	△24,826	△24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	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）									

当期變動額合計	—	—	—	—	—	—	△1,653	△1,653	△1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの … 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの … 移動平均法による原価法								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 <table border="0"> <tr> <td>建物</td><td>38～50年</td></tr> <tr> <td>附属設備</td><td>8～15年</td></tr> <tr> <td>構築物</td><td>20年</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>4～15年</td></tr> </table> (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。								

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

[未適用の会計基準等]

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

[注記事項]

◇ 貸借対照表関係

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

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

◇ 損益計算書関係

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

◇ 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 24,826百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 4,820円

基準日 2018年3月31日

効力発生日 2018年6月25日

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 25,650百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額	4,980円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2020年5月19日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

◇ 金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

① 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	△436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	△35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289
(5) 年金資産に関する事項	
①年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%
②長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.6%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%
3. 確定拠出制度	
当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。	

◇ 税効果会計関係

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率 との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率 との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 (調整)	法定実効税率 (調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
外国税額控除	外国税額控除
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
その他	その他
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
31.0%	31.0%
0.1%	0.0%
△5.6%	△4.4%
2.6%	2.6%
△0.6%	△0.7%
0.3%	0.2%
1.3%	0.4%
29.1%	29.1%

◇ セグメント情報等

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

◇ 関連当事者情報

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有)直接 100%	資産の賃貸借及び購入等 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(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、
ニューヨーク証券取引所に上場）

（２）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

（イ）子会社等

該当はありません。

（ウ）兄弟会社等

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

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

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

ニューヨーク証券取引所に上場）

（２）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇ １株当たり情報

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

中間財務諸表

◇中間貸借対照表

		2020年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		2,307
金銭の信託		40,828
有価証券		10,500
未収委託者報酬		24,249
未収運用受託報酬		4,560
その他		894
貸倒引当金		△14
流動資産計		83,326
固定資産		
有形固定資産	※ 1	2,998
無形固定資産		5,462
ソフトウェア		5,461
その他		0
投資その他の資産		15,942
投資有価証券		1,701
関係会社株式		10,171
前払年金費用		1,429
繰延税金資産		2,003
その他		636
固定資産計		24,403

資産合計		107,730
		2020年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		11,513
未払収益分配金		0
未払償還金		0
未払手数料		6,651
関係会社未払金		4,007
その他未払金	※ 2	853
未払費用		9,953
未払法人税等		1,444
賞与引当金		2,005
その他		147
流動負債計		25,063
固定負債		
退職給付引当金		3,350
時効後支払損引当金		579
資産除去債務		1,371
固定負債計		5,300
負債合計		30,364
(純資産の部)		
株主資本		77,365
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		46,455
利益準備金		685
その他利益剰余金		45,770
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		21,163
評価・換算差額等		0
その他有価証券評価差額金		0
純資産合計		77,366
負債・純資産合計		107,730

◇中間損益計算書

		自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		52,814
運用受託報酬		7,648
その他営業収益		178
営業収益計		60,641
営業費用		
支払手数料		16,811
調査費		11,994
その他営業費用		3,835

営業費用計		32,641
一般管理費	※ 1	13,883
営業利益		14,115
営業外収益	※ 2	6,145
営業外費用	※ 3	33
経常利益		20,227
特別利益	※ 4	2,228
特別損失	※ 5	445
税引前中間純利益		22,011
法人税、住民税及び事業税		5,226
法人税等調整額		739
中間純利益		16,045

◇中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			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	利 益 準備金	その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270
当中間期変動額									
剰余金の配当							△23,950	△23,950	△23,950
中間純利益							16,045	16,045	16,045
株主資本以外の 項目の 当中間期変動額 (純額)									
当中間期変動額 合計	—	—	—	—	—	—	△7,905	△7,905	△7,905
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	21,163	46,455	77,365

(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	10	10	85,281
当中間期変動額			
剰余金の配当			△23,950
中間純利益			16,045
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	△10	△10	△10
当中間期変動額合計	△10	△10	△7,915
当中間期末残高	0	0	77,366

[重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式…移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの…中間決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。） 時価のないもの…移動平均法による原価法
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法によっております。 (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。
4 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。

	(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
5 消費税等の会計処理	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ます。
6 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

[注記事項]

◇中間貸借対照表関係

2020年9月30日現在	
※1 有形固定資産の減価償却累計額	648百万円
※2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

◇中間損益計算書関係

自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日	
※1 減価償却実施額	
有形固定資産	180百万円
無形固定資産	1,125百万円
※2 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	4,540百万円
金銭信託運用益	1,360百万円
※3 営業外費用のうち主要なもの	
時効後支払損引当金繰入	10百万円
為替差損	9百万円
※4 特別利益の内訳	
投資有価証券等売却益	71百万円
株式報酬受入益	26百万円
移転補償金	2,130百万円
※5 特別損失の内訳	
投資有価証券等評価損	36百万円
固定資産除却損	2百万円
事務所移転費用	406百万円

◇中間株主資本等変動計算書関係

自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日				
1 発行済株式に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式	5,150,693株	—	—	5,150,693株
2 配当に関する事項				
配当金支払額				
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				
(1) 配当金の総額	23,950百万円			
(2) 1株当たり配当額	4,650円			
(3) 基準日	2020年3月31日			
(4) 効力発生日	2020年6月30日			

◇金融商品関係

当中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

2020年9月30日における中間貸借対照表計上額、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）

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,307	2,307	-
(2)金銭の信託	40,828	40,828	-
(3)未収委託者報酬	24,249	24,249	-
(4)未収運用受託報酬	4,560	4,560	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	10,500	10,500	-
資産計	82,445	82,445	-
(6)未払金	11,513	11,513	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	0	0	-
未払手数料	6,651	6,651	-
関係会社未払金	4,007	4,007	-
その他未払金	853	853	-
(7)未払費用	9,953	9,953	-
(8)未払法人税等	1,444	1,444	-
負債計	22,911	22,911	-

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

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、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（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,701百万円、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、「（5）有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当中間会計期間において、非上場株式について35百万円（投資有価証券35百万円）減損処理を行っております。

◇有価証券関係

当中間会計期間末（2020年9月30日）

1. 満期保有目的の債券(2020年9月30日)

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式(2020年9月30日)

該当事項はありません。

3. その他有価証券(2020年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
----	-------------------------	---------------	-------------

中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの			
譲渡性預金	10,500	10,500	-
小計	10,500	10,500	-
合計	10,500	10,500	-

◇資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減 (単位：百万円)

	自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日
期首残高	-
有形固定資産の取得に伴う増加	1,371
時の経過による調整額	-
中間期末残高	1,371

◇セグメント情報等

当中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30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、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間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、中間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。

◇1株当たり情報

自 2020年4月 1日 至 2020年9月30日

1株当たり純資産額 15,020円52銭

1株当たり中間純利益 3,115円15銭

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。

2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

中間純利益	16,045百万円
普通株主に帰属しない金額	—
普通株式に係る中間純利益	16,045百万円
期中平均株式数	5,150千株

4【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ④委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

*2021年2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。
a u カブコム証券株式会社	7,196百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
O K B 証券株式会社	1,500百万円	
九州 F G 証券株式会社	3,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
七十七証券株式会社	3,000百万円	
ちばぎん証券株式会社	4,374百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
とうほう証券株式会社	3,000百万円	
南都まほろば証券株式会社	3,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
百五証券株式会社	3,000百万円	
ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
めぶき証券株式会社	3,000百万円	
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	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社阿波銀行	23,452百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社大分銀行	19,598百万円	
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社佐賀銀行	16,062百万円	
株式会社滋賀銀行	33,076百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	

株式会社清水銀行	8,670百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社新生銀行	512,204百万円	
株式会社大光銀行	10,000百万円	
株式会社筑邦銀行	8,000百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社東北銀行	13,233百万円	
株式会社鳥取銀行	9,061百万円	
株式会社トマト銀行	17,810百万円	
株式会社長崎銀行	6,121百万円	
株式会社長野銀行	13,000百万円	
株式会社南都銀行	37,900百万円	
株式会社西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社百十四銀行	37,322百万円	
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	
株式会社福島銀行	18,682百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
株式会社北海道銀行	93,524百万円	
株式会社みちのく銀行	36,986百万円	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社宮崎太陽銀行	12,252百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社山形銀行	12,008百万円	
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	
朝日信用金庫	20,023百万円 ^{※1}	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。
岡崎信用金庫	3,096百万円 ^{※1}	
碧海信用金庫	1,256百万円 ^{※1}	
近畿産業信用組合	27,447百万円 ^{※1}	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

※2021年2月末現在

※1 朝日信用金庫、岡崎信用金庫、碧海信用金庫および近畿産業信用組合の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

2【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

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

※野村證券株式会社は、ファンドの投資助言を行ないません。なお、同社は金融商品取引法に基づき投資運用業の登録を行なっています。

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
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
2020年11月13日	有価証券届出書の訂正届出書
2020年11月13日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2020年6月10日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所

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

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	櫻井 雄一郎
--------------------	-------	--------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津村 健二郎
--------------------	-------	--------

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

2021年4月2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

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」に掲げられているのむラップ・ファンド（保守型）の2020年2月19日から2021年2月18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、のむラップ・ファンド（保守型）の2021年2月18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。

独立監査人の監査報告書

2021年4月2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

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」に掲げられているのむラップ・ファンド（やや保守型）の2020年2月19日から2021年2月18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、のむラップ・ファンド（やや保守型）の2021年2月18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。

独立監査人の監査報告書

2021年4月2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

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」に掲げられているのむラップ・ファンド（普通型）の2020年2月19日から2021年2月18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、のむラップ・ファンド（普通型）の2021年2月18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。

独立監査人の監査報告書

2021年4月2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

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」に掲げられているのむラップ・ファンド（やや積極型）の2020年2月19日から2021年2月18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、のむラップ・ファンド（やや積極型）の2021年2月18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。

独立監査人の監査報告書

2021年4月2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

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」に掲げられているのむラップ・ファンド（積極型）の2020年2月19日から2021年2月18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、のむラップ・ファンド（積極型）の2021年2月18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。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月25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	津村健二郎
--------------------	-------	-------

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

中間監査意見

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第62期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の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。

中間財務諸表に対する経営者並びに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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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。

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の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。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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. 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。