

**【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7月29日提出                   |
| 【計算期間】     | 第20期(自 2020年5月12日至 2021年5月10日) |
| 【ファンド名】    | バランスセレクト70（確定拠出年金向け）           |
| 【発行者名】     | 野村アセットマネジメント株式会社               |
| 【代表者の役職氏名】 | 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】

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

◆内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象<sup>※</sup>とし、これらに分散投資するバランス運用を行なうことで、キャピタルゲインとインカムゲインを総合したトータルリターン<sup>※</sup>の獲得を目指します。

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

#### ■信託金の限度額■

受益権の信託金限度額は5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該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。

（バランスセレクト70（確定拠出年金向け））

#### 《商品分類表》

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(収益の源泉) | 補足分類    |
|---------|--------|-------------------|---------|
| 単位型     | 国 内    | 株 式               | インデックス型 |
|         | 海 外    | 債 券               |         |
| 追加型     |        | 不動産投信             | 特殊型     |
|         | 内 外    | その他資産<br>( )      |         |
|         |        | 資産複合              |         |

#### 《属性区分表》

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

#### <商品分類表定義>

##### [単位型投信・追加型投信の区分]

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

##### [投資対象地域による区分]

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

## 〔投資対象資産による区分〕

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

## 〔独立した区分〕

- (1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2)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。

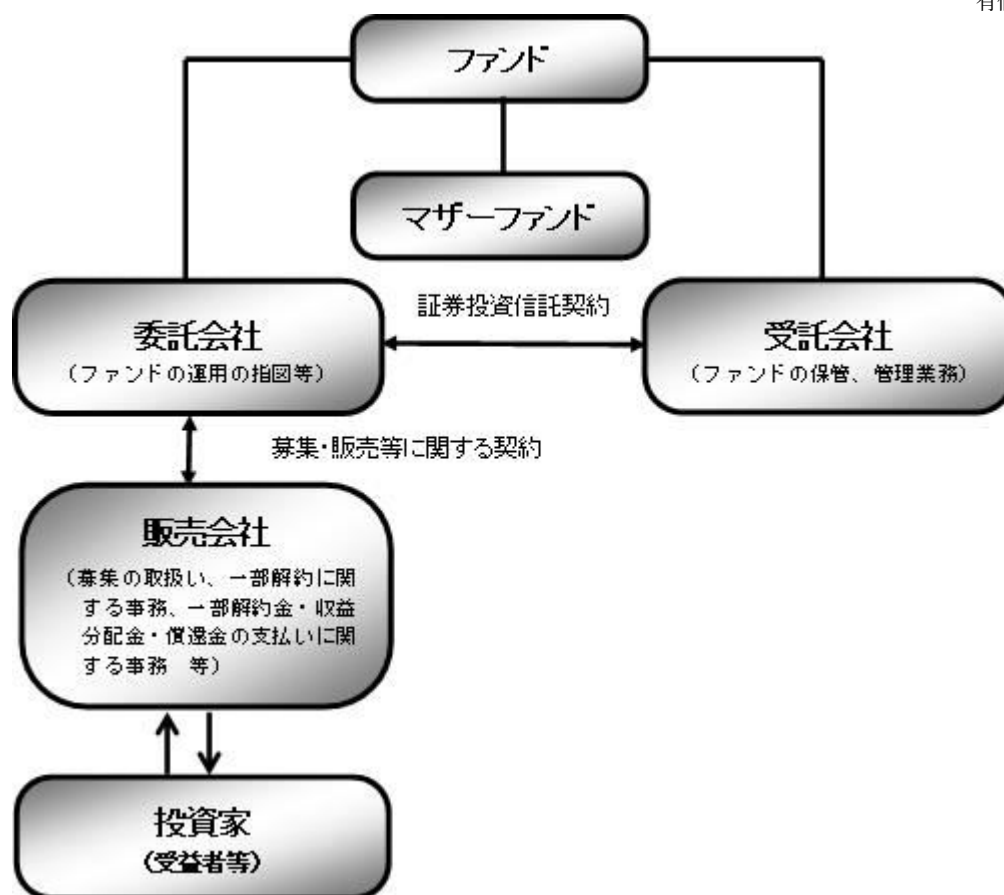
## [特殊型]

- (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】

2001年11月22日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



|                    |                                                                      |
|--------------------|----------------------------------------------------------------------|
| ファンド               | バランスセレクト70(確定拠出年金向け)                                                 |
| マザーファンド<br>(親投資信託) | 国内株式マザーファンド<br>外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド<br>国内債券マザーファンド<br>外国債券マザーファンド |
| 委託会社(委託者)          | 野村アセットマネジメント株式会社                                                     |
| 受託会社(受託者)          | 野村信託銀行株式会社                                                           |

- ファンドはマザーファンドを通じて投資するファミリーファンド方式で運用します。



#### ■委託会社の概況(2021年6月末現在)■

- ・名称  
野村アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額  
17,180百万円
- ・会社の沿革

|            |                                                   |
|------------|---------------------------------------------------|
| 1959年12月1日 | 野村證券投資信託委託株式会社として設立                               |
| 1997年10月1日 | 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更 |
| 2000年11月1日 | 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更                            |
| ・大株主の状況    |                                                   |

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

[1] 内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

◆運用にあたっては、「国内株式マザーファンド」<sup>(※1)</sup>「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」<sup>(※2)</sup>

「国内債券マザーファンド」<sup>(※3)</sup>「外国債券マザーファンド」<sup>(※4)</sup>の各受益証券に投資を行ないます。

◆各マザーファンドへの投資比率は以下を基本とし、原則として3ヵ月毎にリバランスを行ないます。

国内株式マザーファンド受益証券：45%

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド受益証券：25%

国内債券マザーファンド受益証券：20%

外国債券マザーファンド受益証券：10%

株式への実質的な投資比率(国内株式＋外国株式)は、70%程度となります。

(※1) 「国内株式マザーファンド」は、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。「国内株式マザーファンド」の運用方針等については、「(参考)各マザーファンドの概要」をご参照ください。

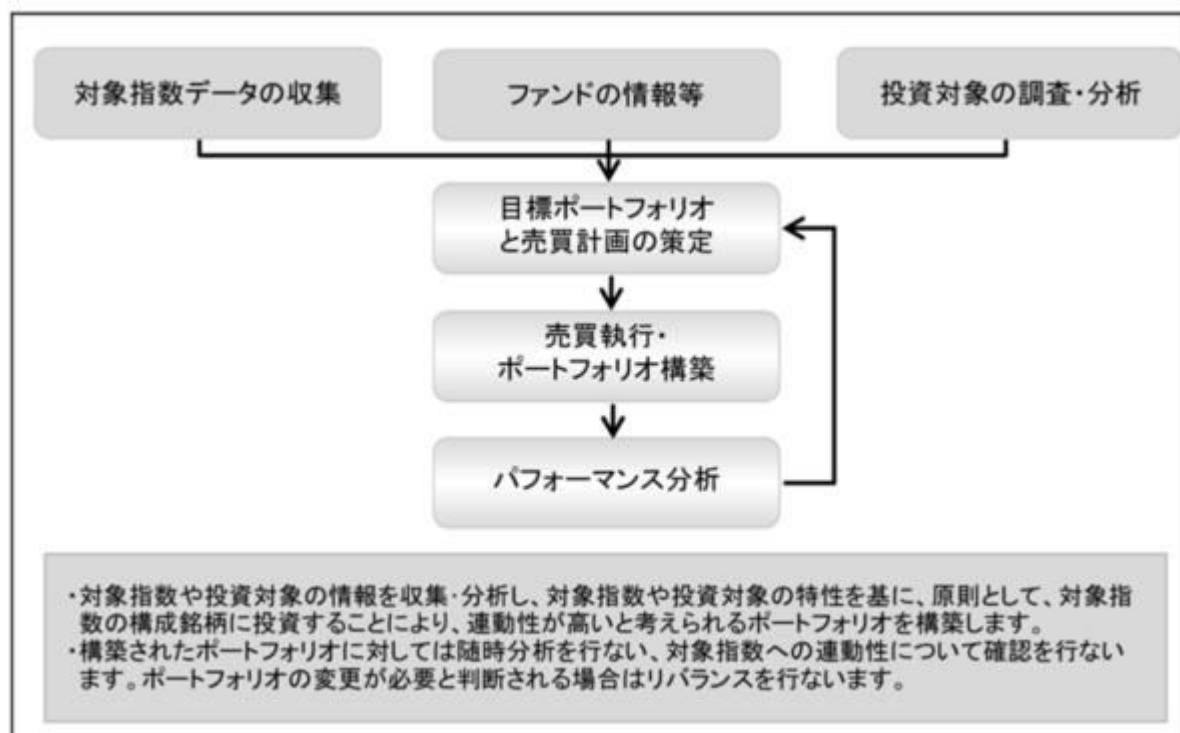
(※2) 「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」は、主として外国の株式に投資することにより、「**MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)**<sup>\*</sup>」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」の運用方針等については、「(参考)各マザーファンドの概要」をご参照ください。

\*MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

(※3) 「国内債券マザーファンド」は、主としてわが国の公社債に投資することにより、「**NOMURA-BPI国債**」の動きに連動する投資成果を目指します。「国内債券マザーファンド」の運用方針等については、「(参考)各マザーファンドの概要」をご参照ください。

(※4) 「外国債券マザーファンド」は、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。「外国債券マザーファンド」の運用方針等については、「(参考)各マザーファンドの概要」をご参照ください。

## ■投資プロセス■



\* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

## ■各マザーファンドが対象とするインデックスについて■

## ○国内株式マザーファンド：東証株価指数(TOPIX)

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「(株)東京証券取引所」という。）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(株)東京証券取引所が有しています。

(株)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。

## ○外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド：MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)

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。

## ○国内債券マザーファンド：NOMURA-BPI国債

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



NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。

また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

○外国債券マザーファンド：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。

[2] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

◆外貨建資産に投資するマザーファンドにおいても、外貨建資産については原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券を主要投資対象とします。なお、株式および公社債に直接投資する場合があります。

■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。

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。

国内債券マザーファンド：わが国の公社債を主要投資対象とします。

外国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。

なお、デリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定します。

① 投資の対象とする資産の種類(約款第17条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ 有価証券

ロ デリバティブ取引(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「(5)投資制限④及び⑤」に定めるものに限り、)に係る権利

ハ 約束手形(イに掲げるものに該当するものを除きます。)

ニ 金銭債権(イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。)

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

② 有価証券の指図範囲(約款第18条第1項)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である下記の各マザーファンド受益証券のほか、

国内株式マザーファンド受益証券(以下「国内株式マザーファンド」といいます。)

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド受益証券(以下「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」といいます。)

国内債券マザーファンド受益証券(以下「国内債券マザーファンド」といいます。)

外国債券マザーファンド受益証券(以下「外国債券マザーファンド」といいます。)

次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。 )に投資することを指図します。

- 1 株券または新株引受権証書
- 2 国債証券
- 3 地方債証券
- 4 特別の法律により法人の発行する債券(金融商品取引法第2条第1項第3号で定めるものをいいます。)
- 5 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。 )の新株引受権証券を除きます。 )
- 6 特定目的会社に係る特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。 )
- 7 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。 )
- 8 協同組織金融機関に係る優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。 )
- 9 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。 )
- 10 コマーシャル・ペーパー
- 11 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。 以下同じ。 )および新株予約権証券
- 12 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。 )
- 14 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。 )
- 15 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。 )
- 16 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。 )
- 17 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 18 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
- 19 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
- 20 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。 )
- 21 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。 )

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを「公社債」といい、第13号および第14号の証券を「投資信託証券」といいます。

③ 金融商品の指図範囲(約款第18条第2項)

委託者は、信託金を、次の金融商品(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)投資対象②有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。)
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

④ その他の投資対象

- 1 先物取引等
- 2 スワップ取引

(参考)各マザーファンドの概要

「国内株式マザーファンド」

## 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

① 主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。

② 非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

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

#### (3) 投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は行ないません。

③ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

④ 有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

⑤ スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

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

合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

## 「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

### 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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。

⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

⑪ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

**「国内債券マザーファンド」****運 用 の 基 本 方 針**

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

**1. 基本方針**

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

**2. 運用方法****(1) 投資対象**

わが国の公社債を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

- ① 主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI国債指数の動きに連動する投資成果を目指します。
- 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 外貨建資産への投資は行ないません。
- 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。

**「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**

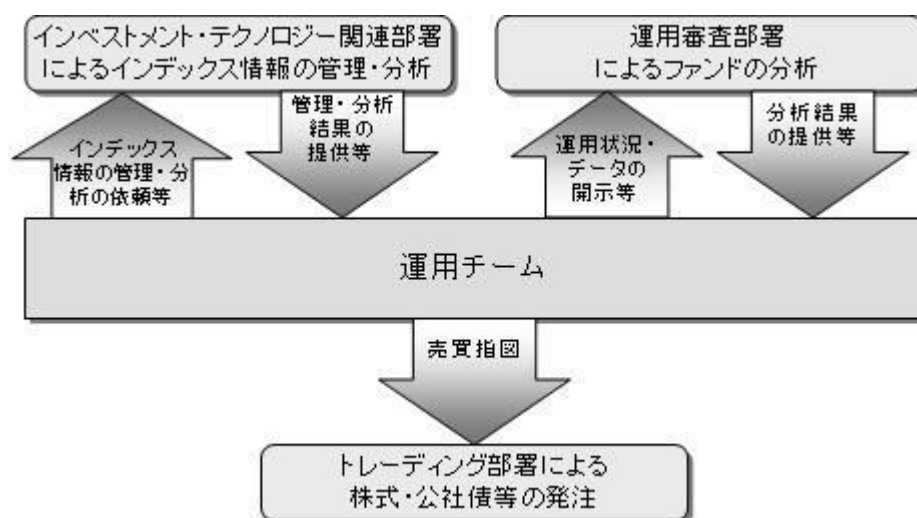
外国の公社債を主要投資対象とします。

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

### (3) 【運用体制】

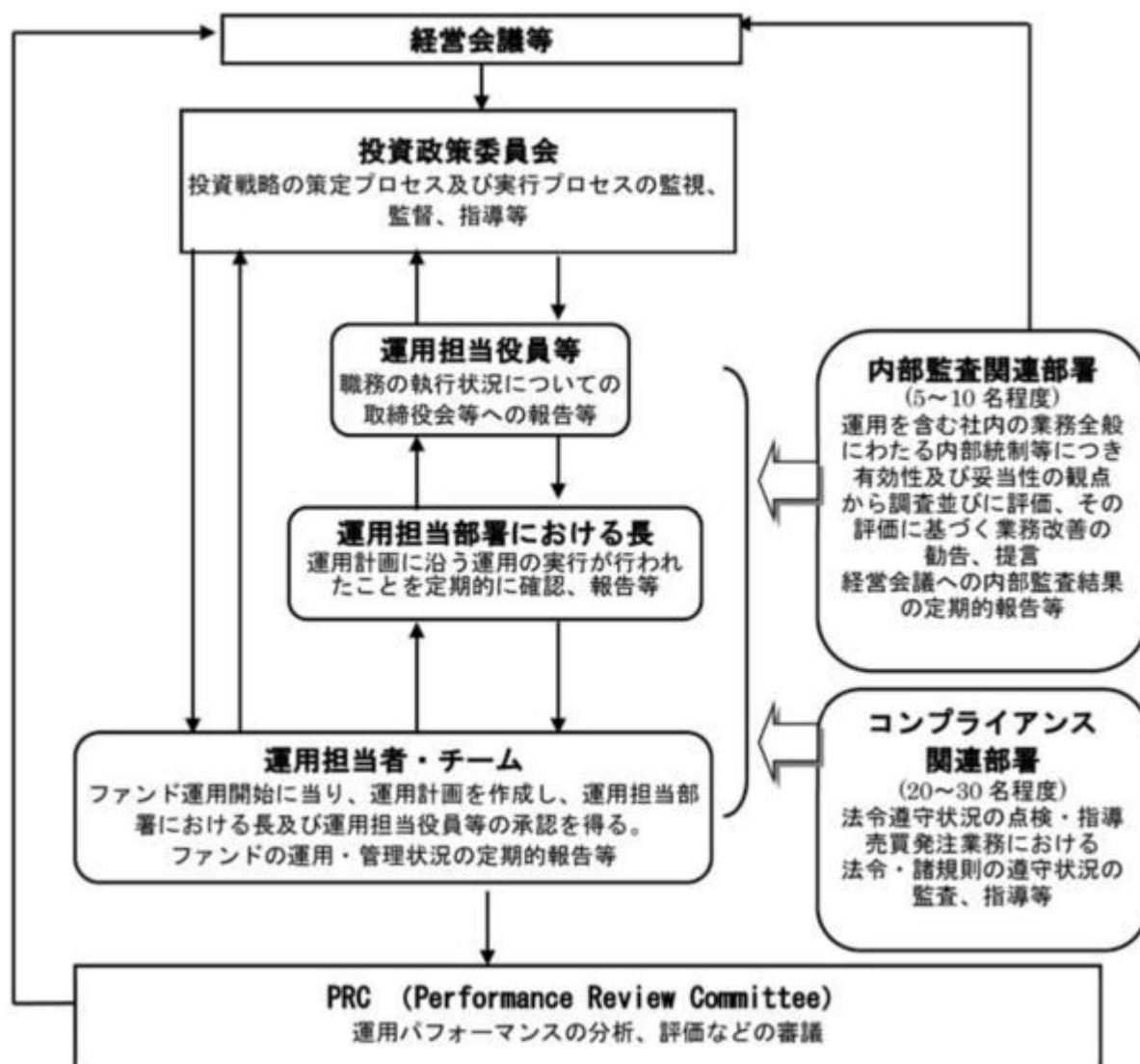
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

当社では、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】

年1回の毎決算時に、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・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、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・配当収入とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品賃料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5月10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】

#### ① 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)

株式への実質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(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

#### ③ デリバティブの使用はヘッジ目的に限定します。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。（運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限）

#### ④ 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

(i)委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。))および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。))ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。))。

1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。))の時価総額の範囲内とします。

2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等（株式、株価指数に係る先物取引の買建においては、信託



財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。) ならびに上記「(2)投資対象 ③ 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(ii) 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。))の時価総額と各マザーファンド(国内株式マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、国内債券マザーファンドおよび外国債券マザーファンドをいいます。以下本項において同じ。))の信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する各マザーファンドの時価総額に各マザーファンドの信託財産純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))との合計額の範囲内とします。

- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(iii) 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

- 1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 ③ 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。))の時価総額の範囲内とします。

- 2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 ③ 金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(本号において「金融商品運用額等」といいます。))の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。))に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

- 3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回

らない範囲内とします。

⑤ スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第25条)

- (i) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(「スワップ取引」)を行なうことの指図をすることができます。
- (ii) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (iii) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額と各マザーファンド(国内株式マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、国内債券マザーファンドおよび外国債券マザーファンドをいいます。以下本項において同じ。)の信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (iv) 上記(iii)において各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額に各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (v) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- (vi) 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

⑦ 投資信託証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

⑧ 投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

⑨ 同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑩ 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(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

⑪ 同一銘柄の転換社債等への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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<sup>※</sup>への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

※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。

⑫ 信用取引の指図範囲(約款第23条)

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

信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

- 1 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2 株式分割により取得する株券
- 3 有償増資により取得する株券
- 4 売り出しにより取得する株券
- 5 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
- 6 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

⑬ 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第27条)

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

- 1 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないこととします。
- 2 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

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

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

⑭ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第29条)

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

⑮ 外国為替予約の指図(約款第30条)

(i)委託者は、信託財産に属する外貨建資産と外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドおよび外国債券マ

ザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドおよび外国債券マザーファンドの時価総額に外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(ii) 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑯ 資金の借入れ(約款第39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。

⑰ 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)

⑱ 同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

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

(ii) 当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

### 3【投資リスク】

#### 《基準価額の変動要因》

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

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。

**[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。

**[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。

※ 基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

**《その他の留意点》**

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- 資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
- 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

**■外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて■**

**「MSCI」の著作権等について**

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、参加もしておりません。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、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

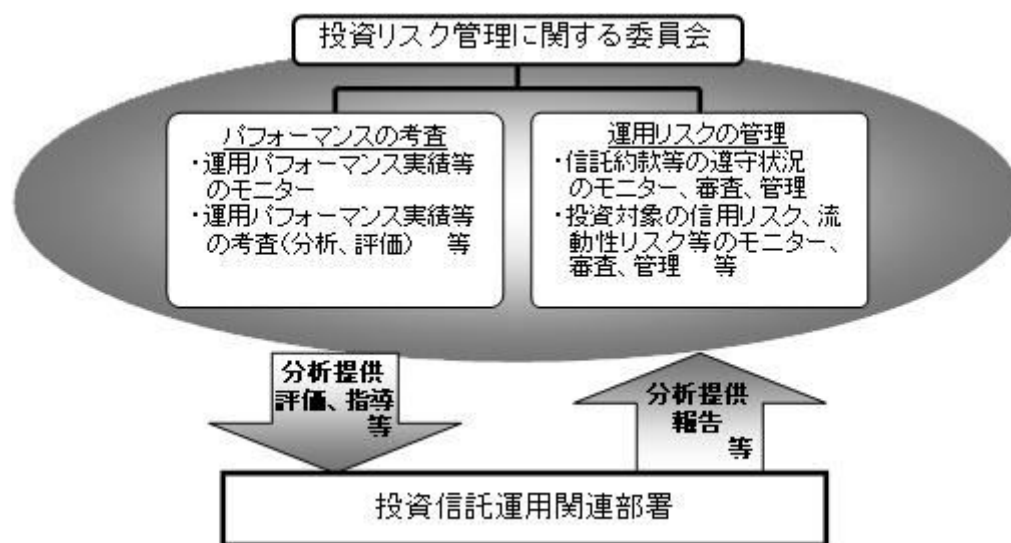
本証券の購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人・法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、本証券を保証、推奨、売買、又は宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、又はサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

**《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。

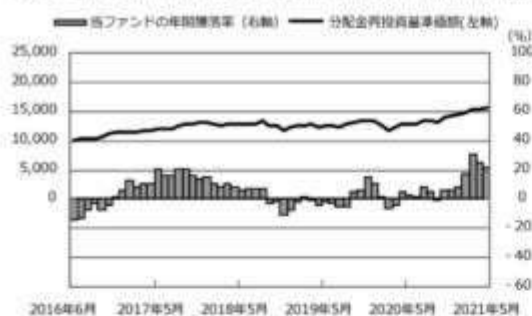
**リスク管理体制図**

※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。

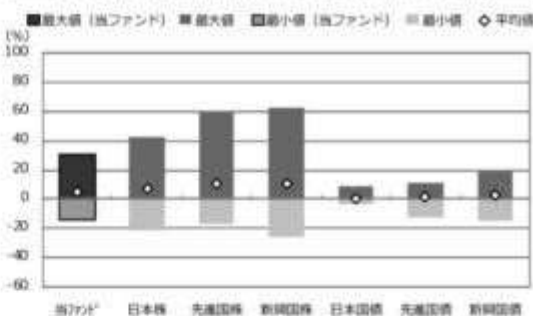


## ■ リスクの定量的比較（2016年6月末～2021年5月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



|        | 当ファンド | 日本株   | 先進国株  | 新興国株  | 日本国債 | 先進国債  | 新興国債  |
|--------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|
| 最大値（％） | 31.0  | 42.1  | 59.8  | 62.7  | 9.3  | 11.4  | 19.3  |
| 最小値（％） | △14.7 | △22.0 | △17.5 | △26.0 | △4.0 | △12.3 | △14.5 |
| 平均値（％） | 5.4   | 6.7   | 11.0  | 10.3  | 0.8  | 1.8   | 2.7   |

＊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6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6月から2021年5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6月から2021年5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・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）

### ■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、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 が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の平均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 が所有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスも法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、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。

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

## 4 【手数料等及び税金】

### （1）【申込手数料】



申込手数料はありません。

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.737%（税抜年0.67%）の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。

＜委託会社＞

年0.29%

＜販売会社＞

年0.33%

＜受託会社＞

年0.05%

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。

### 《支払先の役務の内容》

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

## （４）【その他の手数料等】

- ① ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息は信託財産から支払われます。
- 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は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。
- 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信託財産から支払われます。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信託財産中から支払われます。

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税、復興

特別所得税および地方税がかかりません。

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いとは下記の通りです。

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## ■個別元本について■

◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

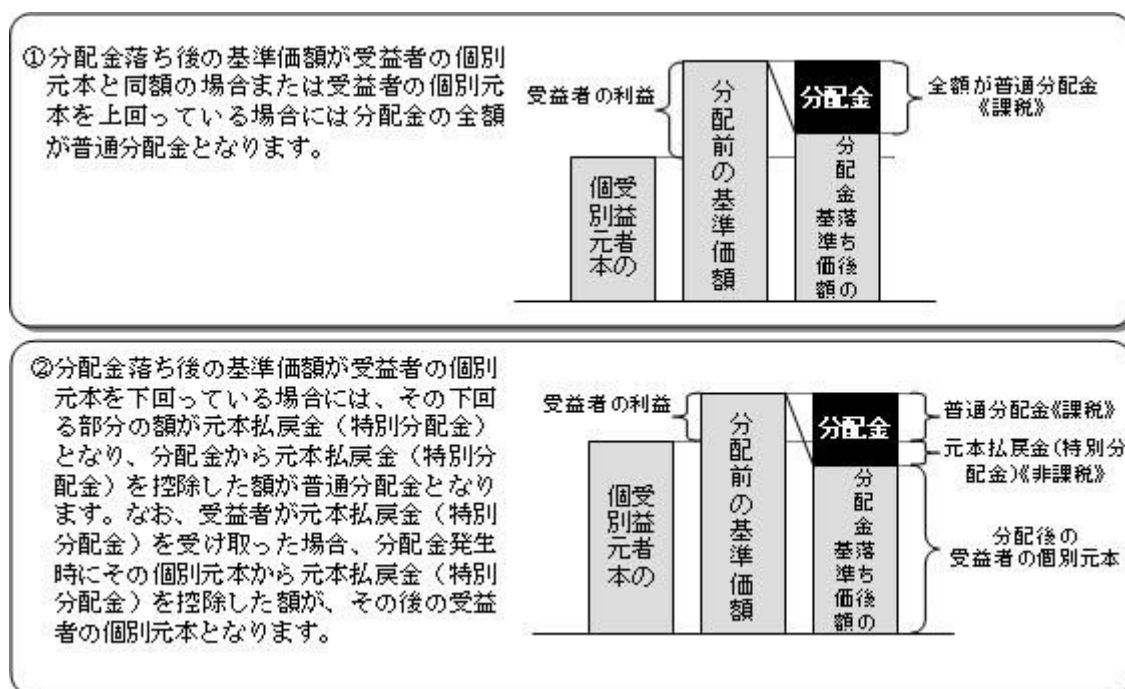
## ■換金（解約）時および償還時の課税について■

◆換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

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。

## ■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5月末現在）が変更になる場合があります。

ります。

## 5【運用状況】

以下は2021年5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】

#### バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）     | 投資比率（％） |
|--------------------|------|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券          | 日本   | 152,799,378 | 99.89   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 153,767     | 0.10    |
| 合計（純資産総額）          |      | 152,953,145 | 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   | 376,714,943,360 | 97.91   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 8,036,398,461   | 2.08    |
| 合計（純資産総額）          |      | 384,751,341,821 | 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   | 8,022,560,000 | 2.08    |

### （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   | 690,701,451,323 | 68.41   |
|       | カナダ    | 36,210,580,235  | 3.58    |
|       | ドイツ    | 30,158,748,279  | 2.98    |
|       | イタリア   | 7,926,096,150   | 0.78    |
|       | フランス   | 36,042,169,220  | 3.56    |
|       | オランダ   | 14,177,596,384  | 1.40    |
|       | スペイン   | 8,249,023,943   | 0.81    |
|       | ベルギー   | 2,837,625,641   | 0.28    |
|       | オーストリア | 668,309,479     | 0.06    |

|                    |          |                   |        |
|--------------------|----------|-------------------|--------|
|                    | ルクセンブルグ  | 486,640,540       | 0.04   |
|                    | フィンランド   | 3,354,642,949     | 0.33   |
|                    | アイルランド   | 2,272,544,051     | 0.22   |
|                    | ポルトガル    | 643,097,885       | 0.06   |
|                    | イギリス     | 46,074,536,218    | 4.56   |
|                    | スイス      | 30,420,544,623    | 3.01   |
|                    | スウェーデン   | 12,193,753,770    | 1.20   |
|                    | ノルウェー    | 2,017,614,592     | 0.19   |
|                    | デンマーク    | 8,048,961,531     | 0.79   |
|                    | オーストラリア  | 21,523,981,020    | 2.13   |
|                    | ニュージーランド | 736,229,751       | 0.07   |
|                    | 香港       | 9,755,131,723     | 0.96   |
|                    | シンガポール   | 2,988,949,442     | 0.29   |
|                    | イスラエル    | 1,062,787,331     | 0.10   |
|                    | 小計       | 968,551,016,080   | 95.93  |
| 投資証券               | アメリカ     | 18,835,636,258    | 1.86   |
|                    | カナダ      | 117,231,351       | 0.01   |
|                    | フランス     | 520,173,571       | 0.05   |
|                    | イギリス     | 586,980,305       | 0.05   |
|                    | オーストラリア  | 1,497,292,674     | 0.14   |
|                    | 香港       | 426,109,607       | 0.04   |
|                    | シンガポール   | 424,955,681       | 0.04   |
|                    | 小計       | 22,408,379,447    | 2.21   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —        | 18,630,250,075    | 1.84   |
| 合計（純資産総額）          |          | 1,009,589,645,602 | 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    | 13,353,662,280 | 1.32    |
|          | 買建 | カナダ     | 690,330,344    | 0.06    |
|          | 買建 | ドイツ     | 2,017,449,163  | 0.19    |
|          | 買建 | イギリス    | 874,285,280    | 0.08    |
|          | 買建 | スイス     | 571,106,889    | 0.05    |
|          | 買建 | オーストラリア | 424,803,044    | 0.04    |

## （参考）国内債券マザーファンド

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|-------|------|----------------|---------|
| 国債証券  | 日本   | 28,488,537,280 | 99.03   |

|                    |   |                |        |
|--------------------|---|----------------|--------|
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | — | 278,013,970    | 0.96   |
| 合計（純資産総額）          |   | 28,766,551,250 | 100.00 |

（参考）外国債券マザーファンド

| 資産の種類              | 国／地域    | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|--------------------|---------|-----------------|---------|
| 国債証券               | アメリカ    | 257,971,918,027 | 43.84   |
|                    | カナダ     | 12,053,141,097  | 2.04    |
|                    | メキシコ    | 4,677,898,932   | 0.79    |
|                    | ドイツ     | 40,253,029,269  | 6.84    |
|                    | イタリア    | 58,005,046,031  | 9.85    |
|                    | フランス    | 58,920,404,733  | 10.01   |
|                    | オランダ    | 10,149,531,144  | 1.72    |
|                    | スペイン    | 37,934,640,867  | 6.44    |
|                    | ベルギー    | 14,256,801,517  | 2.42    |
|                    | オーストリア  | 8,299,011,557   | 1.41    |
|                    | フィンランド  | 2,713,512,015   | 0.46    |
|                    | アイルランド  | 7,946,949,576   | 1.35    |
|                    | イギリス    | 38,631,231,360  | 6.56    |
|                    | スウェーデン  | 2,122,593,070   | 0.36    |
|                    | ノルウェー   | 1,483,831,364   | 0.25    |
|                    | デンマーク   | 2,955,134,659   | 0.50    |
|                    | ポーランド   | 3,694,823,659   | 0.62    |
|                    | オーストラリア | 12,947,506,247  | 2.20    |
|                    | シンガポール  | 2,554,600,172   | 0.43    |
|                    | マレーシア   | 2,751,308,668   | 0.46    |
|                    | イスラエル   | 2,627,944,133   | 0.44    |
|                    | 小計      | 582,950,858,097 | 99.08   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —       | 5,395,243,311   | 0.91    |
| 合計（純資産総額）          |         | 588,346,101,408 | 100.00  |

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）

| 順位 | 国／地域 | 種類            | 銘柄名         | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|---------------|-------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式マザーファンド | 33,955,699 | 2.0391          | 69,239,066      | 2.0106          | 68,271,328      | 44.63           |

|   |    |               |                             |            |        |            |        |            |       |
|---|----|---------------|-----------------------------|------------|--------|------------|--------|------------|-------|
| 2 | 日本 | 親投資信託<br>受益証券 | 外国株式MSCI－KOKUSA<br>Iマザーファンド | 9,570,518  | 3.9737 | 38,030,368 | 4.0142 | 38,417,973 | 25.11 |
| 3 | 日本 | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券マザーファンド                 | 22,556,484 | 1.3642 | 30,771,556 | 1.3637 | 30,760,277 | 20.11 |
| 4 | 日本 | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券マザーファンド                 | 6,032,778  | 2.5182 | 15,191,742 | 2.5444 | 15,349,800 | 10.03 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.89   |
| 合 計       | 99.89   |

## （参考）国内株式マザーファンド

| 順位 | 国／<br>地域 | 種類 | 銘柄名               | 業種     | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------|----|-------------------|--------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 日本       | 株式 | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 1,446,400 | 8,513.65        | 12,314,149,322  | 9,115.00        | 13,183,936,000  | 3.42            |
| 2  | 日本       | 株式 | ソニーグループ           | 電気機器   | 894,400   | 10,776.45       | 9,638,461,680   | 10,785.00       | 9,646,104,000   | 2.50            |
| 3  | 日本       | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 1,111,600 | 10,137.99       | 11,269,399,827  | 8,256.00        | 9,177,369,600   | 2.38            |
| 4  | 日本       | 株式 | キーエンス             | 電気機器   | 140,200   | 53,484.64       | 7,498,547,117   | 53,870.00       | 7,552,574,000   | 1.96            |
| 5  | 日本       | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 9,632,900 | 608.32          | 5,859,919,886   | 620.00          | 5,972,398,000   | 1.55            |
| 6  | 日本       | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 81,700    | 62,266.51       | 5,087,174,023   | 67,700.00       | 5,531,090,000   | 1.43            |
| 7  | 日本       | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 977,300   | 5,258.14        | 5,138,780,832   | 5,555.00        | 5,428,901,500   | 1.41            |
| 8  | 日本       | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 258,600   | 18,574.44       | 4,803,350,244   | 18,855.00       | 4,875,903,000   | 1.26            |
| 9  | 日本       | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 1,638,700 | 2,855.09        | 4,678,636,532   | 2,931.50        | 4,803,849,050   | 1.24            |
| 10 | 日本       | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 1,187,900 | 3,730.36        | 4,431,296,465   | 3,719.00        | 4,417,800,100   | 1.14            |
| 11 | 日本       | 株式 | 日本電産              | 電気機器   | 343,600   | 12,486.55       | 4,290,380,204   | 12,530.00       | 4,305,308,000   | 1.11            |
| 12 | 日本       | 株式 | KDDI              | 情報・通信業 | 1,123,500 | 3,444.81        | 3,870,249,836   | 3,717.00        | 4,176,049,500   | 1.08            |
| 13 | 日本       | 株式 | 東京エレクトロン          | 電気機器   | 83,600    | 49,990.30       | 4,179,189,318   | 48,660.00       | 4,067,976,000   | 1.05            |
| 14 | 日本       | 株式 | HOYA              | 精密機器   | 281,000   | 13,177.50       | 3,702,879,123   | 14,350.00       | 4,032,350,000   | 1.04            |
| 15 | 日本       | 株式 | 日立製作所             | 電気機器   | 686,500   | 5,386.97        | 3,698,158,268   | 5,736.00        | 3,937,764,000   | 1.02            |
| 16 | 日本       | 株式 | ダイキン工業            | 機械     | 181,900   | 23,079.20       | 4,198,107,399   | 21,605.00       | 3,929,949,500   | 1.02            |
| 17 | 日本       | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 974,500   | 3,970.75        | 3,869,498,264   | 3,951.00        | 3,850,249,500   | 1.00            |
| 18 | 日本       | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 1,124,200 | 3,429.35        | 3,855,286,189   | 3,353.00        | 3,769,442,600   | 0.97            |
| 19 | 日本       | 株式 | 村田製作所             | 電気機器   | 419,400   | 8,689.19        | 3,644,248,208   | 8,279.00        | 3,472,212,600   | 0.90            |
| 20 | 日本       | 株式 | ファナック             | 電気機器   | 125,300   | 26,558.92       | 3,327,833,427   | 26,300.00       | 3,295,390,000   | 0.85            |
| 21 | 日本       | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 1,913,500 | 1,623.73        | 3,107,015,787   | 1,673.00        | 3,201,285,500   | 0.83            |
| 22 | 日本       | 株式 | 伊藤忠商事             | 卸売業    | 983,600   | 3,558.90        | 3,500,539,937   | 3,249.00        | 3,195,716,400   | 0.83            |
| 23 | 日本       | 株式 | 第一三共              | 医薬品    | 1,122,000 | 2,916.80        | 3,272,652,776   | 2,530.00        | 2,838,660,000   | 0.73            |
| 24 | 日本       | 株式 | SMC               | 機械     | 41,800    | 65,217.12       | 2,726,075,626   | 65,520.00       | 2,738,736,000   | 0.71            |
| 25 | 日本       | 株式 | 三井物産              | 卸売業    | 1,121,800 | 2,537.52        | 2,846,594,839   | 2,414.00        | 2,708,025,200   | 0.70            |

|    |    |    |                 |       |           |           |               |           |               |      |
|----|----|----|-----------------|-------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 26 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業   | 550,100   | 4,705.32  | 2,588,398,469 | 4,736.00  | 2,605,273,600 | 0.67 |
| 27 | 日本 | 株式 | 三菱商事            | 卸売業   | 856,200   | 3,010.08  | 2,577,230,779 | 2,984.00  | 2,554,900,800 | 0.66 |
| 28 | 日本 | 株式 | 三菱電機            | 電気機器  | 1,427,700 | 1,695.68  | 2,420,928,509 | 1,692.00  | 2,415,668,400 | 0.62 |
| 29 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス    | 保険業   | 463,800   | 5,471.15  | 2,537,523,999 | 5,179.00  | 2,402,020,200 | 0.62 |
| 30 | 日本 | 株式 | オリエンタルランド       | サービス業 | 145,100   | 15,272.97 | 2,216,108,402 | 16,310.00 | 2,366,581,000 | 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     | 0.08    |
|    |       | 鉱業         | 0.16    |
|    |       | 建設業        | 2.27    |
|    |       | 食料品        | 3.31    |
|    |       | 繊維製品       | 0.47    |
|    |       | パルプ・紙      | 0.23    |
|    |       | 化学         | 7.22    |
|    |       | 医薬品        | 4.97    |
|    |       | 石油・石炭製品    | 0.40    |
|    |       | ゴム製品       | 0.65    |
|    |       | ガラス・土石製品   | 0.77    |
|    |       | 鉄鋼         | 0.82    |
|    |       | 非鉄金属       | 0.74    |
|    |       | 金属製品       | 0.60    |
|    |       | 機械         | 5.50    |
|    |       | 電気機器       | 17.41   |
|    |       | 輸送用機器      | 7.47    |
|    |       | 精密機器       | 2.65    |
|    |       | その他製品      | 2.50    |
|    |       | 電気・ガス業     | 1.19    |
|    |       | 陸運業        | 3.25    |
|    |       | 海運業        | 0.27    |
|    |       | 空運業        | 0.46    |
|    |       | 倉庫・運輸関連業   | 0.16    |
|    |       | 情報・通信業     | 8.83    |
|    |       | 卸売業        | 4.62    |
|    |       | 小売業        | 4.42    |
|    |       | 銀行業        | 5.07    |
|    |       | 証券、商品先物取引業 | 0.80    |
|    |       | 保険業        | 1.90    |
|    |       | その他金融業     | 1.09    |
|    |       | 不動産業       | 1.95    |
|    |       | サービス業      | 5.49    |

|     |       |
|-----|-------|
| 合 計 | 97.91 |
|-----|-------|

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

| 順位 | 国／地域 | 種類 | 銘柄名                         | 業種                      | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|------|----|-----------------------------|-------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 株式 | APPLE INC                   | コンピュータ・周辺機器             | 2,849,200 | 13,173.39       | 37,533,637,604  | 13,677.19       | 38,969,060,005  | 3.85            |
| 2  | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP              | ソフトウェア                  | 1,216,100 | 25,486.27       | 30,993,855,379  | 27,404.87       | 33,327,070,676  | 3.30            |
| 3  | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC              | インターネット販売・通信販売          | 72,640    | 335,736.16      | 24,387,875,071  | 353,764.16      | 25,697,428,815  | 2.54            |
| 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    | 408,400   | 31,655.59       | 12,928,146,218  | 36,081.40       | 14,735,645,720  | 1.45            |
| 5  | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL C           | インタラクティブ・メディアおよびサービス    | 50,030    | 226,309.75      | 11,322,276,973  | 264,692.82      | 13,242,582,065  | 1.31            |
| 6  | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A           | インタラクティブ・メディアおよびサービス    | 51,070    | 225,216.60      | 11,501,811,892  | 258,687.85      | 13,211,188,806  | 1.30            |
| 7  | アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO         | 銀行                      | 517,800   | 16,973.83       | 8,789,053,781   | 18,026.98       | 9,334,371,487   | 0.92            |
| 8  | アメリカ | 株式 | TESLA INC                   | 自動車                     | 130,320   | 69,701.28       | 9,083,471,570   | 68,624.14       | 8,943,098,863   | 0.88            |
| 9  | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON           | 医薬品                     | 447,200   | 18,126.15       | 8,106,015,898   | 18,576.88       | 8,307,580,736   | 0.82            |
| 10 | アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP                 | 半導体・半導体製造装置             | 105,150   | 56,643.71       | 5,956,086,465   | 71,319.85       | 7,499,282,522   | 0.74            |
| 11 | アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 各種金融サービス                | 232,900   | 28,425.73       | 6,620,354,193   | 31,768.93       | 7,398,984,822   | 0.73            |
| 12 | 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 | 161,200   | 41,129.78       | 6,630,121,081   | 45,212.33       | 7,288,229,079   | 0.72            |
| 13 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES     | 情報技術サービス                | 287,500   | 23,295.58       | 6,697,481,988   | 24,948.44       | 7,172,678,800   | 0.71            |
| 14 | スイス  | 株式 | NESTLE SA-REG               | 食品                      | 489,400   | 12,924.03       | 6,325,020,853   | 13,546.63       | 6,629,725,224   | 0.65            |
| 15 | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT                  | 専門小売り                   | 182,900   | 33,547.57       | 6,135,851,466   | 35,003.56       | 6,402,151,417   | 0.63            |
| 16 | アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO         | 家庭用品                    | 417,900   | 14,872.48       | 6,215,209,392   | 14,801.13       | 6,185,394,734   | 0.61            |
| 17 | アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP        | 銀行                      | 1,323,000 | 4,287.87        | 5,672,862,678   | 4,652.72        | 6,155,557,027   | 0.60            |
| 18 | アメリカ | 株式 | DISNEY (WALT) CO            | 娯楽                      | 307,500   | 20,356.31       | 6,259,567,783   | 19,608.62       | 6,029,651,880   | 0.59            |
| 19 | アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC              | 情報技術サービス                | 150,500   | 39,334.69       | 5,919,871,025   | 39,577.26       | 5,956,377,750   | 0.58            |
| 20 | アメリカ | 株式 | PAYPAL HOLDINGS INC         | 情報技術サービス                | 189,100   | 25,971.24       | 4,911,162,284   | 28,539.79       | 5,396,875,272   | 0.53            |
| 21 | オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV             | 半導体・半導体製造装置             | 71,100    | 69,060.66       | 4,910,213,011   | 73,864.60       | 5,251,773,202   | 0.52            |
| 22 | アメリカ | 株式 | COMCAST CORP-CL A           | メディア                    | 775,600   | 6,041.99        | 4,686,171,490   | 6,293.63        | 4,881,345,943   | 0.48            |



|    |      |    |                              |             |         |           |               |           |               |      |
|----|------|----|------------------------------|-------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 23 | アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP             | 石油・ガス・消耗燃料  | 718,200 | 6,236.76  | 4,479,246,516 | 6,406.69  | 4,601,285,620 | 0.45 |
| 24 | スイス  | 株式 | ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 医薬品         | 119,300 | 37,029.20 | 4,417,583,686 | 38,474.79 | 4,590,043,163 | 0.45 |
| 25 | アメリカ | 株式 | ADOBE INC                    | ソフトウェア      | 81,490  | 51,117.00 | 4,165,524,964 | 55,382.70 | 4,513,136,288 | 0.44 |
| 26 | アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS       | 各種電気通信サービス  | 702,900 | 6,433.59  | 4,522,175,912 | 6,200.34  | 4,358,220,673 | 0.43 |
| 27 | アメリカ | 株式 | INTEL CORP                   | 半導体・半導体製造装置 | 689,600 | 6,977.44  | 4,811,644,831 | 6,269.49  | 4,323,441,132 | 0.42 |
| 28 | アメリカ | 株式 | COCA COLA CO                 | 飲料          | 693,500 | 5,838.68  | 4,049,131,105 | 6,068.63  | 4,208,595,182 | 0.41 |
| 29 | アメリカ | 株式 | CISCO SYSTEMS                | 通信機器        | 717,800 | 5,686.48  | 4,081,758,270 | 5,806.30  | 4,167,765,011 | 0.41 |
| 30 | アメリカ | 株式 | NETFLIX INC                  | 娯楽          | 75,050  | 56,277.19 | 4,223,603,642 | 55,188.42 | 4,141,891,341 | 0.41 |

## 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 | 4.53    |
|    |       | メディア                 | 1.12    |
|    |       | 娯楽                   | 1.46    |
|    |       | 不動産管理・開発             | 0.43    |
|    |       | エネルギー設備・サービス         | 0.15    |
|    |       | 石油・ガス・消耗燃料           | 3.08    |
|    |       | 化学                   | 2.18    |
|    |       | 建設資材                 | 0.26    |
|    |       | 容器・包装                | 0.29    |
|    |       | 金属・鉱業                | 1.66    |
|    |       | 紙製品・林産品              | 0.11    |
|    |       | 航空宇宙・防衛              | 1.54    |
|    |       | 建設関連製品               | 0.62    |
|    |       | 建設・土木                | 0.22    |
|    |       | 電気設備                 | 0.87    |
|    |       | コングロマリット             | 1.19    |
|    |       | 機械                   | 1.79    |
|    |       | 商社・流通業               | 0.32    |
|    |       | 商業サービス・用品            | 0.41    |
|    |       | 航空貨物・物流サービス          | 0.74    |
|    |       | 旅客航空輸送業              | 0.06    |
|    |       | 海運業                  | 0.08    |
|    |       | 陸運・鉄道                | 1.11    |
|    |       | 運送インフラ               | 0.13    |
|    |       | 自動車部品                | 0.28    |
|    |       | 自動車                  | 1.64    |
|    |       | 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             | 1.52  |
|      |   | ホテル・レストラン・レジャー          | 1.89  |
|      |   | 販売                      | 0.09  |
|      |   | インターネット販売・通信販売          | 3.06  |
|      |   | 複合小売り                   | 0.50  |
|      |   | 専門小売り                   | 1.69  |
|      |   | 食品・生活必需品小売り             | 1.33  |
|      |   | 飲料                      | 1.66  |
|      |   | 食品                      | 1.61  |
|      |   | タバコ                     | 0.66  |
|      |   | 家庭用品                    | 1.11  |
|      |   | パーソナル用品                 | 0.65  |
|      |   | ヘルスケア機器・用品              | 2.90  |
|      |   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 2.01  |
|      |   | バイオテクノロジー               | 1.69  |
|      |   | 医薬品                     | 4.51  |
|      |   | 銀行                      | 6.42  |
|      |   | 各種金融サービス                | 0.99  |
|      |   | 保険                      | 3.18  |
|      |   | 情報技術サービス                | 4.43  |
|      |   | ソフトウェア                  | 6.90  |
|      |   | 通信機器                    | 0.67  |
|      |   | コンピュータ・周辺機器             | 4.16  |
|      |   | 電子装置・機器・部品              | 0.53  |
|      |   | 半導体・半導体製造装置             | 4.38  |
|      |   | 各種電気通信サービス              | 1.43  |
|      |   | 無線通信サービス                | 0.29  |
|      |   | 電力                      | 1.75  |
|      |   | ガス                      | 0.15  |
|      |   | 総合公益事業                  | 0.83  |
|      |   | 水道                      | 0.10  |
|      |   | 消費者金融                   | 0.49  |
|      |   | 資本市場                    | 3.21  |
|      |   | 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       | 1.04  |
|      |   | 専門サービス                  | 0.78  |
| 投資証券 | — | —                       | 2.21  |
| 合 計  |   |                         | 98.15 |

(参考) 国内債券マザーファンド

| 順位 | 国／<br>地域 | 種類   | 銘柄名                        | 数量          | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------|------|----------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年) 第13<br>9回  | 600,000,000 | 100.70          | 604,218,000     | 100.66          | 603,960,000     | 0.1       | 2024/3/20  | 2.09            |
| 2  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>45回 | 480,000,000 | 101.01          | 484,848,000     | 101.00          | 484,819,200     | 0.1       | 2026/12/20 | 1.68            |
| 3  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>50回 | 470,000,000 | 101.06          | 475,010,200     | 101.05          | 474,967,900     | 0.1       | 2028/3/20  | 1.65            |
| 4  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年) 第13<br>4回  | 470,000,000 | 100.37          | 471,743,700     | 100.35          | 471,682,600     | 0.1       | 2022/12/20 | 1.63            |
| 5  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年) 第14<br>5回  | 410,000,000 | 100.98          | 414,042,600     | 100.95          | 413,899,100     | 0.1       | 2025/9/20  | 1.43            |
| 6  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>52回 | 400,000,000 | 100.95          | 403,800,000     | 100.98          | 403,952,000     | 0.1       | 2028/9/20  | 1.40            |
| 7  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>42回 | 390,000,000 | 100.97          | 393,806,400     | 100.96          | 393,759,600     | 0.1       | 2026/3/20  | 1.36            |
| 8  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>29回 | 350,000,000 | 101.97          | 356,923,000     | 101.92          | 356,734,000     | 0.8       | 2023/6/20  | 1.24            |
| 9  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>32回 | 350,000,000 | 101.93          | 356,786,500     | 101.87          | 356,545,000     | 0.6       | 2023/12/20 | 1.23            |
| 10 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年) 第14<br>3回  | 350,000,000 | 100.89          | 353,118,500     | 100.85          | 353,006,500     | 0.1       | 2025/3/20  | 1.22            |
| 11 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>34回 | 340,000,000 | 102.31          | 347,857,400     | 102.23          | 347,602,400     | 0.6       | 2024/6/20  | 1.20            |
| 12 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>51回 | 340,000,000 | 100.99          | 343,393,200     | 101.02          | 343,485,000     | 0.1       | 2028/6/20  | 1.19            |
| 13 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(20年) 第1<br>52回 | 300,000,000 | 113.17          | 339,534,000     | 113.20          | 339,603,000     | 1.2       | 2035/3/20  | 1.18            |
| 14 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>40回 | 330,000,000 | 102.30          | 337,596,600     | 102.24          | 337,421,700     | 0.4       | 2025/9/20  | 1.17            |
| 15 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>25回 | 330,000,000 | 101.26          | 334,161,300     | 101.20          | 333,986,400     | 0.8       | 2022/9/20  | 1.16            |
| 16 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>38回 | 300,000,000 | 102.05          | 306,162,000     | 102.00          | 306,012,000     | 0.4       | 2025/3/20  | 1.06            |
| 17 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>41回 | 300,000,000 | 101.92          | 305,769,000     | 101.87          | 305,628,000     | 0.3       | 2025/12/20 | 1.06            |
| 18 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>44回 | 300,000,000 | 100.99          | 302,988,000     | 100.98          | 302,955,000     | 0.1       | 2026/9/20  | 1.05            |
| 19 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>59回 | 300,000,000 | 100.49          | 301,494,000     | 100.54          | 301,623,000     | 0.1       | 2030/6/20  | 1.04            |
| 20 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(2年) 第41<br>7回  | 300,000,000 | 100.33          | 301,002,000     | 100.32          | 300,960,000     | 0.1       | 2022/10/1  | 1.04            |
| 21 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>48回 | 290,000,000 | 101.05          | 293,056,600     | 101.04          | 293,027,600     | 0.1       | 2027/9/20  | 1.01            |
| 22 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>46回 | 270,000,000 | 101.03          | 272,790,300     | 101.01          | 272,751,300     | 0.1       | 2027/3/20  | 0.94            |

|    |    |      |                            |             |        |             |        |             |     |            |      |
|----|----|------|----------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-----|------------|------|
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年) 第14<br>2回  | 270,000,000 | 100.83 | 272,251,800 | 100.80 | 272,168,100 | 0.1 | 2024/12/20 | 0.94 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>33回 | 250,000,000 | 102.13 | 255,342,500 | 102.06 | 255,162,500 | 0.6 | 2024/3/20  | 0.88 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>49回 | 250,000,000 | 101.06 | 252,652,500 | 101.05 | 252,630,000 | 0.1 | 2027/12/20 | 0.87 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>43回 | 250,000,000 | 100.97 | 252,437,500 | 100.96 | 252,410,000 | 0.1 | 2026/6/20  | 0.87 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(5年) 第14<br>6回  | 250,000,000 | 100.97 | 252,432,500 | 100.96 | 252,402,500 | 0.1 | 2025/12/20 | 0.87 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>53回 | 250,000,000 | 100.95 | 252,387,000 | 100.94 | 252,362,500 | 0.1 | 2028/12/20 | 0.87 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(20年) 第1<br>64回 | 240,000,000 | 102.46 | 245,925,600 | 102.46 | 245,906,400 | 0.5 | 2038/3/20  | 0.85 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>(10年) 第3<br>26回 | 240,000,000 | 101.33 | 243,194,400 | 101.28 | 243,081,600 | 0.7 | 2022/12/20 | 0.84 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 99.03   |
| 合 計  | 99.03   |

(参考) 外国債券マザーファンド

| 順位 | 国／<br>地域 | 種類   | 銘柄名                            | 数量         | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 利率<br>(%) | 償還期限       | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|----------|------|--------------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ     | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 78,600,000 | 14,835.72       | 11,660,878,352  | 14,814.17       | 11,643,937,620  | 5.375     | 2031/2/15  | 1.97            |
| 2  | アメリカ     | 国債証券 | US TREASURY<br>BOND            | 63,300,000 | 13,705.32       | 8,675,468,130   | 13,666.83       | 8,651,106,207   | 6         | 2026/2/15  | 1.47            |
| 3  | アメリカ     | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 66,000,000 | 11,249.75       | 7,424,836,698   | 11,239.68       | 7,418,189,353   | 1.5       | 2023/2/28  | 1.26            |
| 4  | アメリカ     | 国債証券 | US TREASURY<br>BOND            | 48,600,000 | 14,231.92       | 6,916,716,632   | 14,209.63       | 6,905,880,995   | 5.5       | 2028/8/15  | 1.17            |
| 5  | アメリカ     | 国債証券 | US TREASURY<br>BOND            | 48,000,000 | 14,105.87       | 6,770,819,737   | 14,086.15       | 6,761,352,805   | 5.25      | 2028/11/15 | 1.14            |
| 6  | アメリカ     | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 50,600,000 | 11,755.46       | 5,948,266,416   | 11,744.32       | 5,942,625,920   | 2.25      | 2025/11/15 | 1.01            |
| 7  | アメリカ     | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 51,500,000 | 11,490.92       | 5,917,827,953   | 11,486.21       | 5,915,399,014   | 2.5       | 2046/2/15  | 1.00            |
| 8  | スペイン     | 国債証券 | SPANISH<br>GOVERNMENT          | 27,800,000 | 20,938.33       | 5,820,856,963   | 20,922.28       | 5,816,395,397   | 5.75      | 2032/7/30  | 0.98            |
| 9  | アメリカ     | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 50,900,000 | 11,285.55       | 5,744,348,628   | 11,273.98       | 5,738,456,247   | 1.75      | 2023/1/31  | 0.97            |
| 10 | イタリア     | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 29,900,000 | 18,347.79       | 5,485,989,389   | 18,389.25       | 5,498,385,750   | 5.25      | 2029/11/1  | 0.93            |
| 11 | フランス     | 国債証券 | FRANCE<br>GOVERNMENT<br>O.A.T  | 33,800,000 | 16,020.04       | 5,414,775,514   | 15,973.90       | 5,399,180,093   | 3.5       | 2026/4/25  | 0.91            |

|    |      |      |                                |            |           |               |           |               |       |            |      |
|----|------|------|--------------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|------|
| 12 | フランス | 国債証券 | FRANCE<br>GOVERNMENT<br>O.A.T  | 25,550,000 | 20,680.25 | 5,283,806,173 | 20,670.34 | 5,281,272,425 | 3.25  | 2045/5/25  | 0.89 |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>BOND            | 45,100,000 | 11,696.72 | 5,275,224,356 | 11,688.15 | 5,271,357,279 | 2.375 | 2024/8/15  | 0.89 |
| 14 | フランス | 国債証券 | FRANCE<br>GOVERNMENT<br>O.A.T  | 27,000,000 | 19,411.46 | 5,241,095,534 | 19,352.28 | 5,225,116,948 | 5.5   | 2029/4/25  | 0.88 |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 42,700,000 | 11,698.22 | 4,995,142,721 | 11,692.87 | 4,992,855,490 | 2.5   | 2024/5/15  | 0.84 |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 42,600,000 | 11,673.14 | 4,972,760,718 | 11,662.85 | 4,968,377,178 | 2.75  | 2023/11/15 | 0.84 |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 43,000,000 | 11,556.95 | 4,969,490,775 | 11,551.81 | 4,967,278,661 | 2.25  | 2023/12/31 | 0.84 |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 42,700,000 | 11,621.69 | 4,962,464,715 | 11,609.69 | 4,957,338,346 | 2.125 | 2024/9/30  | 0.84 |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 40,600,000 | 12,194.50 | 4,950,969,934 | 12,179.07 | 4,944,703,101 | 2.875 | 2028/5/15  | 0.84 |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>BOND            | 38,800,000 | 12,485.62 | 4,844,423,689 | 12,449.61 | 4,830,450,082 | 6.25  | 2023/8/15  | 0.82 |
| 21 | イギリス | 国債証券 | UK TSY 3 1/4%<br>2044          | 21,800,000 | 21,590.90 | 4,706,816,287 | 21,567.61 | 4,701,739,022 | 3.25  | 2044/1/22  | 0.79 |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 39,900,000 | 11,504.64 | 4,590,354,578 | 11,494.78 | 4,586,420,103 | 2.5   | 2045/2/15  | 0.77 |
| 23 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 40,500,000 | 11,330.14 | 4,588,709,626 | 11,323.28 | 4,585,931,326 | 1.75  | 2023/5/15  | 0.77 |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 38,000,000 | 11,846.36 | 4,501,617,437 | 11,835.64 | 4,497,544,573 | 2.375 | 2027/5/15  | 0.76 |
| 25 | フランス | 国債証券 | FRANCE<br>GOVERNMENT<br>O.A.T  | 20,400,000 | 21,864.53 | 4,460,365,630 | 21,802.42 | 4,447,695,423 | 5.75  | 2032/10/25 | 0.75 |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 35,100,000 | 12,537.07 | 4,400,514,401 | 12,531.07 | 4,398,407,427 | 3     | 2044/11/15 | 0.74 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 37,100,000 | 11,601.11 | 4,304,014,490 | 11,592.11 | 4,300,674,150 | 2.75  | 2023/7/31  | 0.73 |
| 28 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 22,500,000 | 18,528.33 | 4,168,876,410 | 18,522.99 | 4,167,672,750 | 6.5   | 2027/11/1  | 0.70 |
| 29 | イギリス | 国債証券 | UK TREASURY                    | 18,440,000 | 22,609.30 | 4,169,155,362 | 22,580.04 | 4,163,761,146 | 3.5   | 2045/1/22  | 0.70 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY<br>N/B             | 34,500,000 | 11,995.13 | 4,138,322,632 | 11,985.27 | 4,134,920,643 | 2.875 | 2025/4/30  | 0.70 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 99.08   |
| 合 計  | 99.08   |

②【投資不動産物件】

バランスセレクト70（確定拠出年金向け）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

バランスセレクト70（確定拠出年金向け）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

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

| 種類           | 取引所   | 名称                 | 買建／<br>売建 | 枚数  | 通貨  | 帳簿価額<br>(円)   | 評価額<br>(円)    | 投資<br>比率<br>(%) |
|--------------|-------|--------------------|-----------|-----|-----|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物<br>取引 | 大阪取引所 | TOPIX先物(2021年06月限) | 買建        | 416 | 日本円 | 7,990,466,101 | 8,022,560,000 | 2.08            |

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

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

| 種類               | 国／地<br>域        | 取引所                            | 名称                                     | 買建／<br>売建 | 枚数  | 通貨         | 帳簿価額          | 帳簿価額<br>(円)    | 評価額         | 評価額<br>(円)     | 投資<br>比率<br>(%) |
|------------------|-----------------|--------------------------------|----------------------------------------|-----------|-----|------------|---------------|----------------|-------------|----------------|-----------------|
| 株価指<br>数先物<br>取引 | アメリカ            | シカゴ<br>マーカン<br>タイル取<br>引所      | E-mini S&P500株<br>価指数先物(2021<br>年06月限) | 買建        | 579 | 米ドル        | 120,684,437.5 | 13,246,323,860 | 121,662,375 | 13,353,662,280 | 1.32            |
|                  | カナダ             | モントリ<br>オール取<br>引所             | S&P TSX60株価指<br>数先物(2021年06<br>月限)     | 買建        | 32  | カナダド<br>ル  | 7,266,640     | 659,883,577    | 7,601,920   | 690,330,344    | 0.06            |
|                  | ドイツ             | ユーレック<br>ス・ドイツ<br>金融先物取<br>引所  | ユーロ50株価指数<br>先物(2021年06月<br>限)         | 買建        | 371 | ユーロ        | 14,584,800    | 1,950,571,149  | 15,084,860  | 2,017,449,163  | 0.19            |
|                  | オース<br>トラリ<br>ア | シドニー先<br>物取引所                  | SPI200株価指数先<br>物(2021年06月限)            | 買建        | 28  | 豪ドル        | 4,820,750     | 407,739,033    | 5,022,500   | 424,803,044    | 0.04            |
|                  | イギリ<br>ス        | ロンドン国<br>際金融先物<br>オプション<br>取引所 | FT100株価指数先<br>物(2021年06月限)             | 買建        | 80  | 英ポンド       | 5,490,330     | 854,295,348    | 5,618,800   | 874,285,280    | 0.08            |
|                  | スイス             | ユーレック<br>ス・チュー<br>リッヒ取<br>引所   | SMI株価指数先物<br>(2021年06月限)               | 買建        | 41  | スイスフ<br>ラン | 4,534,270     | 552,772,855    | 4,684,660   | 571,106,889    | 0.05            |

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）

2021年5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11計算期間 (2012年 5月10日) | 69         | 69    | 0.9814       | 0.9814 |
| 第12計算期間 (2013年 5月10日) | 97         | 97    | 1.4047       | 1.4052 |
| 第13計算期間 (2014年 5月12日) | 82         | 82    | 1.4577       | 1.4582 |
| 第14計算期間 (2015年 5月11日) | 109        | 109   | 1.8263       | 1.8268 |
| 第15計算期間 (2016年 5月10日) | 109        | 109   | 1.6411       | 1.6416 |
| 第16計算期間 (2017年 5月10日) | 124        | 124   | 1.8736       | 1.8741 |
| 第17計算期間 (2018年 5月10日) | 156        | 156   | 2.0314       | 2.0319 |
| 第18計算期間 (2019年 5月10日) | 151        | 151   | 1.9481       | 1.9486 |
| 第19計算期間 (2020年 5月11日) | 126        | 126   | 1.9271       | 1.9276 |
| 第20計算期間 (2021年 5月10日) | 157        | 157   | 2.4466       | 2.4471 |
| 2020年 5月末日            | 130        | —     | 2.0009       | —      |
| 6月末日                  | 130        | —     | 2.0092       | —      |
| 7月末日                  | 129        | —     | 1.9923       | —      |
| 8月末日                  | 137        | —     | 2.1001       | —      |
| 9月末日                  | 137        | —     | 2.0925       | —      |
| 10月末日                 | 135        | —     | 2.0464       | —      |
| 11月末日                 | 145        | —     | 2.2090       | —      |
| 12月末日                 | 148        | —     | 2.2557       | —      |
| 2021年 1月末日            | 134        | —     | 2.2672       | —      |
| 2月末日                  | 139        | —     | 2.3117       | —      |
| 3月末日                  | 146        | —     | 2.4164       | —      |
| 4月末日                  | 154        | —     | 2.4131       | —      |
| 5月末日                  | 152        | —     | 2.4385       | —      |

②【分配の推移】

## バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）

|         | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|---------|-------------------------|-----------|
| 第11計算期間 | 2011年 5月11日～2012年 5月10日 | 0.0000円   |
| 第12計算期間 | 2012年 5月11日～2013年 5月10日 | 0.0005円   |
| 第13計算期間 | 2013年 5月11日～2014年 5月12日 | 0.0005円   |
| 第14計算期間 | 2014年 5月13日～2015年 5月11日 | 0.0005円   |
| 第15計算期間 | 2015年 5月12日～2016年 5月10日 | 0.0005円   |
| 第16計算期間 | 2016年 5月11日～2017年 5月10日 | 0.0005円   |
| 第17計算期間 | 2017年 5月11日～2018年 5月10日 | 0.0005円   |
| 第18計算期間 | 2018年 5月11日～2019年 5月10日 | 0.0005円   |
| 第19計算期間 | 2019年 5月11日～2020年 5月11日 | 0.0005円   |
| 第20計算期間 | 2020年 5月12日～2021年 5月10日 | 0.0005円   |

## ③【収益率の推移】

## バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）

|         | 計算期間                    | 収益率    |
|---------|-------------------------|--------|
| 第11計算期間 | 2011年 5月11日～2012年 5月10日 | △5.0%  |
| 第12計算期間 | 2012年 5月11日～2013年 5月10日 | 43.2%  |
| 第13計算期間 | 2013年 5月11日～2014年 5月12日 | 3.8%   |
| 第14計算期間 | 2014年 5月13日～2015年 5月11日 | 25.3%  |
| 第15計算期間 | 2015年 5月12日～2016年 5月10日 | △10.1% |
| 第16計算期間 | 2016年 5月11日～2017年 5月10日 | 14.2%  |
| 第17計算期間 | 2017年 5月11日～2018年 5月10日 | 8.4%   |
| 第18計算期間 | 2018年 5月11日～2019年 5月10日 | △4.1%  |
| 第19計算期間 | 2019年 5月11日～2020年 5月11日 | △1.1%  |
| 第20計算期間 | 2020年 5月12日～2021年 5月10日 | 27.0%  |

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）

|         | 計算期間                    | 設定口数       | 解約口数       | 発行済み口数     |
|---------|-------------------------|------------|------------|------------|
| 第11計算期間 | 2011年 5月11日～2012年 5月10日 | 8,338,981  | 4,703,910  | 70,387,722 |
| 第12計算期間 | 2012年 5月11日～2013年 5月10日 | 16,507,979 | 17,803,929 | 69,091,772 |



|         |                         |            |            |            |
|---------|-------------------------|------------|------------|------------|
| 第13計算期間 | 2013年 5月11日～2014年 5月12日 | 18,129,739 | 30,374,297 | 56,847,214 |
| 第14計算期間 | 2014年 5月13日～2015年 5月11日 | 26,548,644 | 23,661,640 | 59,734,218 |
| 第15計算期間 | 2015年 5月12日～2016年 5月10日 | 15,486,501 | 8,782,589  | 66,438,130 |
| 第16計算期間 | 2016年 5月11日～2017年 5月10日 | 12,984,557 | 13,007,209 | 66,415,478 |
| 第17計算期間 | 2017年 5月11日～2018年 5月10日 | 19,361,847 | 8,932,707  | 76,844,618 |
| 第18計算期間 | 2018年 5月11日～2019年 5月10日 | 6,735,514  | 5,770,059  | 77,810,073 |
| 第19計算期間 | 2019年 5月11日～2020年 5月11日 | 7,204,933  | 19,348,801 | 65,666,205 |
| 第20計算期間 | 2020年 5月12日～2021年 5月10日 | 10,667,199 | 11,907,740 | 64,425,664 |

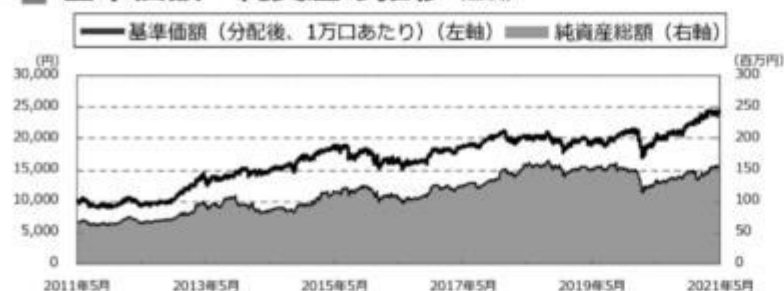
※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

《参考情報》



## 運用実績（2021年5月31日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次）



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

|         |       |
|---------|-------|
| 2021年5月 | 5 円   |
| 2020年5月 | 5 円   |
| 2019年5月 | 5 円   |
| 2018年5月 | 5 円   |
| 2017年5月 | 5 円   |
| 設定来累計   | 105 円 |

### ■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率

| 順位 | 銘柄                      | 投資比率(%) |
|----|-------------------------|---------|
| 1  | 国内株式マザーファンド             | 44.6    |
| 2  | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 25.1    |
| 3  | 国内債券マザーファンド             | 20.1    |
| 4  | 外国債券マザーファンド             | 10.0    |

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 業種     | 投資比率(%) |
|----|-------------------|--------|---------|
| 1  | トヨタ自動車            | 輸送用機器  | 1.5     |
| 2  | ソニーグループ           | 電気機器   | 1.1     |
| 3  | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 1.1     |
| 4  | キーエンス             | 電気機器   | 0.9     |
| 5  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 0.7     |

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 業種                   | 投資比率(%) |
|----|-------------------|----------------------|---------|
| 1  | APPLE INC         | コンピュータ・周辺機器          | 1.0     |
| 2  | MICROSOFT CORP    | ソフトウェア               | 0.8     |
| 3  | AMAZON.COM INC    | インターネット販売・通信販売       | 0.6     |
| 4  | FACEBOOK INC-A    | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.4     |
| 5  | ALPHABET INC-CL C | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.3     |

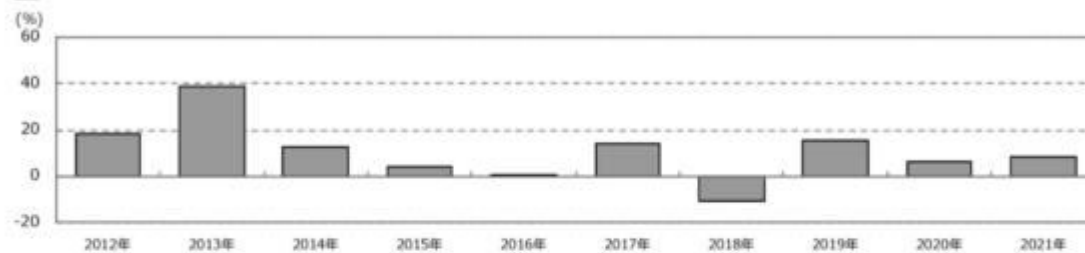
・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 種類   | 投資比率(%) |
|----|-------------------|------|---------|
| 1  | 国庫債券 利付（5年）第139回  | 国債証券 | 0.4     |
| 2  | 国庫債券 利付（10年）第345回 | 国債証券 | 0.3     |
| 3  | 国庫債券 利付（10年）第350回 | 国債証券 | 0.3     |
| 4  | 国庫債券 利付（5年）第134回  | 国債証券 | 0.3     |
| 5  | 国庫債券 利付（5年）第145回  | 国債証券 | 0.3     |

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

## ■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・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。

## 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。

取得申込の受付けについては、午後3時までに、買付のお申込みが行なわれかつその買付のお申込み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。

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

野村アセットマネジメント株式会社  
サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）  
＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時  
インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

販売の単位は、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

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。

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

金融商品取引所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、委託者に1口単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

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

一部解約の実行の請求の受付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行なわれかつ、その解約請求の受け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、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社  
サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口解約には制限を設ける場合があります。

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

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。

金融商品取引所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け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

※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 <sup>※1</sup> 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 <sup>※1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します <sup>※2</sup> 。<br>① 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）<br>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)<br>③ 価格情報会社の提供する価額 |
| 外貨建資産 | 原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行います。                                                                                                                     |

※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(2001年11月22日設定)。

## （４）【計算期間】

原則として毎年5月11日から翌年5月10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、やむを得ない事情が発生したとき等は、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(ii) 上記(i)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

(iii) 上記(ii)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。

(iv) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(v) 上記(ii)から(iv)までの規定は、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(ii)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

(vi)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。

(vii)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(iv)」に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

(viii)受託者が委託者の承諾を受けてその任務を辞任する場合、または、委託者または受益者が裁判所に受託者の解任を請求し裁判所が受託者を解任した場合、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。

#### (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、知られたる受益者に対して交付します。

#### (d) 信託約款の変更

(i)委託者は、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

(ii)委託者は、上記(i)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(iii)上記(ii)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

(iv)上記(iii)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記(i)の信託約款の変更をしません。

(v)委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(vi)委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記(i)から(v)までの規定にしたがいます。

#### (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) 反対者の買取請求権

ファンドの信託契約の解約または信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、前述の「(b)信託期間の終了」(i)または「(d)信託約款の変更」(ii)に規定する公告または書面に付記します。

#### (g) 関係法人との契約の更新に関する手續

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■

収益分配金は、自動けいぞく投資契約に基づいて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。

##### 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】

(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20期計算期間(2020年5月12日から2021年5月10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】

## 【バランスセレクト70（確定拠出年金向け）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第19期<br>(2020年 5月11日現在) | 第20期<br>(2021年 5月10日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部            |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 613,615                 | 726,765                 |
| 親投資信託受益証券       | 126,427,501             | 157,466,037             |
| 未収入金            | 48,685                  | -                       |
| 流動資産合計          | 127,089,801             | 158,192,802             |
| 資産合計            | 127,089,801             | 158,192,802             |
| 負債の部            |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払収益分配金         | 32,833                  | 32,212                  |
| 未払受託者報酬         | 38,089                  | 39,831                  |
| 未払委託者報酬         | 472,290                 | 493,868                 |
| その他未払費用         | 2,228                   | 2,335                   |
| 流動負債合計          | 545,440                 | 568,246                 |
| 負債合計            | 545,440                 | 568,246                 |
| 純資産の部           |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 65,666,205              | 64,425,664              |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 60,878,156              | 93,198,892              |
| （分配準備積立金）       | 24,954,920              | 42,410,759              |
| 元本等合計           | 126,544,361             | 157,624,556             |
| 純資産合計           | 126,544,361             | 157,624,556             |
| 負債純資産合計         | 127,089,801             | 158,192,802             |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第19期<br>自 2019年 5月11日<br>至 2020年 5月11日 | 第20期<br>自 2020年 5月12日<br>至 2021年 5月10日 |
|-------------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                        |                                        |
| 有価証券売買等損益                                 | 566,548                                | 34,278,845                             |
| 営業収益合計                                    | 566,548                                | 34,278,845                             |
| 営業費用                                      |                                        |                                        |
| 支払利息                                      | 43                                     | 13                                     |
| 受託者報酬                                     | 80,252                                 | 76,763                                 |
| 委託者報酬                                     | 995,011                                | 951,807                                |
| その他費用                                     | 4,696                                  | 4,487                                  |
| 営業費用合計                                    | 1,080,002                              | 1,033,070                              |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | △513,454                               | 33,245,775                             |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | △513,454                               | 33,245,775                             |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | △513,454                               | 33,245,775                             |
| 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（△） | 1,183,493                              | 3,472,533                              |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 73,772,607                             | 60,878,156                             |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 7,246,511                              | 13,735,289                             |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 7,246,511                              | 13,735,289                             |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 18,411,182                             | 11,155,583                             |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 18,411,182                             | 11,155,583                             |
| 分配金                                       | 32,833                                 | 32,212                                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 60,878,156                             | 93,198,892                             |

## (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<br>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<br>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 5月12日から2021年 5月10日までとなっております。                                                            |

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

## (貸借対照表に関する注記)

| 第19期<br>2020年 5月11日現在                                                         | 第20期<br>2021年 5月10日現在                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>65,666,205口                                           | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>64,425,664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<br>1口当たり純資産額 1.9271円<br>(10,000口当たり純資産額) (19,271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<br>1口当たり純資産額 2.4466円<br>(10,000口当たり純資産額) (24,466円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第19期<br>自 2019年 5月11日<br>至 2020年 5月11日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 第20期<br>自 2020年 5月12日<br>至 2021年 5月10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>1,648,971円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>57,398,645円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>23,338,782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>82,386,398円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>65,666,205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>12,546円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>32,833円</td></tr></table> | 項目                                     |              |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 1,648,971円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | 収益調整金額 | C | 57,398,645円 | 分配準備積立金額 | D | 23,338,782円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 82,386,398円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 65,666,205口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 12,546円 | 10,000口当たり分配金額 | H | 5円 | 収益分配金金額 | I=F×H/10,000 | 32,833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>2,408,027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>19,373,152円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>60,163,906円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>20,661,792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>102,606,877円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>64,425,664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>15,926円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>32,212円</td></tr></table> | 項目 |  |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 2,408,027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 | 19,373,152円 | 収益調整金額 | C | 60,163,906円 | 分配準備積立金額 | D | 20,661,792円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 102,606,877円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 64,425,664口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 15,926円 | 10,000口当たり分配金額 | H | 5円 | 収益分配金金額 | I=F×H/10,000 | 32,212円 |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                        |              |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | A                                      | 1,648,971円   |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | B                                      | 0円           |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | C                                      | 57,398,645円  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | D                                      | 23,338,782円  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | E=A+B+C+D                              | 82,386,398円  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | F                                      | 65,666,205口  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 10,000口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | G=E/F×10,000                           | 12,546円      |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 10,000口当たり分配金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | H                                      | 5円           |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 収益分配金金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | I=F×H/10,000                           | 32,833円      |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                        |              |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | A                                      | 2,408,027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                                      | 19,373,152円  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | C                                      | 60,163,906円  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | D                                      | 20,661,792円  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | E=A+B+C+D                              | 102,606,877円 |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 当ファンドの期末残存口数                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | F                                      | 64,425,664口  |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 10,000口当たり収益分配対象額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | G=E/F×10,000                           | 15,926円      |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 10,000口当たり分配金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | H                                      | 5円           |  |              |   |            |                           |   |    |        |   |             |          |   |             |               |           |             |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |  |  |              |   |            |                           |   |             |        |   |             |          |   |             |               |           |              |              |   |             |                   |              |         |                |   |    |         |              |         |
| 収益分配金金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | I=F×H/10,000                           | 32,212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19期<br>自 2019年 5月11日<br>至 2020年 5月11日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 第20期<br>自 2020年 5月12日<br>至 2021年 5月10日                                                                     |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> | <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p> |

## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 第19期<br>2020年 5月11日現在                                                                                     | 第20期<br>2021年 5月10日現在                                 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> |

|                                                                                                                                             |    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| <b>親投資信託受益証券</b><br>（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。<br><b>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</b><br>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）

| <b>第19期</b><br>自 2019年 5月11日<br>至 2020年 5月11日                         | <b>第20期</b><br>自 2020年 5月12日<br>至 2021年 5月10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

| <b>第19期</b><br>自 2019年 5月11日<br>至 2020年 5月11日 | <b>第20期</b><br>自 2020年 5月12日<br>至 2021年 5月10日 |
|-----------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 期首元本額 77,810,073円                             | 期首元本額 65,666,205円                             |
| 期中追加設定元本額 7,204,933円                          | 期中追加設定元本額 10,667,199円                         |
| 期中一部解約元本額 19,348,801円                         | 期中一部解約元本額 11,907,740円                         |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類        | <b>第19期</b><br>自 2019年 5月11日<br>至 2020年 5月11日 | <b>第20期</b><br>自 2020年 5月12日<br>至 2021年 5月10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 | △1,479,964                                    | 29,824,802                                    |
| 合計        | △1,479,964                                    | 29,824,802                                    |

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5月10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5月10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             | 34,867,911 | 71,130,538            |    |
|           |     | 国内債券マザーファンド             | 22,946,446 | 31,303,541            |    |
|           |     | 外国債券マザーファンド             | 6,214,458  | 15,649,248            |    |
|           |     | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 9,910,592  | 39,382,710            |    |
|           | 小計  | 銘柄数：4<br>組入時価比率：99.9%   | 73,939,407 | 157,466,037<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                         |            | 157,466,037           |    |

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「国内債券マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

| (2021年 5月10日現在) |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産の部            |                 |
| 流動資産            |                 |
| コール・ローン         | 44,988,320,369  |
| 株式              | 375,833,453,070 |
| 派生商品評価勘定        | 94,913,085      |
| 未収配当金           | 3,735,225,261   |
| 未収利息            | 121,005         |
| その他未収収益         | 44,504,310      |
| 差入委託証拠金         | 374,953,100     |
| 流動資産合計          | 425,071,490,200 |
| 資産合計            | 425,071,490,200 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 48,877,695      |

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 未払金             | 13,358,038      |
| 未払解約金           | 35,484,489,542  |
| 未払利息            | 22,407          |
| 有価証券貸借取引受入金     | 3,927,200,592   |
| 流動負債合計          | 39,473,948,274  |
| 負債合計            | 39,473,948,274  |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 189,017,112,223 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 196,580,429,703 |
| 元本等合計           | 385,597,541,926 |
| 純資産合計           | 385,597,541,926 |
| 負債純資産合計         | 425,071,490,200 |

## 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<br>原則として時価で評価しております。<br>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<br>取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。<br>受取配当金<br>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。<br>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<br>約定日基準で計上しております。<br>派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>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。<br>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。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

| 2021年 5月10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                  | 2.0400円 |



|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| (10,000口当たり純資産額)           | (20,400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 | 3,765,040,170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

| <p>自 2020年 5月12日<br/>至 2021年 5月10日</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p><b>1.金融商品に対する取組方針</b><br/>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p><b>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</b><br/>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。<br/>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。<br/>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。<br/>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p><b>3.金融商品に係るリスク管理体制</b><br/>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>○市場リスクの管理<br/>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>○信用リスクの管理<br/>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>○流動性リスクの管理<br/>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| <p>2021年 5月10日現在</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p><b>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</b><br/>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p><b>2. 時価の算定方法</b><br/><b>株式</b><br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p><b>派生商品評価勘定</b><br/>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p><b>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</b><br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 5月10日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2020年 5月12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 | 279,253,369,640円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 23,335,658,932円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 113,571,916,349円 |
| 期末元本額                            | 189,017,112,223円 |
| 期末元本額の内訳※                        |                  |
| バランスセレクト30                       | 140,022,812円     |
| バランスセレクト50                       | 313,849,023円     |
| バランスセレクト70                       | 440,069,742円     |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース）               | 2,307,293,190円   |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース）               | 2,958,763,691円   |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース）               | 7,585,527,508円   |
| 野村資産設計ファンド2015                   | 39,488,612円      |
| 野村資産設計ファンド2020                   | 39,277,688円      |
| 野村資産設計ファンド2025                   | 73,941,030円      |
| 野村資産設計ファンド2030                   | 101,390,924円     |
| 野村資産設計ファンド2035                   | 83,905,441円      |
| 野村資産設計ファンド2040                   | 161,263,364円     |
| 野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）          | 15,014,456,932円  |
| のむラップ・ファンド（保守型）                  | 2,278,293,916円   |
| のむラップ・ファンド（普通型）                  | 8,695,111,419円   |
| のむラップ・ファンド（積極型）                  | 2,605,707,453円   |
| 野村資産設計ファンド2045                   | 26,478,951円      |
| 野村インデックスファンド・TOPIX               | 1,679,369,131円   |
| マイ・ロード                           | 3,191,469,284円   |
| ネクストコア                           | 19,011,164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    | 1,352,391,649円   |
| 野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）        | 2,339,716,726円   |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース）             | 1,461,328,501円   |
| 野村資産設計ファンド2050                   | 39,493,907円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 13,064,858円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 6,709,190円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 5,138,457円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 4,117,723円       |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                | 302,031,995円     |
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                | 361,028,737円     |
| インデックス・ブレンド（タイプⅠ）                | 3,307,598円       |
| インデックス・ブレンド（タイプⅡ）                | 3,751,683円       |
| インデックス・ブレンド（タイプⅢ）                | 15,910,681円      |
| インデックス・ブレンド（タイプⅣ）                | 5,531,274円       |
| インデックス・ブレンド（タイプⅤ）                | 22,186,770円      |
| 野村6資産均等バランス                      | 1,951,592,442円   |
| 世界6資産分散ファンド                      | 79,787,197円      |
| 野村資産設計ファンド2060                   | 19,460,583円      |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式           | 691,314,864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） | 321,094,000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） | 151,076,855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）               | 515,311,620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）               | 580,285,208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）               | 3,423,934円      |
| ワールド・インデックス・ファンドＶＡバランス型（適格機関投資家専用）             | 8,495,347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）               | 885,380円        |
| 野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）                   | 2,494,073,607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）              | 8,207,928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）              | 75,664,570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）               | 67,530,749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）                 | 23,325,274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）             | 96,567,613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）             | 208,220,831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）             | 4,285,699,847円  |
| 野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）                        | 59,068,096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）                 | 391,895,637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）            | 1,590,034,474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）               | 246,968,397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）             | 699,275,196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） | 2,388,183円      |
| バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）                           | 5,973,831円      |
| バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）                           | 27,270,818円     |
| バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）                           | 34,867,911円     |
| 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）                      | 119,310,499円    |
| マイバランス３０（確定拠出年金向け）                             | 8,958,214,964円  |
| マイバランス５０（確定拠出年金向け）                             | 24,083,598,606円 |
| マイバランス７０（確定拠出年金向け）                             | 27,093,324,207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）               | 32,220,763,485円 |
| マイバランスＤＣ３０                                     | 3,167,103,613円  |
| マイバランスＤＣ５０                                     | 5,299,473,498円  |
| マイバランスＤＣ７０                                     | 5,206,076,741円  |
| 野村ＤＣ国内株式インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ                       | 9,945,323,488円  |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド                                   | 365,001,395円    |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）                             | 30,864,791円     |
| マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）                          | 1,151,048,194円  |
| マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）                          | 912,963,559円    |
| マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）                          | 782,670,090円    |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース                           | 8,983,053円      |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース                         | 4,381,261円      |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース                           | 66,741,873円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０                    | 18,375,215円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０                    | 15,996,706円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０                    | 13,386,405円     |
| マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）                          | 404,598,424円    |
| マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）                          | 326,996,341円    |
| マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）                          | 200,134,268円    |
| マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）                          | 253,526,608円    |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０                    | 7,785,224円      |

|                               |             |
|-------------------------------|-------------|
| マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）         | 30,247,336円 |
| 多資産分散投資ファンド（バランス１０）（確定拠出年金向け） | 60,963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5月10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             | 6,200   | 3,005.00 | 18,631,000  |                          |
|    |     | 日本水産           | 176,800 | 540.00   | 95,472,000  |                          |
|    |     | マルハニチロ         | 29,800  | 2,662.00 | 79,327,600  |                          |
|    |     | 雪国まいたけ         | 15,600  | 1,974.00 | 30,794,400  |                          |
|    |     | カネコ種苗          | 5,800   | 1,573.00 | 9,123,400   |                          |
|    |     | サカタのタネ         | 22,700  | 3,825.00 | 86,827,500  |                          |
|    |     | ホクト            | 16,000  | 2,030.00 | 32,480,000  | 貸付有価証券<br>5,300株（4,200株） |
|    |     | ホクリヨウ          | 2,900   | 723.00   | 2,096,700   |                          |
|    |     | 住石ホールディングス     | 33,300  | 130.00   | 4,329,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
|    |     | 日鉄鉱業           | 4,400   | 6,890.00 | 30,316,000  |                          |
|    |     | 三井松島ホールディングス   | 8,000   | 990.00   | 7,920,000   |                          |
|    |     | I N P E X      | 700,100 | 813.00   | 569,181,300 |                          |
|    |     | 石油資源開発         | 24,900  | 2,238.00 | 55,726,200  | 貸付有価証券<br>200株           |
|    |     | K&Oエナジーグループ    | 9,200   | 1,447.00 | 13,312,400  |                          |
|    |     | ヒノキヤグループ       | 4,700   | 2,591.00 | 12,177,700  |                          |
|    |     | ショーボンドホールディングス | 27,200  | 4,660.00 | 126,752,000 |                          |
|    |     | ミライト・ホールディングス  | 66,000  | 1,812.00 | 119,592,000 |                          |
|    |     | タマホーム          | 11,500  | 2,477.00 | 28,485,500  | 貸付有価証券<br>3,100株         |
|    |     | サンヨーホームズ       | 2,200   | 766.00   | 1,685,200   |                          |
|    |     | 日本アクア          | 7,600   | 619.00   | 4,704,400   |                          |

|                  |         |          |             |                   |
|------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| ファーストコーポレーション    | 5,800   | 779.00   | 4,518,200   | 貸付有価証券<br>800株    |
| ベステラ             | 3,600   | 1,647.00 | 5,929,200   |                   |
| Robot Home       | 35,700  | 175.00   | 6,247,500   |                   |
| キャンディル           | 3,300   | 541.00   | 1,785,300   |                   |
| スペースバリューホールディングス | 23,200  | 770.00   | 17,864,000  |                   |
| ダイセキ環境ソリューション    | 3,700   | 977.00   | 3,614,900   |                   |
| 第一カッター興業         | 4,700   | 1,416.00 | 6,655,200   |                   |
| 安藤・間             | 122,100 | 861.00   | 105,128,100 | 貸付有価証券<br>49,600株 |
| 東急建設             | 55,800  | 585.00   | 32,643,000  | 貸付有価証券<br>300株    |
| コムシスホールディングス     | 67,500  | 3,580.00 | 241,650,000 |                   |
| ビーアールホールディングス    | 25,500  | 577.00   | 14,713,500  |                   |
| 高松コンストラクショングループ  | 11,800  | 2,076.00 | 24,496,800  |                   |
| 東建コーポレーション       | 5,900   | 9,930.00 | 58,587,000  |                   |
| ソネック             | 2,000   | 936.00   | 1,872,000   |                   |
| ヤマウラ             | 8,300   | 924.00   | 7,669,200   | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| オリエンタル白石         | 64,000  | 300.00   | 19,200,000  |                   |
| 大成建設             | 136,800 | 4,230.00 | 578,664,000 | 貸付有価証券<br>100株    |
| 大林組              | 439,600 | 1,041.00 | 457,623,600 | 貸付有価証券<br>300株    |
| 清水建設             | 411,800 | 935.00   | 385,033,000 | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 飛島建設             | 12,600  | 1,135.00 | 14,301,000  |                   |
| 長谷工コーポレーション      | 144,000 | 1,536.00 | 221,184,000 | 貸付有価証券<br>1,300株  |
| 松井建設             | 17,300  | 726.00   | 12,559,800  |                   |
| 銭高組              | 1,900   | 4,530.00 | 8,607,000   |                   |
| 鹿島建設             | 322,100 | 1,583.00 | 509,884,300 |                   |
| 不動テトラ            | 10,800  | 1,907.00 | 20,595,600  |                   |
| 大末建設             | 5,500   | 974.00   | 5,357,000   |                   |
| 鉄建建設             | 8,900   | 1,868.00 | 16,625,200  |                   |

|               |         |           |             |                          |
|---------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| 西松建設          | 31,500  | 2,944.00  | 92,736,000  | 貸付有価証券<br>2,400株         |
| 三井住友建設        | 106,200 | 486.00    | 51,613,200  |                          |
| 大豊建設          | 9,600   | 3,985.00  | 38,256,000  | 貸付有価証券<br>700株           |
| 前田建設工業        | 110,100 | 981.00    | 108,008,100 | 貸付有価証券<br>9,300株         |
| 佐田建設          | 10,100  | 436.00    | 4,403,600   |                          |
| ナカノフドー建設      | 10,500  | 385.00    | 4,042,500   |                          |
| 奥村組           | 24,200  | 2,783.00  | 67,348,600  |                          |
| 東鉄工業          | 18,900  | 2,603.00  | 49,196,700  |                          |
| イチケン          | 3,200   | 1,934.00  | 6,188,800   |                          |
| 富士ピー・エス       | 5,700   | 591.00    | 3,368,700   |                          |
| 浅沼組           | 5,300   | 4,535.00  | 24,035,500  |                          |
| 戸田建設          | 182,600 | 811.00    | 148,088,600 | 貸付有価証券<br>3,800株         |
| 熊谷組           | 20,400  | 3,140.00  | 64,056,000  |                          |
| 北野建設          | 2,700   | 2,420.00  | 6,534,000   |                          |
| 植木組           | 3,900   | 1,541.00  | 6,009,900   | 貸付有価証券<br>400株           |
| 矢作建設工業        | 19,400  | 802.00    | 15,558,800  |                          |
| ピーエス三菱        | 14,500  | 661.00    | 9,584,500   |                          |
| 日本ハウスホールディングス | 30,000  | 333.00    | 9,990,000   |                          |
| 大東建託          | 48,000  | 11,630.00 | 558,240,000 |                          |
| 新日本建設         | 18,700  | 866.00    | 16,194,200  |                          |
| N I P P O     | 36,400  | 2,914.00  | 106,069,600 |                          |
| 東亜道路工業        | 2,700   | 4,495.00  | 12,136,500  |                          |
| 前田道路          | 27,200  | 2,193.00  | 59,649,600  | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| 日本道路          | 4,200   | 8,030.00  | 33,726,000  |                          |
| 東亜建設工業        | 11,700  | 2,487.00  | 29,097,900  | 貸付有価証券<br>5,900株（5,300株） |
| 日本国土開発        | 42,800  | 608.00    | 26,022,400  |                          |
| 若築建設          | 7,900   | 1,304.00  | 10,301,600  |                          |
| 東洋建設          | 49,300  | 593.00    | 29,234,900  |                          |
| 五洋建設          | 186,700 | 883.00    | 164,856,100 |                          |
| 世紀東急工業        | 21,100  | 889.00    | 18,757,900  |                          |

|            |         |          |               |                  |
|------------|---------|----------|---------------|------------------|
| 福田組        | 5,100   | 4,985.00 | 25,423,500    |                  |
| 住友林業       | 103,400 | 2,450.00 | 253,330,000   | 貸付有価証券<br>5,300株 |
| 日本基礎技術     | 13,400  | 519.00   | 6,954,600     |                  |
| 巴コーポレーション  | 19,500  | 390.00   | 7,605,000     |                  |
| 大和ハウス工業    | 406,000 | 3,421.00 | 1,388,926,000 |                  |
| ライト工業      | 25,200  | 1,798.00 | 45,309,600    |                  |
| 積水ハウス      | 476,800 | 2,318.00 | 1,105,222,400 | 貸付有価証券<br>500株   |
| 日特建設       | 11,500  | 801.00   | 9,211,500     |                  |
| 北陸電気工事     | 7,600   | 1,140.00 | 8,664,000     |                  |
| ユアテック      | 25,100  | 793.00   | 19,904,300    |                  |
| 日本リーテック    | 9,200   | 1,806.00 | 16,615,200    |                  |
| 四電工        | 2,400   | 3,295.00 | 7,908,000     |                  |
| 中電工        | 20,200  | 2,369.00 | 47,853,800    |                  |
| 関電工        | 71,500  | 955.00   | 68,282,500    |                  |
| きんでん       | 89,300  | 1,854.00 | 165,562,200   |                  |
| 東京エネシス     | 14,600  | 970.00   | 14,162,000    |                  |
| トーエネック     | 4,400   | 3,845.00 | 16,918,000    |                  |
| 住友電設       | 12,400  | 2,339.00 | 29,003,600    |                  |
| 日本電設工業     | 24,100  | 1,801.00 | 43,404,100    |                  |
| 協和エクシオ     | 66,700  | 2,995.00 | 199,766,500   |                  |
| 新日本空調      | 11,600  | 2,253.00 | 26,134,800    |                  |
| 九電工        | 30,800  | 3,810.00 | 117,348,000   |                  |
| 三機工業       | 31,200  | 1,413.00 | 44,085,600    |                  |
| 日揮ホールディングス | 146,700 | 1,297.00 | 190,269,900   | 貸付有価証券<br>200株   |
| 中外炉工業      | 4,800   | 2,167.00 | 10,401,600    |                  |
| ヤマト        | 14,100  | 698.00   | 9,841,800     |                  |
| 太平電業       | 9,700   | 2,704.00 | 26,228,800    |                  |
| 高砂熱学工業     | 39,700  | 1,695.00 | 67,291,500    |                  |
| 三晃金属工業     | 1,700   | 2,684.00 | 4,562,800     |                  |
| 朝日工業社      | 3,300   | 2,915.00 | 9,619,500     |                  |
| 明星工業       | 28,400  | 793.00   | 22,521,200    |                  |
| 大気社        | 21,400  | 3,015.00 | 64,521,000    |                  |
| ダイダン       | 9,800   | 2,793.00 | 27,371,400    |                  |
| 日比谷総合設備    | 14,100  | 1,925.00 | 27,142,500    |                  |

|                    |         |          |             |                  |
|--------------------|---------|----------|-------------|------------------|
| フィル・カンパニー          | 2,500   | 3,035.00 | 7,587,500   |                  |
| テスホールディングス         | 9,100   | 1,881.00 | 17,117,100  |                  |
| レイズネクスト            | 23,600  | 1,202.00 | 28,367,200  |                  |
| ニッポン               | 41,200  | 1,610.00 | 66,332,000  |                  |
| 日清製粉グループ本社         | 159,000 | 1,844.00 | 293,196,000 | 貸付有価証券<br>300株   |
| 日東富士製粉             | 1,000   | 7,180.00 | 7,180,000   |                  |
| 昭和産業               | 11,800  | 3,025.00 | 35,695,000  |                  |
| 鳥越製粉               | 12,500  | 818.00   | 10,225,000  |                  |
| 中部飼料               | 17,200  | 1,410.00 | 24,252,000  |                  |
| フィード・ワン            | 18,900  | 885.00   | 16,726,500  |                  |
| 東洋精糖               | 2,400   | 1,211.00 | 2,906,400   |                  |
| 日本甜菜製糖             | 7,300   | 1,634.00 | 11,928,200  |                  |
| DM三井製糖ホールディ<br>ングス | 11,100  | 1,859.00 | 20,634,900  |                  |
| 塩水港精糖              | 16,800  | 237.00   | 3,981,600   |                  |
| 日新製糖               | 6,700   | 1,795.00 | 12,026,500  |                  |
| 森永製菓               | 33,000  | 3,750.00 | 123,750,000 |                  |
| 中村屋                | 3,400   | 3,850.00 | 13,090,000  |                  |
| 江崎グリコ              | 38,700  | 4,245.00 | 164,281,500 | 貸付有価証券<br>300株   |
| 名糖産業               | 6,200   | 1,529.00 | 9,479,800   |                  |
| 井村屋グループ            | 8,000   | 2,501.00 | 20,008,000  |                  |
| 不二家                | 9,000   | 2,180.00 | 19,620,000  |                  |
| 山崎製パン              | 105,500 | 1,755.00 | 185,152,500 | 貸付有価証券<br>6,000株 |
| 第一屋製パン             | 2,700   | 959.00   | 2,589,300   |                  |
| モロゾフ               | 2,200   | 5,350.00 | 11,770,000  |                  |
| 亀田製菓               | 8,000   | 4,680.00 | 37,440,000  |                  |
| 寿スピリッツ             | 13,500  | 6,490.00 | 87,615,000  | 貸付有価証券<br>100株   |
| カルビー               | 64,100  | 2,676.00 | 171,531,600 |                  |
| 森永乳業               | 26,000  | 6,280.00 | 163,280,000 | 貸付有価証券<br>200株   |
| 六甲バター              | 9,300   | 1,631.00 | 15,168,300  |                  |
| ヤクルト本社             | 96,800  | 5,550.00 | 537,240,000 | 貸付有価証券<br>1,100株 |
| 明治ホールディングス         | 93,000  | 6,930.00 | 644,490,000 | 貸付有価証券           |



|                          |         |          |               |                          |
|--------------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
|                          |         |          |               | 1,200株                   |
| 雪印メグミルク                  | 33,900  | 2,281.00 | 77,325,900    |                          |
| プリマハム                    | 19,800  | 3,345.00 | 66,231,000    |                          |
| 日本ハム                     | 53,800  | 4,830.00 | 259,854,000   |                          |
| 林兼産業                     | 4,700   | 634.00   | 2,979,800     |                          |
| 丸大食品                     | 13,800  | 1,721.00 | 23,749,800    | 貸付有価証券<br>400株           |
| S Foods                  | 12,600  | 3,315.00 | 41,769,000    |                          |
| 柿安本店                     | 4,900   | 2,563.00 | 12,558,700    |                          |
| 伊藤ハム米久ホールディングス           | 90,600  | 733.00   | 66,409,800    | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| サッポロホールディングス             | 48,000  | 2,240.00 | 107,520,000   | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| アサヒグループホールディングス          | 307,400 | 4,741.00 | 1,457,383,400 | 貸付有価証券<br>100株           |
| キリンホールディングス              | 596,700 | 2,082.00 | 1,242,329,400 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 宝ホールディングス                | 104,300 | 1,472.00 | 153,529,600   |                          |
| オエノンホールディングス             | 40,000  | 393.00   | 15,720,000    |                          |
| 養命酒製造                    | 4,300   | 1,859.00 | 7,993,700     |                          |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 107,700 | 1,831.00 | 197,198,700   | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| サントリー食品インターナショナル         | 94,100  | 3,775.00 | 355,227,500   |                          |
| ダイドーグループホールディングス         | 7,900   | 5,250.00 | 41,475,000    | 貸付有価証券<br>600株           |
| 伊藤園                      | 42,700  | 6,240.00 | 266,448,000   | 貸付有価証券<br>4,900株（4,900株） |
| キーコーヒー                   | 13,800  | 2,089.00 | 28,828,200    |                          |
| ユニカフェ                    | 4,200   | 1,005.00 | 4,221,000     |                          |
| ジャパンフーズ                  | 2,000   | 1,209.00 | 2,418,000     |                          |
| 日清オイリオグループ               | 18,100  | 3,135.00 | 56,743,500    |                          |
| 不二製油グループ本社               | 34,300  | 2,842.00 | 97,480,600    | 貸付有価証券<br>600株           |
| かどや製油                    | 1,500   | 4,160.00 | 6,240,000     |                          |
| J-オイルミルズ                 | 13,100  | 1,891.00 | 24,772,100    |                          |
| キッコーマン                   | 101,300 | 6,920.00 | 700,996,000   | 貸付有価証券<br>200株           |
| 味の素                      | 334,600 | 2,322.50 | 777,108,500   | 貸付有価証券                   |

|                   |         |          |               |                           |
|-------------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
|                   |         |          |               | 3,900株                    |
| ブルドックソース          | 6,400   | 2,326.00 | 14,886,400    | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| キューピー             | 78,300  | 2,604.00 | 203,893,200   |                           |
| ハウス食品グループ本社       | 52,600  | 3,495.00 | 183,837,000   |                           |
| カゴメ               | 57,500  | 3,215.00 | 184,862,500   | 貸付有価証券<br>100株            |
| 焼津水産化学工業          | 6,800   | 986.00   | 6,704,800     |                           |
| アリアケジャパン          | 12,900  | 6,680.00 | 86,172,000    |                           |
| ピエトロ              | 1,800   | 1,780.00 | 3,204,000     |                           |
| エバラ食品工業           | 3,100   | 2,677.00 | 8,298,700     |                           |
| やまみ               | 1,500   | 2,143.00 | 3,214,500     |                           |
| ニチレイ              | 67,000  | 2,824.00 | 189,208,000   |                           |
| 東洋水産              | 72,400  | 4,555.00 | 329,782,000   |                           |
| イートアンドホールディングス    | 4,900   | 1,852.00 | 9,074,800     |                           |
| 大冷                | 1,600   | 1,949.00 | 3,118,400     |                           |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 7,900   | 826.00   | 6,525,400     | 貸付有価証券<br>300株            |
| 日清食品ホールディングス      | 55,200  | 7,900.00 | 436,080,000   | 貸付有価証券<br>800株            |
| 永谷園ホールディングス       | 6,900   | 2,283.00 | 15,752,700    |                           |
| 一正蒲鉾              | 5,500   | 1,267.00 | 6,968,500     | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| フジッコ              | 15,200  | 1,942.00 | 29,518,400    |                           |
| ロック・フィールド         | 15,200  | 1,579.00 | 24,000,800    | 貸付有価証券<br>100株            |
| 日本たばこ産業           | 754,400 | 2,147.50 | 1,620,074,000 | 貸付有価証券<br>5,800株          |
| ケンコーマヨネーズ         | 8,600   | 1,784.00 | 15,342,400    |                           |
| わらべや日洋ホールディングス    | 9,200   | 2,034.00 | 18,712,800    |                           |
| なとり               | 7,900   | 1,931.00 | 15,254,900    |                           |
| イフジ産業             | 2,200   | 946.00   | 2,081,200     |                           |
| ピククルスコーポレーション     | 3,400   | 3,375.00 | 11,475,000    |                           |
| ファーマフーズ           | 13,300  | 3,335.00 | 44,355,500    | 貸付有価証券<br>3,500株          |
| 北の達人コーポレーション      | 49,100  | 492.00   | 24,157,200    | 貸付有価証券<br>11,700株（6,500株） |

|              |         |          |             |                            |
|--------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| ユーグレナ        | 71,700  | 919.00   | 65,892,300  | 貸付有価証券<br>31,100株（17,100株） |
| 紀文食品         | 6,900   | 1,631.00 | 11,253,900  |                            |
| ミヨシ油脂        | 4,900   | 1,230.00 | 6,027,000   |                            |
| 理研ビタミン       | 13,300  | 1,410.00 | 18,753,000  |                            |
| 片倉工業         | 18,400  | 1,462.00 | 26,900,800  | 貸付有価証券<br>9,300株（7,400株）   |
| グンゼ          | 10,100  | 4,055.00 | 40,955,500  |                            |
| 東洋紡          | 54,300  | 1,453.00 | 78,897,900  |                            |
| ユニチカ         | 40,200  | 400.00   | 16,080,000  | 貸付有価証券<br>300株             |
| 富士紡ホールディングス  | 6,600   | 4,540.00 | 29,964,000  |                            |
| 倉敷紡績         | 12,600  | 1,890.00 | 23,814,000  |                            |
| シキボウ         | 7,700   | 959.00   | 7,384,300   |                            |
| 日本毛織         | 45,200  | 1,012.00 | 45,742,400  | 貸付有価証券<br>3,700株           |
| ダイトウボウ       | 22,200  | 109.00   | 2,419,800   | 貸付有価証券<br>12,400株（7,200株）  |
| トーア紡コーポレーション | 5,400   | 460.00   | 2,484,000   |                            |
| ダイドーリミテッド    | 18,000  | 180.00   | 3,240,000   | 貸付有価証券<br>9,200株           |
| 帝国繊維         | 15,500  | 2,104.00 | 32,612,000  |                            |
| 帝人           | 129,200 | 1,876.00 | 242,379,200 | 貸付有価証券<br>2,300株           |
| 東レ           | 994,100 | 708.10   | 703,922,210 | 貸付有価証券<br>300株             |
| サカイオーボックス    | 3,600   | 3,080.00 | 11,088,000  |                            |
| 住江織物         | 3,000   | 1,996.00 | 5,988,000   |                            |
| 日本フェルト       | 7,800   | 439.00   | 3,424,200   |                            |
| イチカワ         | 1,800   | 1,334.00 | 2,401,200   |                            |
| 日東製網         | 1,500   | 1,548.00 | 2,322,000   |                            |
| アツギ          | 10,600  | 642.00   | 6,805,200   |                            |
| ダイニック        | 5,200   | 814.00   | 4,232,800   |                            |
| セーレン         | 33,800  | 1,966.00 | 66,450,800  |                            |
| ソトー          | 5,500   | 800.00   | 4,400,000   |                            |
| 東海染工         | 1,700   | 1,125.00 | 1,912,500   |                            |
| 小松マテーレ       | 22,500  | 927.00   | 20,857,500  |                            |
| ワコールホールディング  | 34,300  | 2,602.00 | 89,248,600  |                            |

| ス              |         |          |               |                         |
|----------------|---------|----------|---------------|-------------------------|
| ホギメディカル        | 18,500  | 3,350.00 | 61,975,000    |                         |
| クラウディアホールディングス | 3,400   | 286.00   | 972,400       |                         |
| T S I ホールディングス | 41,700  | 337.00   | 14,052,900    |                         |
| マツオカコーポレーション   | 4,400   | 1,876.00 | 8,254,400     |                         |
| ワールド           | 18,000  | 1,459.00 | 26,262,000    | 貸付有価証券<br>100株          |
| 三陽商会           | 7,100   | 837.00   | 5,942,700     | 貸付有価証券<br>500株          |
| ナイガイ           | 5,000   | 340.00   | 1,700,000     |                         |
| オンワードホールディングス  | 82,500  | 306.00   | 25,245,000    | 貸付有価証券<br>7,400株        |
| ルックホールディングス    | 4,700   | 1,276.00 | 5,997,200     |                         |
| ゴールドウイン        | 22,700  | 6,750.00 | 153,225,000   | 貸付有価証券<br>200株          |
| デサント           | 23,400  | 1,942.00 | 45,442,800    |                         |
| キング            | 7,300   | 532.00   | 3,883,600     |                         |
| ヤマトインターナショナル   | 12,100  | 333.00   | 4,029,300     |                         |
| 特種東海製紙         | 8,400   | 4,715.00 | 39,606,000    |                         |
| 王子ホールディングス     | 618,100 | 762.00   | 470,992,200   |                         |
| 日本製紙           | 60,700  | 1,446.00 | 87,772,200    | 貸付有価証券<br>1,100株        |
| 三菱製紙           | 19,500  | 363.00   | 7,078,500     |                         |
| 北越コーポレーション     | 98,200  | 588.00   | 57,741,600    | 貸付有価証券<br>24,700株（400株） |
| 中越パルプ工業        | 5,200   | 1,263.00 | 6,567,600     |                         |
| 巴川製紙所          | 4,500   | 812.00   | 3,654,000     |                         |
| 大王製紙           | 66,200  | 1,926.00 | 127,501,200   |                         |
| 阿波製紙           | 3,500   | 433.00   | 1,515,500     |                         |
| レンゴー           | 141,600 | 965.00   | 136,644,000   | 貸付有価証券<br>200株          |
| トーモク           | 8,400   | 2,047.00 | 17,194,800    |                         |
| ザ・パックス         | 10,400  | 2,832.00 | 29,452,800    |                         |
| クラレ            | 216,200 | 1,252.00 | 270,682,400   |                         |
| 旭化成            | 910,100 | 1,207.50 | 1,098,945,750 |                         |
| 共和レザー          | 7,500   | 770.00   | 5,775,000     |                         |

|              |           |           |               |                        |
|--------------|-----------|-----------|---------------|------------------------|
| 昭和電工         | 104,300   | 3,670.00  | 382,781,000   | 貸付有価証券<br>1,900株       |
| 住友化学         | 1,080,800 | 603.00    | 651,722,400   | 貸付有価証券<br>7,200株       |
| 住友精化         | 6,700     | 3,890.00  | 26,063,000    |                        |
| 日産化学         | 75,700    | 5,980.00  | 452,686,000   |                        |
| ラサ工業         | 4,500     | 2,228.00  | 10,026,000    |                        |
| クレハ          | 11,800    | 7,900.00  | 93,220,000    |                        |
| 多木化学         | 5,400     | 5,890.00  | 31,806,000    | 貸付有価証券<br>1,300株（900株） |
| テイカ          | 10,100    | 1,427.00  | 14,412,700    |                        |
| 石原産業         | 24,600    | 938.00    | 23,074,800    |                        |
| 片倉コープアグリ     | 3,500     | 1,212.00  | 4,242,000     |                        |
| 日本曹達         | 19,200    | 3,365.00  | 64,608,000    |                        |
| 東ソー          | 212,200   | 2,038.00  | 432,463,600   |                        |
| トクヤマ         | 40,800    | 2,529.00  | 103,183,200   | 貸付有価証券<br>200株         |
| セントラル硝子      | 26,200    | 2,374.00  | 62,198,800    |                        |
| 東亜合成         | 83,800    | 1,249.00  | 104,666,200   |                        |
| 大阪ソーダ        | 14,000    | 2,588.00  | 36,232,000    |                        |
| 関東電化工業       | 32,600    | 899.00    | 29,307,400    | 貸付有価証券<br>100株         |
| デンカ          | 50,100    | 4,520.00  | 226,452,000   |                        |
| 信越化学工業       | 253,900   | 18,575.00 | 4,716,192,500 |                        |
| 日本カーバイド工業    | 5,000     | 1,351.00  | 6,755,000     |                        |
| 堺化学工業        | 9,600     | 1,955.00  | 18,768,000    |                        |
| 第一稀元素化学工業    | 13,800    | 1,400.00  | 19,320,000    |                        |
| エア・ウォーター     | 140,000   | 1,930.00  | 270,200,000   | 貸付有価証券<br>1,400株       |
| 日本酸素ホールディングス | 113,100   | 2,134.00  | 241,355,400   |                        |
| 日本化学工業       | 3,900     | 2,999.00  | 11,696,100    |                        |
| 東邦アセチレン      | 2,100     | 1,282.00  | 2,692,200     |                        |
| 日本パーカライジング   | 69,300    | 1,086.00  | 75,259,800    |                        |
| 高圧ガス工業       | 21,800    | 733.00    | 15,979,400    |                        |
| チタン工業        | 1,700     | 2,079.00  | 3,534,300     |                        |
| 四国化成工業       | 18,200    | 1,250.00  | 22,750,000    |                        |
| 戸田工業         | 2,900     | 2,153.00  | 6,243,700     |                        |

|                    |         |          |             |                  |
|--------------------|---------|----------|-------------|------------------|
| ステラ ケミファ           | 7,500   | 3,160.00 | 23,700,000  |                  |
| 保土谷化学工業            | 4,000   | 4,470.00 | 17,880,000  |                  |
| 日本触媒               | 24,900  | 5,930.00 | 147,657,000 | 貸付有価証券<br>300株   |
| 大日精化工業             | 11,300  | 2,376.00 | 26,848,800  |                  |
| カネカ                | 35,500  | 4,465.00 | 158,507,500 |                  |
| 三菱瓦斯化学             | 137,600 | 2,615.00 | 359,824,000 |                  |
| 三井化学               | 118,500 | 3,660.00 | 433,710,000 |                  |
| J S R              | 137,800 | 3,365.00 | 463,697,000 | 貸付有価証券<br>1,700株 |
| 東京応化工業             | 23,600  | 7,310.00 | 172,516,000 | 貸付有価証券<br>2,700株 |
| 大阪有機化学工業           | 12,700  | 4,085.00 | 51,879,500  | 貸付有価証券<br>100株   |
| 三菱ケミカルホールディ<br>ングス | 917,800 | 869.30   | 797,843,540 | 貸付有価証券<br>1,400株 |
| KHネオケム             | 22,600  | 2,717.00 | 61,404,200  |                  |
| ダイセル               | 184,600 | 896.00   | 165,401,600 | 貸付有価証券<br>800株   |
| 住友ベークライト           | 21,600  | 4,650.00 | 100,440,000 |                  |
| 積水化学工業             | 290,400 | 2,004.00 | 581,961,600 | 貸付有価証券<br>9,100株 |
| 日本ゼオン              | 123,800 | 1,751.00 | 216,773,800 |                  |
| アイカ工業              | 38,200  | 4,225.00 | 161,395,000 |                  |
| 宇部興産               | 69,300  | 2,333.00 | 161,676,900 |                  |
| 積水樹脂               | 22,700  | 2,174.00 | 49,349,800  |                  |
| タキロンシーアイ           | 29,700  | 675.00   | 20,047,500  |                  |
| 旭有機材               | 7,800   | 1,448.00 | 11,294,400  |                  |
| ニチバン               | 7,200   | 1,869.00 | 13,456,800  |                  |
| リケンテクノス            | 33,500  | 553.00   | 18,525,500  |                  |
| 大倉工業               | 6,500   | 1,979.00 | 12,863,500  |                  |
| 積水化成成品工業           | 18,400  | 599.00   | 11,021,600  | 貸付有価証券<br>200株   |
| 群栄化学工業             | 3,100   | 2,425.00 | 7,517,500   |                  |
| タイガースポリマー          | 7,200   | 489.00   | 3,520,800   |                  |
| ミライアル              | 4,400   | 1,354.00 | 5,957,600   |                  |
| ダイキアクシス            | 5,200   | 913.00   | 4,747,600   |                  |
| ダイキョーニシカワ          | 28,900  | 794.00   | 22,946,600  |                  |

|                |         |          |               |                        |
|----------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| 竹本容器           | 4,900   | 1,003.00 | 4,914,700     |                        |
| 森六ホールディングス     | 7,400   | 2,136.00 | 15,806,400    |                        |
| 恵和             | 2,700   | 2,526.00 | 6,820,200     |                        |
| 日本化薬           | 85,000  | 1,075.00 | 91,375,000    |                        |
| カーリットホールディングス  | 13,600  | 725.00   | 9,860,000     |                        |
| 日本精化           | 9,900   | 1,446.00 | 14,315,400    |                        |
| 扶桑化学工業         | 10,800  | 4,280.00 | 46,224,000    |                        |
| トリケミカル研究所      | 12,700  | 3,655.00 | 46,418,500    | 貸付有価証券<br>200株         |
| A D E K A      | 63,200  | 2,184.00 | 138,028,800   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 日油             | 51,700  | 6,150.00 | 317,955,000   |                        |
| 新日本理化          | 22,700  | 287.00   | 6,514,900     | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| ハリマ化成グループ      | 10,200  | 939.00   | 9,577,800     |                        |
| 花王             | 335,700 | 6,981.00 | 2,343,521,700 |                        |
| 第一工業製薬         | 4,700   | 3,710.00 | 17,437,000    |                        |
| 石原ケミカル         | 3,500   | 2,128.00 | 7,448,000     |                        |
| 日華化学           | 4,600   | 1,232.00 | 5,667,200     | 貸付有価証券<br>500株（500株）   |
| ニイタカ           | 2,800   | 2,660.00 | 7,448,000     | 貸付有価証券<br>1,400株（600株） |
| 三洋化成工業         | 8,200   | 5,400.00 | 44,280,000    |                        |
| 有機合成薬品工業       | 10,500  | 292.00   | 3,066,000     | 貸付有価証券<br>800株         |
| 大日本塗料          | 15,500  | 878.00   | 13,609,000    |                        |
| 日本ペイントホールディングス | 566,400 | 1,753.00 | 992,899,200   | 貸付有価証券<br>1,600株       |
| 関西ペイント         | 154,300 | 2,814.00 | 434,200,200   | 貸付有価証券<br>300株         |
| 神東塗料           | 10,800  | 210.00   | 2,268,000     |                        |
| 中国塗料           | 33,100  | 1,004.00 | 33,232,400    |                        |
| 日本特殊塗料         | 10,300  | 1,062.00 | 10,938,600    |                        |
| 藤倉化成           | 18,500  | 551.00   | 10,193,500    |                        |
| 太陽ホールディングス     | 10,100  | 5,490.00 | 55,449,000    | 貸付有価証券<br>200株         |
| D I C          | 58,000  | 2,945.00 | 170,810,000   |                        |
| サカタインクス        | 30,000  | 1,086.00 | 32,580,000    |                        |

|                  |         |           |               |                      |
|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------|
| 東洋インキSCホールディングス  | 29,000  | 2,090.00  | 60,610,000    |                      |
| T&K TOKA         | 9,600   | 805.00    | 7,728,000     |                      |
| 富士フイルムホールディングス   | 246,400 | 7,286.00  | 1,795,270,400 |                      |
| 資生堂              | 278,600 | 7,920.00  | 2,206,512,000 |                      |
| ライオン             | 182,300 | 2,040.00  | 371,892,000   |                      |
| 高砂香料工業           | 8,800   | 2,693.00  | 23,698,400    |                      |
| マンダム             | 29,400  | 2,062.00  | 60,622,800    |                      |
| ミルボン             | 18,700  | 5,790.00  | 108,273,000   |                      |
| ファンケル            | 51,100  | 3,540.00  | 180,894,000   | 貸付有価証券<br>1,000株     |
| コーセー             | 26,400  | 16,120.00 | 425,568,000   |                      |
| コタ               | 8,900   | 1,541.00  | 13,714,900    |                      |
| シーボン             | 1,800   | 1,975.00  | 3,555,000     |                      |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 59,800  | 2,871.00  | 171,685,800   |                      |
| ノエビアホールディングス     | 11,900  | 4,870.00  | 57,953,000    |                      |
| アジュバンコスメジャパン     | 3,100   | 1,039.00  | 3,220,900     |                      |
| 新日本製薬            | 3,800   | 2,094.00  | 7,957,200     | 貸付有価証券<br>500株（200株） |
| エスター             | 9,000   | 1,843.00  | 16,587,000    |                      |
| アグロ カネショウ        | 5,300   | 1,485.00  | 7,870,500     |                      |
| コニシ              | 23,000  | 1,614.00  | 37,122,000    |                      |
| 長谷川香料            | 24,200  | 2,183.00  | 52,828,600    |                      |
| 星光PMC            | 8,000   | 801.00    | 6,408,000     |                      |
| 小林製薬             | 39,300  | 9,830.00  | 386,319,000   | 貸付有価証券<br>200株       |
| 荒川化学工業           | 11,700  | 1,273.00  | 14,894,100    |                      |
| メック              | 9,600   | 2,537.00  | 24,355,200    | 貸付有価証券<br>600株（300株） |
| 日本高純度化学          | 3,800   | 2,674.00  | 10,161,200    |                      |
| タカラバイオ           | 36,700  | 2,836.00  | 104,081,200   |                      |
| JCU              | 15,800  | 4,090.00  | 64,622,000    |                      |
| 新田ゼラチン           | 8,800   | 647.00    | 5,693,600     |                      |
| OATアグリオ          | 2,700   | 1,419.00  | 3,831,300     |                      |
| デクセリアルズ          | 39,200  | 2,017.00  | 79,066,400    |                      |



|                     |           |          |               |                  |
|---------------------|-----------|----------|---------------|------------------|
| アース製薬               | 10,600    | 6,240.00 | 66,144,000    |                  |
| 北興化学工業              | 13,100    | 1,003.00 | 13,139,300    |                  |
| 大成ラミック              | 4,300     | 2,815.00 | 12,104,500    |                  |
| クミアイ化学工業            | 58,000    | 899.00   | 52,142,000    |                  |
| 日本農薬                | 25,000    | 576.00   | 14,400,000    |                  |
| アキレス                | 9,700     | 1,418.00 | 13,754,600    |                  |
| 有沢製作所               | 19,500    | 970.00   | 18,915,000    |                  |
| 日東電工                | 84,700    | 9,030.00 | 764,841,000   |                  |
| レック                 | 16,600    | 1,177.00 | 19,538,200    |                  |
| 三光合成                | 14,700    | 451.00   | 6,629,700     |                  |
| きもと                 | 21,500    | 277.00   | 5,955,500     |                  |
| 藤森工業                | 12,600    | 4,210.00 | 53,046,000    |                  |
| 前澤化成工業              | 8,900     | 1,138.00 | 10,128,200    | 貸付有価証券<br>4,500株 |
| 未来工業                | 5,000     | 1,783.00 | 8,915,000     |                  |
| ウェーブロックホール<br>ディングス | 4,800     | 736.00   | 3,532,800     |                  |
| J S P               | 8,200     | 1,741.00 | 14,276,200    | 貸付有価証券<br>5,100株 |
| エフピコ                | 25,800    | 4,430.00 | 114,294,000   |                  |
| 天馬                  | 10,500    | 2,316.00 | 24,318,000    |                  |
| 信越ポリマー              | 21,600    | 1,090.00 | 23,544,000    |                  |
| 東リ                  | 34,900    | 258.00   | 9,004,200     |                  |
| ニフコ                 | 51,500    | 3,860.00 | 198,790,000   |                  |
| バルカー                | 11,400    | 2,144.00 | 24,441,600    |                  |
| ユニ・チャーム             | 297,200   | 4,254.00 | 1,264,288,800 | 貸付有価証券<br>900株   |
| ショーエイコーポレー<br>ション   | 3,100     | 1,006.00 | 3,118,600     | 貸付有価証券<br>100株   |
| 協和キリン               | 141,000   | 3,375.00 | 475,875,000   |                  |
| 武田薬品工業              | 1,166,400 | 3,730.00 | 4,350,672,000 | 貸付有価証券<br>200株   |
| アステラス製薬             | 1,215,500 | 1,722.00 | 2,093,091,000 |                  |
| 大日本住友製薬             | 103,900   | 1,954.00 | 203,020,600   |                  |
| 塩野義製薬               | 176,300   | 5,797.00 | 1,022,011,100 | 貸付有価証券<br>100株   |
| わかもと製薬              | 16,700    | 332.00   | 5,544,400     | 貸付有価証券<br>7,800株 |

|                 |           |          |               |                  |
|-----------------|-----------|----------|---------------|------------------|
| 日本新薬            | 39,700    | 7,410.00 | 294,177,000   |                  |
| ビオフェルミン製薬       | 2,400     | 3,025.00 | 7,260,000     |                  |
| 中外製薬            | 438,500   | 4,171.00 | 1,828,983,500 | 貸付有価証券<br>600株   |
| 科研製薬            | 24,000    | 4,590.00 | 110,160,000   | 貸付有価証券<br>100株   |
| エーザイ            | 154,900   | 7,250.00 | 1,123,025,000 |                  |
| ロート製薬           | 66,800    | 2,860.00 | 191,048,000   |                  |
| 小野薬品工業          | 321,900   | 2,880.50 | 927,232,950   |                  |
| 久光製薬            | 40,800    | 6,560.00 | 267,648,000   |                  |
| 持田製薬            | 19,500    | 3,940.00 | 76,830,000    |                  |
| 参天製薬            | 244,000   | 1,430.00 | 348,920,000   | 貸付有価証券<br>1,200株 |
| 扶桑薬品工業          | 4,500     | 2,477.00 | 11,146,500    |                  |
| 日本ケミファ          | 1,700     | 2,345.00 | 3,986,500     |                  |
| ツムラ             | 46,800    | 3,730.00 | 174,564,000   | 貸付有価証券<br>1,200株 |
| 日医工             | 39,700    | 973.00   | 38,628,100    |                  |
| キッセイ薬品工業        | 24,800    | 2,298.00 | 56,990,400    |                  |
| 生化学工業           | 24,700    | 1,040.00 | 25,688,000    |                  |
| 栄研化学            | 24,600    | 2,210.00 | 54,366,000    |                  |
| 日水製薬            | 5,200     | 990.00   | 5,148,000     |                  |
| 鳥居薬品            | 8,800     | 2,576.00 | 22,668,800    |                  |
| J C Rファーマ       | 39,500    | 3,060.00 | 120,870,000   | 貸付有価証券<br>900株   |
| 東和薬品            | 20,200    | 2,322.00 | 46,904,400    |                  |
| 富士製薬工業          | 8,600     | 1,224.00 | 10,526,400    |                  |
| ゼリア新薬工業         | 25,400    | 2,011.00 | 51,079,400    | 貸付有価証券<br>900株   |
| 第一三共            | 1,203,500 | 2,922.50 | 3,517,228,750 | 貸付有価証券<br>500株   |
| キョーリン製薬ホールディングス | 30,900    | 1,908.00 | 58,957,200    | 貸付有価証券<br>100株   |
| 大幸薬品            | 17,200    | 1,039.00 | 17,870,800    | 貸付有価証券<br>9,400株 |
| ダイト             | 9,000     | 3,470.00 | 31,230,000    |                  |
| 大塚ホールディングス      | 291,400   | 4,384.00 | 1,277,497,600 | 貸付有価証券<br>100株   |
| 大正製薬ホールディング     | 33,400    | 6,770.00 | 226,118,000   | 貸付有価証券           |

|                  |           |          |               |                  |
|------------------|-----------|----------|---------------|------------------|
| ス                |           |          |               | 700株             |
| ペプチドリーム          | 72,300    | 4,870.00 | 352,101,000   | 貸付有価証券<br>300株   |
| あすか製薬ホールディングス    | 16,000    | 1,382.00 | 22,112,000    |                  |
| サワイグループホールディングス  | 30,700    | 5,330.00 | 163,631,000   |                  |
| 日本コークス工業         | 118,400   | 110.00   | 13,024,000    | 貸付有価証券<br>200株   |
| ニチレキ             | 16,500    | 1,414.00 | 23,331,000    |                  |
| ユシロ化学工業          | 7,900     | 1,150.00 | 9,085,000     | 貸付有価証券<br>100株   |
| ビーピー・カストロール      | 5,000     | 1,402.00 | 7,010,000     |                  |
| 富士石油             | 34,000    | 245.00   | 8,330,000     |                  |
| MORESCO          | 5,100     | 1,104.00 | 5,630,400     |                  |
| 出光興産             | 155,600   | 2,808.00 | 436,924,800   |                  |
| ENEOSホールディングス    | 2,108,900 | 507.50   | 1,070,266,750 | 貸付有価証券<br>1,600株 |
| コスモエネルギーホールディングス | 44,300    | 2,603.00 | 115,312,900   |                  |
| 横浜ゴム             | 81,200    | 2,133.00 | 173,199,600   |                  |
| TOYO TIRE        | 73,800    | 2,096.00 | 154,684,800   |                  |
| ブリヂストン           | 372,800   | 4,628.00 | 1,725,318,400 |                  |
| 住友ゴム工業           | 125,900   | 1,408.00 | 177,267,200   |                  |
| 藤倉コンポジット         | 12,200    | 493.00   | 6,014,600     |                  |
| オカモト             | 8,500     | 4,070.00 | 34,595,000    |                  |
| フコク              | 6,100     | 790.00   | 4,819,000     |                  |
| ニッタ              | 14,500    | 2,714.00 | 39,353,000    |                  |
| 住友理工             | 27,200    | 745.00   | 20,264,000    |                  |
| 三ツ星ベルト           | 17,000    | 1,728.00 | 29,376,000    |                  |
| バンドー化学           | 24,700    | 754.00   | 18,623,800    |                  |
| 日東紡績             | 20,900    | 4,025.00 | 84,122,500    |                  |
| AGC              | 128,700   | 5,230.00 | 673,101,000   | 貸付有価証券<br>100株   |
| 日本板硝子            | 71,100    | 771.00   | 54,818,100    |                  |
| 石塚硝子             | 2,400     | 1,948.00 | 4,675,200     |                  |
| 日本山村硝子           | 5,800     | 973.00   | 5,643,400     |                  |
| 日本電気硝子           | 52,000    | 2,794.00 | 145,288,000   |                  |
| オハラ              | 5,500     | 1,575.00 | 8,662,500     | 貸付有価証券           |

|                |         |           |               |                  |
|----------------|---------|-----------|---------------|------------------|
|                |         |           |               | 2,600株（300株）     |
| 住友大阪セメント       | 25,200  | 3,675.00  | 92,610,000    | 貸付有価証券<br>400株   |
| 太平洋セメント        | 83,000  | 2,912.00  | 241,696,000   | 貸付有価証券<br>500株   |
| 日本ヒューム         | 12,800  | 729.00    | 9,331,200     |                  |
| 日本コンクリート工業     | 30,200  | 406.00    | 12,261,200    |                  |
| 三谷セキサン         | 6,500   | 4,095.00  | 26,617,500    |                  |
| アジアパイルホールディングス | 21,600  | 523.00    | 11,296,800    |                  |
| 東海カーボン         | 137,100 | 1,916.00  | 262,683,600   |                  |
| 日本カーボン         | 7,700   | 4,995.00  | 38,461,500    |                  |
| 東洋炭素           | 8,200   | 2,274.00  | 18,646,800    |                  |
| ノリタケカンパニーリミテド  | 7,800   | 3,785.00  | 29,523,000    |                  |
| TOTO           | 100,100 | 5,830.00  | 583,583,000   | 貸付有価証券<br>100株   |
| 日本碍子           | 154,300 | 2,045.00  | 315,543,500   | 貸付有価証券<br>200株   |
| 日本特殊陶業         | 106,600 | 1,708.00  | 182,072,800   | 貸付有価証券<br>3,100株 |
| ダントーホールディングス   | 10,400  | 324.00    | 3,369,600     | 貸付有価証券<br>6,700株 |
| MARUWA         | 4,800   | 11,340.00 | 54,432,000    |                  |
| 品川リフラクトリーズ     | 3,300   | 3,290.00  | 10,857,000    |                  |
| 黒崎播磨           | 2,400   | 4,750.00  | 11,400,000    |                  |
| ヨータイ           | 10,000  | 1,106.00  | 11,060,000    |                  |
| イソライト工業        | 6,200   | 660.00    | 4,092,000     |                  |
| 東京窯業           | 17,800  | 331.00    | 5,891,800     |                  |
| ニッカトー          | 6,300   | 734.00    | 4,624,200     |                  |
| フジミインコーポレーテッド  | 11,200  | 4,655.00  | 52,136,000    |                  |
| クニミネ工業         | 4,400   | 1,214.00  | 5,341,600     |                  |
| エーアンドエーマテリアル   | 2,700   | 1,018.00  | 2,748,600     |                  |
| ニチアス           | 35,400  | 2,997.00  | 106,093,800   |                  |
| ニチハ            | 19,500  | 3,265.00  | 63,667,500    |                  |
| 日本製鉄           | 661,800 | 2,281.00  | 1,509,565,800 | 貸付有価証券<br>200株   |
| 神戸製鋼所          | 253,700 | 912.00    | 231,374,400   | 貸付有価証券           |

|                       |         |          |             |                  |
|-----------------------|---------|----------|-------------|------------------|
|                       |         |          |             | 1,600株           |
| 中山製鋼所                 | 19,200  | 489.00   | 9,388,800   |                  |
| 合同製鐵                  | 7,500   | 1,902.00 | 14,265,000  |                  |
| ジェイ エフ イー<br>ホールディングス | 401,100 | 1,725.00 | 691,897,500 | 貸付有価証券<br>3,400株 |
| 東京製鐵                  | 54,000  | 1,189.00 | 64,206,000  | 貸付有価証券<br>800株   |
| 共英製鋼                  | 15,600  | 1,526.00 | 23,805,600  | 貸付有価証券<br>100株   |
| 大和工業                  | 29,500  | 3,720.00 | 109,740,000 |                  |
| 東京鐵鋼                  | 5,300   | 1,733.00 | 9,184,900   | 貸付有価証券<br>200株   |
| 大阪製鐵                  | 7,400   | 1,407.00 | 10,411,800  |                  |
| 淀川製鋼所                 | 18,200  | 2,591.00 | 47,156,200  |                  |
| 丸一鋼管                  | 45,000  | 2,899.00 | 130,455,000 |                  |
| モリ工業                  | 4,100   | 2,727.00 | 11,180,700  |                  |
| 大同特殊鋼                 | 22,700  | 6,110.00 | 138,697,000 |                  |
| 日本高周波鋼業               | 5,100   | 456.00   | 2,325,600   |                  |
| 日本冶金工業                | 10,800  | 2,494.00 | 26,935,200  |                  |
| 山陽特殊製鋼                | 16,600  | 1,842.00 | 30,577,200  |                  |
| 愛知製鋼                  | 7,800   | 3,510.00 | 27,378,000  |                  |
| 日立金属                  | 130,700 | 2,130.00 | 278,391,000 | 貸付有価証券<br>1,100株 |
| 日本金属                  | 3,500   | 1,208.00 | 4,228,000   | 貸付有価証券<br>1,000株 |
| 大平洋金属                 | 9,400   | 2,565.00 | 24,111,000  |                  |
| 新日本電工                 | 89,400  | 407.00   | 36,385,800  |                  |
| 栗本鐵工所                 | 6,300   | 1,750.00 | 11,025,000  |                  |
| 虹技                    | 1,900   | 1,218.00 | 2,314,200   |                  |
| 日本鑄鉄管                 | 1,600   | 1,370.00 | 2,192,000   |                  |
| 三菱製鋼                  | 10,300  | 915.00   | 9,424,500   |                  |
| 日垂鋼業                  | 20,300  | 320.00   | 6,496,000   |                  |
| 日本精線                  | 2,000   | 4,350.00 | 8,700,000   |                  |
| エンビプロ・ホールディ<br>ングス    | 5,900   | 1,134.00 | 6,690,600   |                  |
| シンニッタン                | 16,800  | 271.00   | 4,552,800   |                  |
| 新家工業                  | 3,400   | 1,709.00 | 5,810,600   |                  |
| 大紀アルミニウム工業所           | 20,900  | 1,067.00 | 22,300,300  |                  |

|                       |         |          |             |                          |
|-----------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 日本軽金属ホールディングス         | 37,800  | 2,318.00 | 87,620,400  |                          |
| 三井金属鉱業                | 37,400  | 4,080.00 | 152,592,000 |                          |
| 東邦亜鉛                  | 7,700   | 2,592.00 | 19,958,400  |                          |
| 三菱マテリアル               | 91,600  | 2,734.00 | 250,434,400 |                          |
| 住友金属鉱山                | 177,200 | 5,283.00 | 936,147,600 |                          |
| DOWAホールディングス          | 35,100  | 5,060.00 | 177,606,000 |                          |
| 古河機械金属                | 22,900  | 1,339.00 | 30,663,100  |                          |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ        | 14,400  | 1,071.00 | 15,422,400  | 貸付有価証券<br>1,700株（300株）   |
| 東邦チタニウム               | 24,800  | 1,044.00 | 25,891,200  | 貸付有価証券<br>700株           |
| U A C J               | 21,000  | 2,884.00 | 60,564,000  |                          |
| C K サンエツ              | 2,900   | 3,605.00 | 10,454,500  | 貸付有価証券<br>100株           |
| 古河電気工業                | 43,100  | 3,000.00 | 129,300,000 |                          |
| 住友電気工業                | 483,800 | 1,677.50 | 811,574,500 | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| フジクラ                  | 167,400 | 590.00   | 98,766,000  |                          |
| 昭和電線ホールディングス          | 13,400  | 1,624.00 | 21,761,600  |                          |
| 東京特殊電線                | 1,800   | 2,614.00 | 4,705,200   |                          |
| タツタ電線                 | 24,400  | 613.00   | 14,957,200  |                          |
| カナレ電気                 | 2,300   | 1,788.00 | 4,112,400   | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| 平河ヒューテック              | 7,700   | 1,341.00 | 10,325,700  |                          |
| リョービ                  | 17,100  | 1,687.00 | 28,847,700  |                          |
| アーレスティ                | 17,000  | 502.00   | 8,534,000   |                          |
| アサヒホールディングス           | 52,000  | 2,359.00 | 122,668,000 | 貸付有価証券<br>2,900株（2,600株） |
| 稲葉製作所                 | 7,800   | 1,495.00 | 11,661,000  |                          |
| 宮地エンジニアリンググループ        | 4,500   | 2,348.00 | 10,566,000  |                          |
| トーカロ                  | 35,800  | 1,552.00 | 55,561,600  |                          |
| アルファ C o              | 4,900   | 1,259.00 | 6,169,100   |                          |
| SUMCO                 | 177,400 | 2,649.00 | 469,932,600 |                          |
| 川田テクノロジーズ             | 2,800   | 4,375.00 | 12,250,000  |                          |
| R S   T e c h n o l o | 4,500   | 6,280.00 | 28,260,000  |                          |

| g i e s          |         |           |             |                      |
|------------------|---------|-----------|-------------|----------------------|
| ジェイテックコーポレーション   | 1,500   | 2,830.00  | 4,245,000   | 貸付有価証券<br>200株（200株） |
| 信和               | 7,400   | 806.00    | 5,964,400   |                      |
| 東洋製罐グループホールディングス | 88,300  | 1,391.00  | 122,825,300 |                      |
| ホッカンホールディングス     | 7,000   | 1,442.00  | 10,094,000  |                      |
| コロナ              | 7,700   | 964.00    | 7,422,800   |                      |
| 横河ブリッジホールディングス   | 23,800  | 2,141.00  | 50,955,800  |                      |
| 駒井ハルテック          | 2,800   | 1,987.00  | 5,563,600   |                      |
| 高田機工             | 1,300   | 2,686.00  | 3,491,800   | 貸付有価証券<br>600株       |
| 三和ホールディングス       | 130,700 | 1,426.00  | 186,378,200 |                      |
| 文化シャッター          | 40,800  | 968.00    | 39,494,400  |                      |
| 三協立山             | 17,900  | 859.00    | 15,376,100  |                      |
| アルインコ            | 9,200   | 1,038.00  | 9,549,600   |                      |
| 東洋シャッター          | 3,100   | 653.00    | 2,024,300   |                      |
| L I X I L        | 190,900 | 2,935.00  | 560,291,500 | 貸付有価証券<br>800株       |
| 日本ファイルコン         | 9,600   | 498.00    | 4,780,800   |                      |
| ノーリツ             | 28,700  | 1,721.00  | 49,392,700  |                      |
| 長府製作所            | 14,100  | 2,041.00  | 28,778,100  |                      |
| リンナイ             | 27,000  | 11,250.00 | 303,750,000 |                      |
| ダイニチ工業           | 6,600   | 835.00    | 5,511,000   |                      |
| 日東精工             | 17,400  | 564.00    | 9,813,600   |                      |
| 三洋工業             | 1,700   | 1,847.00  | 3,139,900   |                      |
| 岡部               | 28,100  | 754.00    | 21,187,400  |                      |
| ジーテクト            | 17,200  | 1,470.00  | 25,284,000  | 貸付有価証券<br>100株       |
| 東プレ              | 25,900  | 1,505.00  | 38,979,500  | 貸付有価証券<br>400株       |
| 高周波熱錬            | 26,700  | 581.00    | 15,512,700  |                      |
| 東京製綱             | 9,900   | 1,100.00  | 10,890,000  | 貸付有価証券<br>3,600株     |
| サンコール            | 11,900  | 470.00    | 5,593,000   |                      |
| モリテック スチール       | 10,800  | 451.00    | 4,870,800   | 貸付有価証券<br>200株       |

|             |         |           |             |                      |
|-------------|---------|-----------|-------------|----------------------|
| パイオラックス     | 20,500  | 1,517.00  | 31,098,500  |                      |
| エイチワン       | 13,600  | 836.00    | 11,369,600  |                      |
| 日本発條        | 138,100 | 817.00    | 112,827,700 |                      |
| 中央発條        | 6,700   | 1,111.00  | 7,443,700   |                      |
| アドバネクス      | 2,000   | 1,484.00  | 2,968,000   |                      |
| 立川ブラインド工業   | 6,100   | 1,375.00  | 8,387,500   |                      |
| 三益半導体工業     | 10,800  | 2,729.00  | 29,473,200  |                      |
| 日本ドライケミカル   | 3,400   | 1,735.00  | 5,899,000   |                      |
| 日本製鋼所       | 42,100  | 2,787.00  | 117,332,700 |                      |
| 三浦工業        | 60,000  | 5,910.00  | 354,600,000 |                      |
| タクマ         | 47,000  | 2,280.00  | 107,160,000 |                      |
| ツガミ         | 28,700  | 1,761.00  | 50,540,700  |                      |
| オークマ        | 16,200  | 6,230.00  | 100,926,000 |                      |
| 芝浦機械        | 14,400  | 2,718.00  | 39,139,200  |                      |
| アマダ         | 203,200 | 1,235.00  | 250,952,000 | 貸付有価証券<br>100株       |
| アイダエンジニアリング | 36,300  | 967.00    | 35,102,100  |                      |
| 滝澤鉄工所       | 4,000   | 1,169.00  | 4,676,000   |                      |
| F U J I     | 55,400  | 2,966.00  | 164,316,400 |                      |
| 牧野フライス製作所   | 16,300  | 4,440.00  | 72,372,000  |                      |
| オーエスジー      | 68,400  | 1,862.00  | 127,360,800 |                      |
| ダイジェット工業    | 1,600   | 1,322.00  | 2,115,200   |                      |
| 旭ダイヤモンド工業   | 36,400  | 540.00    | 19,656,000  |                      |
| DMG森精機      | 87,700  | 1,813.00  | 159,000,100 | 貸付有価証券<br>800株       |
| ソディック       | 29,200  | 1,078.00  | 31,477,600  |                      |
| ディスコ        | 18,800  | 35,100.00 | 659,880,000 | 貸付有価証券<br>300株       |
| 日東工器        | 6,600   | 1,962.00  | 12,949,200  |                      |
| 日進工具        | 10,900  | 1,551.00  | 16,905,900  | 貸付有価証券<br>200株（200株） |
| パンチ工業       | 11,600  | 590.00    | 6,844,000   |                      |
| 富士ダイス       | 7,000   | 666.00    | 4,662,000   |                      |
| 豊和工業        | 7,600   | 918.00    | 6,976,800   |                      |
| OKK         | 5,300   | 444.00    | 2,353,200   |                      |
| 東洋機械金属      | 9,900   | 531.00    | 5,256,900   |                      |
| 津田駒工業       | 2,700   | 930.00    | 2,511,000   |                      |



|                    |         |           |               |                         |
|--------------------|---------|-----------|---------------|-------------------------|
| エンシュウ              | 3,300   | 980.00    | 3,234,000     |                         |
| 島精機製作所             | 20,300  | 2,225.00  | 45,167,500    |                         |
| オプトラン              | 17,400  | 2,820.00  | 49,068,000    |                         |
| NCホールディングス         | 4,200   | 699.00    | 2,935,800     |                         |
| イワキポンプ             | 8,800   | 1,000.00  | 8,800,000     |                         |
| フリーー               | 13,500  | 997.00    | 13,459,500    |                         |
| ヤマシンフィルタ           | 27,900  | 831.00    | 23,184,900    | 貸付有価証券<br>12,400株（100株） |
| 日阪製作所              | 17,100  | 865.00    | 14,791,500    |                         |
| やまびこ               | 26,900  | 1,209.00  | 32,522,100    |                         |
| 平田機工               | 6,600   | 7,270.00  | 47,982,000    |                         |
| ペガサスミシン製造          | 14,000  | 508.00    | 7,112,000     |                         |
| マルマエ               | 5,700   | 1,754.00  | 9,997,800     |                         |
| タツモ                | 5,900   | 1,774.00  | 10,466,600    | 貸付有価証券<br>500株          |
| ナブテスコ              | 81,700  | 5,040.00  | 411,768,000   |                         |
| 三井海洋開発             | 14,700  | 2,284.00  | 33,574,800    |                         |
| レオン自動機             | 13,600  | 1,232.00  | 16,755,200    |                         |
| SMC                | 41,100  | 65,230.00 | 2,680,953,000 |                         |
| ホソカワミクロン           | 4,900   | 6,380.00  | 31,262,000    |                         |
| ユニオンツール            | 5,200   | 3,545.00  | 18,434,000    |                         |
| オイレス工業             | 19,400  | 1,626.00  | 31,544,400    | 貸付有価証券<br>1,800株        |
| 日精エー・エス・ビー機<br>械   | 4,700   | 5,230.00  | 24,581,000    |                         |
| サトーホールディングス        | 18,200  | 2,775.00  | 50,505,000    |                         |
| 技研製作所              | 12,200  | 4,555.00  | 55,571,000    |                         |
| 日本エアーテック           | 4,500   | 1,203.00  | 5,413,500     | 貸付有価証券<br>100株          |
| カワタ                | 3,800   | 935.00    | 3,553,000     | 貸付有価証券<br>300株          |
| 日精樹脂工業             | 10,700  | 1,041.00  | 11,138,700    |                         |
| オカダアイヨン            | 4,400   | 1,245.00  | 5,478,000     |                         |
| ワイエイシイホールディ<br>ングス | 5,500   | 967.00    | 5,318,500     |                         |
| 小松製作所              | 635,200 | 3,436.00  | 2,182,547,200 | 貸付有価証券<br>100株          |
| 住友重機械工業            | 80,200  | 3,250.00  | 260,650,000   | 貸付有価証券<br>100株          |

|                  |         |           |               |                  |
|------------------|---------|-----------|---------------|------------------|
| 日立建機             | 65,500  | 3,650.00  | 239,075,000   |                  |
| 日工               | 20,900  | 731.00    | 15,277,900    |                  |
| 巴工業              | 5,500   | 2,108.00  | 11,594,000    |                  |
| 井関農機             | 14,000  | 1,636.00  | 22,904,000    |                  |
| TOWA             | 13,100  | 2,193.00  | 28,728,300    |                  |
| 丸山製作所            | 2,800   | 1,849.00  | 5,177,200     |                  |
| 北川鉄工所            | 6,300   | 1,643.00  | 10,350,900    |                  |
| ローツェ             | 6,100   | 9,750.00  | 59,475,000    |                  |
| タカキタ             | 4,900   | 668.00    | 3,273,200     |                  |
| クボタ              | 736,400 | 2,718.50  | 2,001,903,400 | 貸付有価証券<br>1,800株 |
| 荏原実業             | 3,500   | 4,950.00  | 17,325,000    |                  |
| 三菱化工機            | 4,500   | 2,822.00  | 12,699,000    | 貸付有価証券<br>600株   |
| 月島機械             | 25,800  | 1,254.00  | 32,353,200    |                  |
| 帝国電機製作所          | 9,800   | 1,358.00  | 13,308,400    |                  |
| 東京機械製作所          | 5,700   | 523.00    | 2,981,100     | 貸付有価証券<br>200株   |
| 新東工業             | 33,300  | 778.00    | 25,907,400    |                  |
| 澁谷工業             | 12,300  | 3,590.00  | 44,157,000    |                  |
| アイチ コーポレーショ<br>ン | 23,800  | 907.00    | 21,586,600    |                  |
| 小森コーポレーション       | 35,500  | 773.00    | 27,441,500    |                  |
| 鶴見製作所            | 10,800  | 1,794.00  | 19,375,200    |                  |
| 住友精密工業           | 2,100   | 2,232.00  | 4,687,200     |                  |
| 日本ギア工業           | 5,600   | 327.00    | 1,831,200     |                  |
| 酒井重工業            | 2,500   | 2,110.00  | 5,275,000     |                  |
| 荏原製作所            | 58,100  | 4,890.00  | 284,109,000   |                  |
| 石井鐵工所            | 2,000   | 2,949.00  | 5,898,000     |                  |
| 西島製作所            | 14,100  | 887.00    | 12,506,700    |                  |
| 北越工業             | 14,400  | 1,109.00  | 15,969,600    |                  |
| ダイキン工業           | 178,600 | 23,115.00 | 4,128,339,000 | 貸付有価証券<br>100株   |
| オルガノ             | 4,500   | 7,370.00  | 33,165,000    |                  |
| トーヨーカネツ          | 5,300   | 2,636.00  | 13,970,800    |                  |
| 栗田工業             | 75,900  | 5,020.00  | 381,018,000   |                  |
| 椿本チエイン           | 20,000  | 3,040.00  | 60,800,000    |                  |
| 大同工業             | 6,700   | 867.00    | 5,808,900     |                  |

|                     |         |           |             |                          |
|---------------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| 木村化工機               | 11,700  | 771.00    | 9,020,700   | 貸付有価証券<br>1,700株（1,300株） |
| アネスト岩田              | 23,600  | 1,057.00  | 24,945,200  |                          |
| ダイフク                | 77,100  | 11,240.00 | 866,604,000 | 貸付有価証券<br>600株           |
| サムコ                 | 3,500   | 3,255.00  | 11,392,500  | 貸付有価証券<br>1,700株（800株）   |
| 加藤製作所               | 7,700   | 1,089.00  | 8,385,300   |                          |
| 油研工業                | 2,400   | 1,703.00  | 4,087,200   |                          |
| タダノ                 | 67,600  | 1,170.00  | 79,092,000  |                          |
| フジテック               | 48,300  | 2,592.00  | 125,193,600 | 貸付有価証券<br>500株           |
| C K D               | 32,500  | 2,463.00  | 80,047,500  | 貸付有価証券<br>200株           |
| キトー                 | 11,800  | 1,824.00  | 21,523,200  |                          |
| 平和                  | 39,100  | 1,931.00  | 75,502,100  |                          |
| 理想科学工業              | 10,300  | 1,394.00  | 14,358,200  |                          |
| SANKYO              | 33,300  | 2,936.00  | 97,768,800  |                          |
| 日本金銭機械              | 15,500  | 602.00    | 9,331,000   |                          |
| マースグループホール<br>ディングス | 8,900   | 1,618.00  | 14,400,200  |                          |
| フクシマガリレイ            | 9,600   | 4,165.00  | 39,984,000  |                          |
| オーイズミ               | 5,900   | 404.00    | 2,383,600   |                          |
| ダイコク電機              | 6,400   | 943.00    | 6,035,200   |                          |
| 竹内製作所               | 23,500  | 3,075.00  | 72,262,500  |                          |
| アマノ                 | 36,700  | 2,956.00  | 108,485,200 |                          |
| J U K I             | 19,500  | 863.00    | 16,828,500  |                          |
| 蛇の目ミシン工業            | 12,700  | 801.00    | 10,172,700  | 貸付有価証券<br>1,800株         |
| マックス                | 18,800  | 1,665.00  | 31,302,000  |                          |
| グローリー               | 36,000  | 2,391.00  | 86,076,000  |                          |
| 新晃工業                | 13,000  | 2,376.00  | 30,888,000  |                          |
| 大和冷機工業              | 22,500  | 1,120.00  | 25,200,000  |                          |
| セガサミーホールディン<br>グス   | 127,500 | 1,604.00  | 204,510,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日本ピストンリング           | 5,100   | 1,130.00  | 5,763,000   |                          |
| リケン                 | 6,500   | 2,395.00  | 15,567,500  |                          |
| T P R               | 18,900  | 1,675.00  | 31,657,500  |                          |

|             |         |           |               |                  |
|-------------|---------|-----------|---------------|------------------|
| ツバキ・ナカシマ    | 26,900  | 1,710.00  | 45,999,000    | 貸付有価証券<br>400株   |
| ホシザキ        | 44,100  | 10,240.00 | 451,584,000   | 貸付有価証券<br>300株   |
| 大豊工業        | 11,400  | 1,018.00  | 11,605,200    | 貸付有価証券<br>100株   |
| 日本精工        | 287,900 | 1,071.00  | 308,340,900   | 貸付有価証券<br>200株   |
| NTN         | 324,500 | 344.00    | 111,628,000   |                  |
| ジェイテクト      | 134,500 | 1,097.00  | 147,546,500   | 貸付有価証券<br>300株   |
| 不二越         | 13,000  | 4,360.00  | 56,680,000    |                  |
| 日本トムソン      | 38,400  | 703.00    | 26,995,200    |                  |
| THK         | 87,400  | 3,875.00  | 338,675,000   | 貸付有価証券<br>200株   |
| ユーシン精機      | 9,300   | 875.00    | 8,137,500     |                  |
| 前澤給装工業      | 9,800   | 1,117.00  | 10,946,600    |                  |
| イーグル工業      | 17,300  | 1,200.00  | 20,760,000    |                  |
| 前澤工業        | 8,400   | 666.00    | 5,594,400     |                  |
| 日本ピラー工業     | 14,200  | 1,889.00  | 26,823,800    |                  |
| キッツ         | 43,300  | 725.00    | 31,392,500    |                  |
| マキタ         | 182,800 | 5,120.00  | 935,936,000   | 貸付有価証券<br>100株   |
| 日立造船        | 111,100 | 826.00    | 91,768,600    | 貸付有価証券<br>8,600株 |
| 三菱重工業       | 220,300 | 3,502.00  | 771,490,600   | 貸付有価証券<br>100株   |
| I H I       | 94,300  | 2,320.00  | 218,776,000   | 貸付有価証券<br>200株   |
| スター精密       | 21,600  | 1,692.00  | 36,547,200    |                  |
| 日清紡ホールディングス | 85,700  | 873.00    | 74,816,100    |                  |
| イビデン        | 67,400  | 4,875.00  | 328,575,000   |                  |
| コニカミノルタ     | 284,400 | 638.00    | 181,447,200   | 貸付有価証券<br>1,400株 |
| ブラザー工業      | 171,200 | 2,168.00  | 371,161,600   | 貸付有価証券<br>900株   |
| ミネベアミツミ     | 241,600 | 2,865.00  | 692,184,000   | 貸付有価証券<br>700株   |
| 日立製作所       | 674,000 | 5,384.00  | 3,628,816,000 | 貸付有価証券<br>1,200株 |

|                   |           |           |               |                      |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------|
| 東芝                | 277,400   | 4,515.00  | 1,252,461,000 | 貸付有価証券<br>24,000株    |
| 三菱電機              | 1,401,800 | 1,696.00  | 2,377,452,800 | 貸付有価証券<br>6,200株     |
| 富士電機              | 84,500    | 5,150.00  | 435,175,000   | 貸付有価証券<br>100株       |
| 東洋電機製造            | 5,500     | 1,288.00  | 7,084,000     |                      |
| 安川電機              | 150,900   | 5,170.00  | 780,153,000   | 貸付有価証券<br>900株       |
| シンフォニアテクノロジー      | 18,200    | 1,520.00  | 27,664,000    |                      |
| 明電舎               | 23,800    | 2,419.00  | 57,572,200    |                      |
| オリジン              | 3,800     | 1,354.00  | 5,145,200     |                      |
| 山洋電気              | 6,800     | 7,900.00  | 53,720,000    |                      |
| デンヨー              | 11,900    | 2,046.00  | 24,347,400    |                      |
| 東芝テック             | 15,000    | 4,430.00  | 66,450,000    |                      |
| 芝浦メカトロニクス         | 2,500     | 6,070.00  | 15,175,000    |                      |
| マブチモーター           | 38,800    | 4,445.00  | 172,466,000   |                      |
| 日本電産              | 337,400   | 12,490.00 | 4,214,126,000 | 貸付有価証券<br>800株       |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 7,300     | 947.00    | 6,913,100     | 貸付有価証券<br>700株（600株） |
| トレックス・セミコンダクター    | 7,500     | 1,846.00  | 13,845,000    |                      |
| 東光高岳              | 7,100     | 1,434.00  | 10,181,400    | 貸付有価証券<br>100株       |
| ダブル・スコープ          | 33,200    | 719.00    | 23,870,800    |                      |
| ダイヘン              | 15,300    | 4,930.00  | 75,429,000    |                      |
| ヤーマン              | 22,900    | 1,512.00  | 34,624,800    |                      |
| JVCケンウッド          | 121,300   | 236.00    | 28,626,800    |                      |
| ミマキエンジニアリング       | 12,600    | 679.00    | 8,555,400     |                      |
| I－PEX             | 6,500     | 1,980.00  | 12,870,000    | 貸付有価証券<br>300株       |
| 日新電機              | 32,900    | 1,242.00  | 40,861,800    |                      |
| 大崎電気工業            | 27,900    | 613.00    | 17,102,700    |                      |
| オムロン              | 116,700   | 8,530.00  | 995,451,000   |                      |
| 日東工業              | 20,600    | 1,988.00  | 40,952,800    | 貸付有価証券<br>600株       |
| I D E C           | 18,800    | 1,736.00  | 32,636,800    |                      |

|                      |           |           |               |                          |
|----------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| 正興電機製作所              | 4,400     | 1,732.00  | 7,620,800     |                          |
| 不二電機工業               | 2,300     | 1,289.00  | 2,964,700     |                          |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション    | 50,400    | 3,005.00  | 151,452,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| サクサホールディングス          | 3,300     | 1,491.00  | 4,920,300     |                          |
| メルコホールディングス          | 4,800     | 4,320.00  | 20,736,000    |                          |
| テクノメディカ              | 3,100     | 1,630.00  | 5,053,000     |                          |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 4,100     | 2,828.00  | 11,594,800    | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| 日本電気                 | 178,100   | 6,350.00  | 1,130,935,000 | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| 富士通                  | 126,100   | 16,775.00 | 2,115,327,500 |                          |
| 沖電気工業                | 56,900    | 1,197.00  | 68,109,300    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 岩崎通信機                | 6,100     | 922.00    | 5,624,200     |                          |
| 電気興業                 | 6,700     | 2,586.00  | 17,326,200    |                          |
| サンケン電気               | 16,400    | 5,060.00  | 82,984,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（900株）   |
| ナカヨ                  | 2,700     | 1,524.00  | 4,114,800     |                          |
| アイホン                 | 7,900     | 2,085.00  | 16,471,500    |                          |
| ルネサスエレクトロニクス         | 603,400   | 1,241.00  | 748,819,400   | 貸付有価証券<br>15,400株        |
| セイコーエプソン             | 173,900   | 1,891.00  | 328,844,900   | 貸付有価証券<br>4,900株         |
| ワコム                  | 101,500   | 688.00    | 69,832,000    | 貸付有価証券<br>11,100株        |
| アルバック                | 25,800    | 5,040.00  | 130,032,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| アクセル                 | 5,900     | 1,075.00  | 6,342,500     |                          |
| E I Z O              | 11,900    | 4,160.00  | 49,504,000    |                          |
| 日本信号                 | 32,700    | 962.00    | 31,457,400    | 貸付有価証券<br>300株           |
| 京三製作所                | 30,100    | 417.00    | 12,551,700    |                          |
| 能美防災                 | 18,500    | 2,108.00  | 38,998,000    |                          |
| ホーチキ                 | 10,200    | 1,311.00  | 13,372,200    |                          |
| 星和電機                 | 6,900     | 610.00    | 4,209,000     |                          |
| エレコム                 | 32,100    | 2,327.00  | 74,696,700    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,400株） |
| パナソニック               | 1,495,100 | 1,290.50  | 1,929,426,550 | 貸付有価証券                   |

|                   |         |           |               |                           |
|-------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
|                   |         |           |               | 6,500株                    |
| シャープ              | 186,400 | 1,822.00  | 339,620,800   | 貸付有価証券<br>2,500株          |
| アンリツ              | 84,300  | 2,236.00  | 188,494,800   | 貸付有価証券<br>39,600株（1,000株） |
| 富士通ゼネラル           | 42,800  | 2,916.00  | 124,804,800   | 貸付有価証券<br>100株            |
| ソニーグループ           | 878,200 | 10,780.00 | 9,466,996,000 |                           |
| T D K             | 67,700  | 14,820.00 | 1,003,314,000 | 貸付有価証券<br>500株            |
| 帝国通信工業            | 6,200   | 1,109.00  | 6,875,800     |                           |
| タムラ製作所            | 50,400  | 527.00    | 26,560,800    |                           |
| アルプスアルパイン         | 114,500 | 1,284.00  | 147,018,000   | 貸付有価証券<br>100株            |
| 池上通信機             | 4,400   | 888.00    | 3,907,200     |                           |
| 日本電波工業            | 13,600  | 736.00    | 10,009,600    | 貸付有価証券<br>3,600株（2,800株）  |
| 鈴木                | 6,300   | 1,204.00  | 7,585,200     |                           |
| 日本トリム             | 3,000   | 3,845.00  | 11,535,000    |                           |
| ローランド ディー・<br>ジー・ | 8,300   | 1,867.00  | 15,496,100    |                           |
| フォスター電機           | 14,100  | 1,194.00  | 16,835,400    |                           |
| SMK               | 3,600   | 2,838.00  | 10,216,800    |                           |
| ヨコオ               | 10,800  | 2,638.00  | 28,490,400    |                           |
| ティアック             | 8,800   | 128.00    | 1,126,400     |                           |
| ホシデン              | 38,300  | 1,089.00  | 41,708,700    |                           |
| ヒロセ電機             | 21,600  | 15,500.00 | 334,800,000   |                           |
| 日本航空電子工業          | 32,100  | 1,930.00  | 61,953,000    | 貸付有価証券<br>300株            |
| T O A             | 16,500  | 918.00    | 15,147,000    |                           |
| マクセルホールディング<br>ス  | 27,900  | 1,340.00  | 37,386,000    |                           |
| 古野電気              | 18,000  | 1,117.00  | 20,106,000    |                           |
| ユニデンホールディング<br>ス  | 3,600   | 2,626.00  | 9,453,600     |                           |
| スミダコーポレーション       | 11,900  | 1,039.00  | 12,364,100    |                           |
| アイコム              | 5,800   | 2,656.00  | 15,404,800    |                           |
| リオン               | 5,900   | 2,715.00  | 16,018,500    |                           |
| 本多通信工業            | 10,900  | 510.00    | 5,559,000     |                           |

|             |         |           |               |                          |
|-------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| 船井電機        | 15,700  | 911.00    | 14,302,700    | 貸付有価証券<br>7,300株（100株）   |
| 横河電機        | 140,300 | 2,066.00  | 289,859,800   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 新電元工業       | 5,400   | 3,610.00  | 19,494,000    |                          |
| アズビル        | 94,800  | 4,595.00  | 435,606,000   | 貸付有価証券<br>500株           |
| 東亜ディーケーケー   | 6,900   | 857.00    | 5,913,300     |                          |
| 日本光電工業      | 57,900  | 3,330.00  | 192,807,000   |                          |
| チノー         | 4,400   | 1,369.00  | 6,023,600     |                          |
| 共和電業        | 14,700  | 385.00    | 5,659,500     |                          |
| 日本電子材料      | 5,400   | 2,000.00  | 10,800,000    | 貸付有価証券<br>2,500株（1,800株） |
| 堀場製作所       | 27,800  | 7,550.00  | 209,890,000   | 貸付有価証券<br>900株           |
| アドバンテスト     | 104,200 | 10,200.00 | 1,062,840,000 |                          |
| 小野測器        | 5,800   | 527.00    | 3,056,600     |                          |
| エスベック       | 12,400  | 1,928.00  | 23,907,200    |                          |
| キーエンス       | 137,600 | 53,490.00 | 7,360,224,000 |                          |
| 日置電機        | 6,700   | 5,400.00  | 36,180,000    |                          |
| シスメックス      | 109,400 | 11,160.00 | 1,220,904,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日本マイクロニクス   | 24,400  | 1,698.00  | 41,431,200    |                          |
| メガチップス      | 14,000  | 3,785.00  | 52,990,000    |                          |
| OBARA GROUP | 6,400   | 3,820.00  | 24,448,000    | 貸付有価証券<br>4,000株（4,000株） |
| 澤藤電機        | 1,500   | 2,312.00  | 3,468,000     | 貸付有価証券<br>200株           |
| 原田工業        | 5,700   | 904.00    | 5,152,800     |                          |
| コーセル        | 17,100  | 1,075.00  | 18,382,500    |                          |
| イリソ電子工業     | 11,800  | 5,370.00  | 63,366,000    |                          |
| オプテックスグループ  | 23,000  | 1,732.00  | 39,836,000    |                          |
| 千代田インテグレ    | 5,900   | 1,830.00  | 10,797,000    |                          |
| アイ・オー・データ機器 | 5,200   | 1,104.00  | 5,740,800     |                          |
| レーザーテック     | 61,600  | 18,790.00 | 1,157,464,000 | 貸付有価証券<br>600株           |
| スタンレー電気     | 98,100  | 3,195.00  | 313,429,500   | 貸付有価証券<br>900株           |
| 岩崎電気        | 5,100   | 1,509.00  | 7,695,900     |                          |



|                  |         |           |               |                      |
|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------|
| ウシオ電機            | 71,900  | 1,483.00  | 106,627,700   |                      |
| 岡谷電機産業           | 10,000  | 398.00    | 3,980,000     |                      |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 12,900  | 361.00    | 4,656,900     |                      |
| エノモト             | 3,900   | 1,830.00  | 7,137,000     |                      |
| 日本セラミック          | 14,200  | 2,768.00  | 39,305,600    |                      |
| 遠藤照明             | 7,100   | 771.00    | 5,474,100     |                      |
| 古河電池             | 10,000  | 1,640.00  | 16,400,000    | 貸付有価証券<br>4,700株     |
| 双信電機             | 6,800   | 508.00    | 3,454,400     | 貸付有価証券<br>900株（700株） |
| 山一電機             | 9,100   | 1,590.00  | 14,469,000    |                      |
| 図研               | 9,100   | 2,971.00  | 27,036,100    |                      |
| 日本電子             | 25,500  | 6,130.00  | 156,315,000   |                      |
| カシオ計算機           | 112,700 | 1,984.00  | 223,596,800   | 貸付有価証券<br>800株       |
| ファナック            | 123,000 | 26,580.00 | 3,269,340,000 |                      |
| 日本シイエムケイ         | 30,200  | 457.00    | 13,801,400    | 貸付有価証券<br>500株       |
| エンプラス            | 6,300   | 4,175.00  | 26,302,500    |                      |
| 大真空              | 4,700   | 2,585.00  | 12,149,500    |                      |
| ローム              | 58,300  | 10,600.00 | 617,980,000   |                      |
| 浜松ホトニクス          | 100,600 | 6,380.00  | 641,828,000   | 貸付有価証券<br>500株       |
| 三井ハイテック          | 13,700  | 4,225.00  | 57,882,500    |                      |
| 新光電気工業           | 47,100  | 3,330.00  | 156,843,000   |                      |
| 京セラ              | 213,700 | 6,901.00  | 1,474,743,700 |                      |
| 太陽誘電             | 62,300  | 5,000.00  | 311,500,000   |                      |
| 村田製作所            | 411,800 | 8,699.00  | 3,582,248,200 |                      |
| 双葉電子工業           | 24,000  | 912.00    | 21,888,000    |                      |
| 北陸電気工業           | 5,200   | 936.00    | 4,867,200     |                      |
| ニチコン             | 44,100  | 1,084.00  | 47,804,400    | 貸付有価証券<br>100株       |
| 日本ケミコン           | 14,100  | 1,768.00  | 24,928,800    |                      |
| K O A            | 19,400  | 1,665.00  | 32,301,000    |                      |
| 市光工業             | 21,000  | 714.00    | 14,994,000    |                      |
| 小糸製作所            | 84,000  | 6,990.00  | 587,160,000   |                      |
| ミツバ              | 25,800  | 675.00    | 17,415,000    |                      |

|                |           |           |                |                  |
|----------------|-----------|-----------|----------------|------------------|
| SCREENホールディングス | 24,300    | 10,420.00 | 253,206,000    |                  |
| キャノン電子         | 12,900    | 1,787.00  | 23,052,300     |                  |
| キャノン           | 696,600   | 2,621.50  | 1,826,136,900  | 貸付有価証券<br>4,300株 |
| リコー            | 356,600   | 1,232.00  | 439,331,200    |                  |
| 象印マホービン        | 37,900    | 1,738.00  | 65,870,200     |                  |
| MUTOHホールディングス  | 1,800     | 1,571.00  | 2,827,800      | 貸付有価証券<br>200株   |
| 東京エレクトロン       | 82,100    | 50,060.00 | 4,109,926,000  |                  |
| トヨタ紡織          | 40,800    | 2,071.00  | 84,496,800     |                  |
| 芦森工業           | 2,600     | 1,018.00  | 2,646,800      |                  |
| ユニプレス          | 23,000    | 1,110.00  | 25,530,000     |                  |
| 豊田自動織機         | 113,500   | 9,020.00  | 1,023,770,000  | 貸付有価証券<br>200株   |
| モリタホールディングス    | 22,500    | 1,605.00  | 36,112,500     |                  |
| 三櫻工業           | 19,400    | 1,209.00  | 23,454,600     | 貸付有価証券<br>300株   |
| デンソー           | 308,700   | 7,274.00  | 2,245,483,800  | 貸付有価証券<br>100株   |
| 東海理化電機製作所      | 36,900    | 1,776.00  | 65,534,400     |                  |
| 三井E&Sホールディングス  | 54,300    | 597.00    | 32,417,100     | 貸付有価証券<br>700株   |
| 川崎重工業          | 109,100   | 2,807.00  | 306,243,700    | 貸付有価証券<br>200株   |
| 名村造船所          | 42,100    | 188.00    | 7,914,800      | 貸付有価証券<br>2,400株 |
| サノヤスホールディングス   | 17,200    | 152.00    | 2,614,400      |                  |
| 日本車輛製造         | 5,100     | 2,446.00  | 12,474,600     |                  |
| 三菱ロジスネクスト      | 18,600    | 1,200.00  | 22,320,000     | 貸付有価証券<br>6,200株 |
| 近畿車輛           | 2,400     | 1,296.00  | 3,110,400      |                  |
| 日産自動車          | 1,653,300 | 582.40    | 962,881,920    | 貸付有価証券<br>5,200株 |
| いすゞ自動車         | 372,200   | 1,156.00  | 430,263,200    |                  |
| トヨタ自動車         | 1,420,200 | 8,506.00  | 12,080,221,200 | 貸付有価証券<br>1,500株 |
| 日野自動車          | 175,100   | 960.00    | 168,096,000    |                  |
| 三菱自動車工業        | 518,900   | 311.00    | 161,377,900    | 貸付有価証券           |

|              |           |          |               |                  |
|--------------|-----------|----------|---------------|------------------|
|              |           |          |               | 243,800株         |
| エフテック        | 9,800     | 744.00   | 7,291,200     |                  |
| レシップホールディングス | 5,600     | 552.00   | 3,091,200     |                  |
| GMB          | 2,500     | 962.00   | 2,405,000     |                  |
| ファルテック       | 2,400     | 889.00   | 2,133,600     |                  |
| 武蔵精密工業       | 31,200    | 1,968.00 | 61,401,600    |                  |
| 日産車体         | 20,500    | 736.00   | 15,088,000    |                  |
| 新明和工業        | 39,600    | 1,032.00 | 40,867,200    | 貸付有価証券<br>100株   |
| 極東開発工業       | 24,200    | 1,707.00 | 41,309,400    |                  |
| トピー工業        | 11,500    | 1,398.00 | 16,077,000    |                  |
| ティラド         | 4,400     | 1,968.00 | 8,659,200     |                  |
| タチエス         | 21,500    | 1,185.00 | 25,477,500    | 貸付有価証券<br>100株   |
| NOK          | 67,800    | 1,452.00 | 98,445,600    |                  |
| フタバ産業        | 35,100    | 548.00   | 19,234,800    |                  |
| KYB          | 15,700    | 3,195.00 | 50,161,500    |                  |
| 大同メタル工業      | 29,000    | 589.00   | 17,081,000    |                  |
| プレス工業        | 69,500    | 337.00   | 23,421,500    |                  |
| ミクニ          | 17,800    | 317.00   | 5,642,600     |                  |
| 太平洋工業        | 29,400    | 1,262.00 | 37,102,800    |                  |
| 河西工業         | 18,900    | 472.00   | 8,920,800     |                  |
| アイシン         | 102,600   | 4,320.00 | 443,232,000   | 貸付有価証券<br>1,100株 |
| マツダ          | 440,000   | 900.00   | 396,000,000   | 貸付有価証券<br>5,100株 |
| 今仙電機製作所      | 12,300    | 740.00   | 9,102,000     |                  |
| 本田技研工業       | 1,103,800 | 3,431.00 | 3,787,137,800 | 貸付有価証券<br>100株   |
| スズキ          | 277,900   | 4,297.00 | 1,194,136,300 |                  |
| SUBARU       | 401,700   | 2,128.00 | 854,817,600   | 貸付有価証券<br>1,500株 |
| 安永           | 6,800     | 1,223.00 | 8,316,400     |                  |
| ヤマハ発動機       | 198,100   | 2,875.00 | 569,537,500   |                  |
| TBK          | 16,600    | 416.00   | 6,905,600     |                  |
| エクセディ        | 19,000    | 1,610.00 | 30,590,000    | 貸付有価証券<br>4,500株 |
| 豊田合成         | 45,300    | 2,713.00 | 122,898,900   | 貸付有価証券           |

|            |         |           |               |                      |
|------------|---------|-----------|---------------|----------------------|
|            |         |           |               | 200株                 |
| 愛三工業       | 21,900  | 789.00    | 17,279,100    |                      |
| 盟和産業       | 2,100   | 862.00    | 1,810,200     |                      |
| 日本プラスト     | 11,800  | 588.00    | 6,938,400     |                      |
| ヨロズ        | 12,000  | 1,268.00  | 15,216,000    | 貸付有価証券<br>400株       |
| エフ・シー・シー   | 22,900  | 1,794.00  | 41,082,600    |                      |
| シマノ        | 52,500  | 25,205.00 | 1,323,262,500 | 貸付有価証券<br>600株       |
| ティ・エス テック  | 65,100  | 1,536.00  | 99,993,600    |                      |
| ジャムコ       | 8,200   | 910.00    | 7,462,000     | 貸付有価証券<br>200株       |
| テルモ        | 429,700 | 4,241.00  | 1,822,357,700 | 貸付有価証券<br>100株       |
| クリエートメディック | 4,600   | 1,018.00  | 4,682,800     |                      |
| 日機装        | 45,300  | 1,161.00  | 52,593,300    | 貸付有価証券<br>100株       |
| 日本エム・ディ・エム | 8,100   | 2,250.00  | 18,225,000    | 貸付有価証券<br>100株       |
| 島津製作所      | 180,400 | 3,985.00  | 718,894,000   | 貸付有価証券<br>1,000株     |
| JMS        | 11,800  | 991.00    | 11,693,800    |                      |
| クボテック      | 3,600   | 366.00    | 1,317,600     | 貸付有価証券<br>100株（100株） |
| 長野計器       | 10,100  | 1,241.00  | 12,534,100    |                      |
| ブイ・テクノロジー  | 6,600   | 5,520.00  | 36,432,000    |                      |
| 東京計器       | 8,900   | 1,079.00  | 9,603,100     |                      |
| 愛知時計電機     | 1,800   | 4,295.00  | 7,731,000     |                      |
| インターアクション  | 7,000   | 2,377.00  | 16,639,000    |                      |
| オーバル       | 12,500  | 286.00    | 3,575,000     |                      |
| 東京精密       | 23,600  | 5,260.00  | 124,136,000   |                      |
| マニー        | 55,800  | 2,562.00  | 142,959,600   |                      |
| ニコン        | 214,100 | 1,077.00  | 230,585,700   |                      |
| トプコン       | 70,600  | 1,591.00  | 112,324,600   |                      |
| オリンパス      | 775,700 | 2,279.00  | 1,767,820,300 | 貸付有価証券<br>5,900株     |
| 理研計器       | 12,400  | 2,888.00  | 35,811,200    |                      |
| タムロン       | 11,300  | 2,413.00  | 27,266,900    |                      |
| HOYA       | 275,900 | 13,155.00 | 3,629,464,500 |                      |

|                   |         |          |             |                  |
|-------------------|---------|----------|-------------|------------------|
| シード               | 5,400   | 720.00   | 3,888,000   |                  |
| ノーリツ銅機            | 12,600  | 2,519.00 | 31,739,400  |                  |
| エー・アンド・デイ         | 11,800  | 1,355.00 | 15,989,000  |                  |
| 朝日インテック           | 147,600 | 2,968.00 | 438,076,800 | 貸付有価証券<br>600株   |
| シチズン時計            | 177,900 | 392.00   | 69,736,800  |                  |
| リズム               | 4,400   | 813.00   | 3,577,200   |                  |
| 大研医器              | 11,100  | 578.00   | 6,415,800   |                  |
| メニコン              | 21,500  | 6,850.00 | 147,275,000 | 貸付有価証券<br>1,300株 |
| シンシア              | 1,500   | 888.00   | 1,332,000   |                  |
| 松風                | 6,400   | 2,137.00 | 13,676,800  |                  |
| セイコーホールディングス      | 19,800  | 2,107.00 | 41,718,600  | 貸付有価証券<br>100株   |
| ニプロ               | 104,500 | 1,386.00 | 144,837,000 |                  |
| 中本パックス            | 3,600   | 1,604.00 | 5,774,400   |                  |
| スノーピーク            | 8,300   | 4,165.00 | 34,569,500  |                  |
| パラマウントベッドホールディングス | 26,900  | 2,240.00 | 60,256,000  |                  |
| トランザクション          | 7,700   | 1,362.00 | 10,487,400  | 貸付有価証券<br>200株   |
| 粧美堂               | 4,100   | 415.00   | 1,701,500   | 貸付有価証券<br>100株   |
| ニホンフラッシュ          | 12,000  | 1,338.00 | 16,056,000  |                  |
| 前田工織              | 15,400  | 3,415.00 | 52,591,000  | 貸付有価証券<br>600株   |
| 永大産業              | 18,300  | 347.00   | 6,350,100   |                  |
| アートネイチャー          | 13,500  | 679.00   | 9,166,500   |                  |
| バンダイナムコホールディングス   | 115,900 | 8,091.00 | 937,746,900 | 貸付有価証券<br>100株   |
| アイフィスジャパン         | 3,600   | 743.00   | 2,674,800   |                  |
| 共立印刷              | 23,400  | 134.00   | 3,135,600   |                  |
| SHOEI             | 13,200  | 4,025.00 | 53,130,000  |                  |
| フランスベッドホールディングス   | 18,000  | 931.00   | 16,758,000  |                  |
| パイロットコーポレーション     | 23,700  | 3,585.00 | 84,964,500  | 貸付有価証券<br>100株   |
| 萩原工業              | 7,800   | 1,454.00 | 11,341,200  |                  |
| トッパン・フォームズ        | 25,000  | 1,155.00 | 28,875,000  |                  |

|                  |         |           |               |                   |
|------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| フジシールインターナショナル   | 28,800  | 2,479.00  | 71,395,200    |                   |
| タカラトミー           | 62,900  | 965.00    | 60,698,500    |                   |
| 廣済堂              | 9,800   | 1,026.00  | 10,054,800    |                   |
| エステールホールディングス    | 3,700   | 627.00    | 2,319,900     |                   |
| タカノ              | 4,800   | 641.00    | 3,076,800     | 貸付有価証券<br>1,100株  |
| プロネクサス           | 11,200  | 1,169.00  | 13,092,800    |                   |
| ホクシン             | 8,600   | 249.00    | 2,141,400     | 貸付有価証券<br>4,300株  |
| ウッドワン            | 4,700   | 1,684.00  | 7,914,800     |                   |
| 大建工業             | 9,400   | 2,125.00  | 19,975,000    |                   |
| 凸版印刷             | 213,100 | 1,953.00  | 416,184,300   | 貸付有価証券<br>800株    |
| 大日本印刷            | 169,300 | 2,297.00  | 388,882,100   | 貸付有価証券<br>200株    |
| 共同印刷             | 4,300   | 2,779.00  | 11,949,700    |                   |
| N I S S H A      | 28,800  | 1,337.00  | 38,505,600    |                   |
| 光村印刷             | 1,200   | 1,769.00  | 2,122,800     |                   |
| TAKARA & COMPANY | 6,900   | 1,904.00  | 13,137,600    | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| アシックス            | 124,000 | 1,824.00  | 226,176,000   |                   |
| ツツミ              | 3,500   | 2,392.00  | 8,372,000     |                   |
| ローランド            | 10,900  | 5,320.00  | 57,988,000    |                   |
| 小松ウオール工業         | 4,300   | 2,059.00  | 8,853,700     |                   |
| ヤマハ              | 83,400  | 6,290.00  | 524,586,000   | 貸付有価証券<br>200株    |
| 河合楽器製作所          | 3,900   | 3,490.00  | 13,611,000    |                   |
| クリナップ            | 13,000  | 557.00    | 7,241,000     |                   |
| ピジョン             | 90,000  | 3,700.00  | 333,000,000   | 貸付有価証券<br>42,100株 |
| オリバー             | 3,000   | 2,562.00  | 7,686,000     | 貸付有価証券<br>400株    |
| 兼松サステック          | 900     | 1,779.00  | 1,601,100     |                   |
| キングジム            | 11,700  | 952.00    | 11,138,400    |                   |
| リンテック            | 30,000  | 2,507.00  | 75,210,000    |                   |
| イトーキ             | 27,800  | 391.00    | 10,869,800    |                   |
| 任天堂              | 80,200  | 62,220.00 | 4,990,044,000 |                   |

|              |           |          |             |                          |
|--------------|-----------|----------|-------------|--------------------------|
| 三菱鉛筆         | 23,100    | 1,487.00 | 34,349,700  |                          |
| タカスタンダード     | 29,000    | 1,610.00 | 46,690,000  | 貸付有価証券<br>100株           |
| コクヨ          | 67,200    | 1,702.00 | 114,374,400 |                          |
| ナカバヤシ        | 13,800    | 607.00   | 8,376,600   |                          |
| グローブライド      | 6,800     | 4,420.00 | 30,056,000  |                          |
| オカムラ         | 48,200    | 1,361.00 | 65,600,200  |                          |
| 美津濃          | 13,900    | 2,312.00 | 32,136,800  |                          |
| 東京電力ホールディングス | 1,189,100 | 345.00   | 410,239,500 | 貸付有価証券<br>6,600株         |
| 中部電力         | 428,900   | 1,362.50 | 584,376,250 |                          |
| 関西電力         | 531,200   | 1,098.00 | 583,257,600 | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| 中国電力         | 202,200   | 1,243.00 | 251,334,600 | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| 北陸電力         | 128,200   | 679.00   | 87,047,800  |                          |
| 東北電力         | 328,300   | 976.00   | 320,420,800 |                          |
| 四国電力         | 116,500   | 817.00   | 95,180,500  |                          |
| 九州電力         | 309,600   | 1,012.00 | 313,315,200 | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| 北海道電力        | 131,200   | 536.00   | 70,323,200  |                          |
| 沖縄電力         | 27,300    | 1,490.00 | 40,677,000  |                          |
| 電源開発         | 111,500   | 1,692.00 | 188,658,000 | 貸付有価証券<br>3,000株（3,000株） |
| エフオン         | 8,500     | 1,031.00 | 8,763,500   | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| イーレックス       | 20,600    | 1,961.00 | 40,396,600  | 貸付有価証券<br>6,800株（6,800株） |
| レノバ          | 23,800    | 3,140.00 | 74,732,000  | 貸付有価証券<br>4,600株（4,000株） |
| 東京瓦斯         | 269,600   | 2,334.50 | 629,381,200 |                          |
| 大阪瓦斯         | 253,900   | 2,152.00 | 546,392,800 |                          |
| 東邦瓦斯         | 68,900    | 6,330.00 | 436,137,000 | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| 北海道瓦斯        | 7,500     | 1,568.00 | 11,760,000  |                          |
| 広島ガス         | 28,900    | 388.00   | 11,213,200  |                          |
| 西部ガスホールディングス | 15,800    | 2,553.00 | 40,337,400  |                          |
| 静岡ガス         | 39,800    | 982.00   | 39,083,600  |                          |

|                |         |           |               |                          |
|----------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| メタウォーター        | 15,800  | 2,100.00  | 33,180,000    |                          |
| SBSホールディングス    | 10,400  | 2,816.00  | 29,286,400    |                          |
| 東武鉄道           | 146,100 | 2,948.00  | 430,702,800   |                          |
| 相鉄ホールディングス     | 48,100  | 2,253.00  | 108,369,300   | 貸付有価証券<br>800株           |
| 東急             | 353,600 | 1,460.00  | 516,256,000   | 貸付有価証券<br>3,900株         |
| 京浜急行電鉄         | 180,000 | 1,445.00  | 260,100,000   | 貸付有価証券<br>12,600株        |
| 小田急電鉄          | 224,500 | 2,998.00  | 673,051,000   | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| 京王電鉄           | 78,300  | 7,210.00  | 564,543,000   |                          |
| 京成電鉄           | 105,100 | 3,320.00  | 348,932,000   |                          |
| 富士急行           | 19,100  | 5,260.00  | 100,466,000   | 貸付有価証券<br>900株           |
| 新京成電鉄          | 3,600   | 2,178.00  | 7,840,800     |                          |
| 東日本旅客鉄道        | 246,700 | 7,683.00  | 1,895,396,100 |                          |
| 西日本旅客鉄道        | 124,900 | 6,221.00  | 777,002,900   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 東海旅客鉄道         | 116,600 | 16,270.00 | 1,897,082,000 |                          |
| 西武ホールディングス     | 168,900 | 1,167.00  | 197,106,300   | 貸付有価証券<br>3,300株         |
| 鴻池運輸           | 22,300  | 1,177.00  | 26,247,100    |                          |
| 西日本鉄道          | 38,900  | 2,849.00  | 110,826,100   |                          |
| ハマキョウレックス      | 10,800  | 3,180.00  | 34,344,000    |                          |
| サカイ引越センター      | 6,400   | 5,660.00  | 36,224,000    |                          |
| 近鉄グループホールディングス | 132,800 | 4,070.00  | 540,496,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 阪急阪神ホールディングス   | 177,100 | 3,525.00  | 624,277,500   |                          |
| 南海電気鉄道         | 62,900  | 2,385.00  | 150,016,500   | 貸付有価証券<br>200株           |
| 京阪ホールディングス     | 59,100  | 3,850.00  | 227,535,000   | 貸付有価証券<br>600株           |
| 神戸電鉄           | 3,200   | 3,620.00  | 11,584,000    |                          |
| 名古屋鉄道          | 109,200 | 2,560.00  | 279,552,000   | 貸付有価証券<br>400株           |
| 山陽電気鉄道         | 9,500   | 1,890.00  | 17,955,000    |                          |
| アルプス物流         | 9,300   | 953.00    | 8,862,900     | 貸付有価証券<br>5,400株（5,400株） |



|                  |         |          |             |                          |
|------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 日本通運             | 46,000  | 8,940.00 | 411,240,000 |                          |
| ヤマトホールディングス      | 186,000 | 3,105.00 | 577,530,000 | 貸付有価証券<br>200株           |
| 山九               | 34,100  | 4,930.00 | 168,113,000 |                          |
| 丸運               | 7,600   | 282.00   | 2,143,200   |                          |
| 丸全昭和運輸           | 10,800  | 3,270.00 | 35,316,000  |                          |
| センコーグループホールディングス | 73,200  | 1,040.00 | 76,128,000  | 貸付有価証券<br>4,800株（3,700株） |
| トナミホールディングス      | 3,200   | 5,350.00 | 17,120,000  |                          |
| ニッコンホールディングス     | 44,600  | 2,335.00 | 104,141,000 |                          |
| 日本石油輸送           | 1,400   | 2,649.00 | 3,708,600   |                          |
| 福山通運             | 17,000  | 4,335.00 | 73,695,000  |                          |
| セイノーホールディングス     | 99,400  | 1,567.00 | 155,759,800 |                          |
| エスライン            | 3,600   | 921.00   | 3,315,600   |                          |
| 神奈川中央交通          | 3,300   | 3,695.00 | 12,193,500  |                          |
| 日立物流             | 29,200  | 3,470.00 | 101,324,000 |                          |
| 丸和運輸機関           | 28,000  | 1,929.00 | 54,012,000  | 貸付有価証券<br>9,200株         |
| C & F ロジホールディングス | 13,400  | 1,758.00 | 23,557,200  |                          |
| 九州旅客鉄道           | 102,700 | 2,530.00 | 259,831,000 | 貸付有価証券<br>4,700株         |
| S Gホールディングス      | 250,900 | 2,504.00 | 628,253,600 | 貸付有価証券<br>300株           |
| 日本郵船             | 111,000 | 4,415.00 | 490,065,000 | 貸付有価証券<br>300株           |
| 商船三井             | 78,800  | 4,680.00 | 368,784,000 | 貸付有価証券<br>3,700株         |
| 川崎汽船             | 40,900  | 3,165.00 | 129,448,500 |                          |
| N S ユナイテッド海運     | 6,300   | 2,385.00 | 15,025,500  |                          |
| 明治海運             | 14,100  | 501.00   | 7,064,100   |                          |
| 飯野海運             | 61,600  | 561.00   | 34,557,600  |                          |
| 共栄タンカー           | 2,300   | 1,001.00 | 2,302,300   |                          |
| 乾汽船              | 9,100   | 1,146.00 | 10,428,600  |                          |
| 日本航空             | 323,400 | 2,317.00 | 749,317,800 |                          |
| A N Aホールディングス    | 358,300 | 2,568.00 | 920,114,400 |                          |
| パスコ              | 2,600   | 1,410.00 | 3,666,000   |                          |

|              |        |          |             |                          |
|--------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| トランコム        | 4,000  | 9,020.00 | 36,080,000  |                          |
| 日新           | 10,600 | 1,422.00 | 15,073,200  |                          |
| 三菱倉庫         | 45,900 | 3,355.00 | 153,994,500 |                          |
| 三井倉庫ホールディングス | 14,100 | 2,371.00 | 33,431,100  |                          |
| 住友倉庫         | 46,900 | 1,478.00 | 69,318,200  | 貸付有価証券<br>100株           |
| 澁澤倉庫         | 7,300  | 2,160.00 | 15,768,000  |                          |
| 東陽倉庫         | 22,300 | 332.00   | 7,403,600   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日本トランスシティ    | 29,200 | 538.00   | 15,709,600  | 貸付有価証券<br>100株           |
| ケイヒン         | 2,600  | 1,400.00 | 3,640,000   |                          |
| 中央倉庫         | 8,100  | 1,102.00 | 8,926,200   |                          |
| 川西倉庫         | 2,400  | 1,169.00 | 2,805,600   |                          |
| 安田倉庫         | 10,900 | 953.00   | 10,387,700  |                          |
| ファイズホールディングス | 2,400  | 933.00   | 2,239,200   |                          |
| 東洋埠頭         | 4,000  | 1,505.00 | 6,020,000   |                          |
| 宇徳           | 9,500  | 503.00   | 4,778,500   |                          |
| 上組           | 73,000 | 2,225.00 | 162,425,000 |                          |
| サンリツ         | 3,400  | 717.00   | 2,437,800   |                          |
| キムラユニティー     | 3,500  | 1,282.00 | 4,487,000   |                          |
| キューソー流通システム  | 3,300  | 1,635.00 | 5,395,500   | 貸付有価証券<br>500株           |
| 近鉄エクスプレス     | 25,100 | 2,727.00 | 68,447,700  |                          |
| 東海運          | 7,600  | 355.00   | 2,698,000   |                          |
| エーアイテイー      | 8,300  | 1,068.00 | 8,864,400   |                          |
| 内外トランスライン    | 4,700  | 1,858.00 | 8,732,600   |                          |
| 日本コンセプト      | 4,200  | 1,599.00 | 6,715,800   |                          |
| NEC ネットエスアイ  | 45,500 | 1,893.00 | 86,131,500  |                          |
| クロスキャット      | 3,600  | 1,022.00 | 3,679,200   |                          |
| システナ         | 49,100 | 2,280.00 | 111,948,000 |                          |
| デジタルアーツ      | 8,000  | 8,740.00 | 69,920,000  | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日鉄ソリューションズ   | 19,900 | 3,325.00 | 66,167,500  |                          |
| キューブシステム     | 7,300  | 1,099.00 | 8,022,700   | 貸付有価証券<br>1,800株（1,000株） |
| エイジア         | 2,100  | 1,927.00 | 4,046,700   |                          |

|                      |         |          |               |                        |
|----------------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| コア                   | 5,800   | 1,504.00 | 8,723,200     |                        |
| ラクーンホールディングス         | 9,700   | 3,195.00 | 30,991,500    | 貸付有価証券<br>2,500株（800株） |
| ソリトンシステムズ            | 6,900   | 1,772.00 | 12,226,800    |                        |
| ソフトクリエイトホールディングス     | 5,400   | 2,511.00 | 13,559,400    |                        |
| T I S                | 137,600 | 2,681.00 | 368,905,600   |                        |
| J N Sホールディングス        | 6,800   | 545.00   | 3,706,000     |                        |
| 電算システム               | 5,200   | 3,340.00 | 17,368,000    |                        |
| グリー                  | 84,400  | 586.00   | 49,458,400    | 貸付有価証券<br>9,800株       |
| GMOベパボ               | 1,200   | 5,930.00 | 7,116,000     | 貸付有価証券<br>500株         |
| コーエーテクモホールディングス      | 36,600  | 4,665.00 | 170,739,000   |                        |
| 三菱総合研究所              | 5,900   | 4,140.00 | 24,426,000    |                        |
| ボルテージ                | 3,700   | 648.00   | 2,397,600     |                        |
| 電算                   | 1,500   | 2,402.00 | 3,603,000     |                        |
| A G S                | 7,000   | 805.00   | 5,635,000     |                        |
| ファインデックス             | 11,600  | 1,205.00 | 13,978,000    | 貸付有価証券<br>800株（800株）   |
| ブレインパッド              | 3,600   | 5,160.00 | 18,576,000    |                        |
| K L a b              | 25,200  | 780.00   | 19,656,000    | 貸付有価証券<br>1,400株（500株） |
| ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ | 18,300  | 1,158.00 | 21,191,400    |                        |
| イーブックイニシアティブジャパン     | 2,200   | 2,722.00 | 5,988,400     | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| ネクソン                 | 348,100 | 3,470.00 | 1,207,907,000 | 貸付有価証券<br>600株         |
| アイスタイル               | 42,000  | 502.00   | 21,084,000    |                        |
| エムアップホールディングス        | 3,600   | 2,841.00 | 10,227,600    | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| エイチーム                | 9,500   | 1,632.00 | 15,504,000    | 貸付有価証券<br>200株         |
| エニグモ                 | 13,000  | 1,310.00 | 17,030,000    |                        |
| テクノスジャパン             | 10,700  | 658.00   | 7,040,600     |                        |
| e n i s h            | 7,200   | 536.00   | 3,859,200     | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| コロプラ                 | 45,200  | 814.00   | 36,792,800    | 貸付有価証券                 |

|                          |        |           |             |                          |
|--------------------------|--------|-----------|-------------|--------------------------|
|                          |        |           |             | 5,200株                   |
| オルトプラス                   | 10,600 | 489.00    | 5,183,400   | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| ブロードリーフ                  | 68,200 | 573.00    | 39,078,600  | 貸付有価証券<br>43,600株        |
| クロス・マーケティング<br>グループ      | 6,100  | 526.00    | 3,208,600   |                          |
| デジタルハーツホール<br>ディングス      | 6,200  | 1,589.00  | 9,851,800   |                          |
| システム情報                   | 10,300 | 999.00    | 10,289,700  | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| メディアドゥ                   | 5,400  | 5,270.00  | 28,458,000  | 貸付有価証券<br>2,600株（2,600株） |
| じげん                      | 34,000 | 408.00    | 13,872,000  |                          |
| ブイキューブ                   | 7,500  | 2,828.00  | 21,210,000  | 貸付有価証券<br>3,500株         |
| エンカレッジ・テクノロ<br>ジ         | 2,400  | 655.00    | 1,572,000   |                          |
| サイバーリンクス                 | 4,500  | 1,639.00  | 7,375,500   | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| ディー・エル・イー                | 11,100 | 298.00    | 3,307,800   | 貸付有価証券<br>6,900株（4,900株） |
| フィックスターズ                 | 14,600 | 1,006.00  | 14,687,600  |                          |
| CARTA HOLD I<br>NGS      | 5,600  | 1,520.00  | 8,512,000   | 貸付有価証券<br>3,500株（3,500株） |
| オブティム                    | 9,600  | 2,751.00  | 26,409,600  | 貸付有価証券<br>2,100株（1,500株） |
| セレス                      | 4,500  | 3,800.00  | 17,100,000  | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株） |
| SH I F T                 | 6,900  | 15,370.00 | 106,053,000 | 貸付有価証券<br>3,100株（3,100株） |
| ティーガイア                   | 14,600 | 1,929.00  | 28,163,400  |                          |
| セック                      | 2,000  | 2,735.00  | 5,470,000   |                          |
| 日本アジアグループ                | 13,300 | 940.00    | 12,502,000  | 貸付有価証券<br>500株           |
| テクマトリックス                 | 21,300 | 2,076.00  | 44,218,800  |                          |
| プロシップ                    | 4,000  | 1,412.00  | 5,648,000   |                          |
| ガンホー・オンライン・<br>エンターテイメント | 33,200 | 2,111.00  | 70,085,200  |                          |
| GMOペイメントゲート<br>ウェイ       | 26,300 | 13,350.00 | 351,105,000 | 貸付有価証券<br>5,200株         |

|                       |        |          |            |                          |
|-----------------------|--------|----------|------------|--------------------------|
| ザッパラス                 | 5,300  | 516.00   | 2,734,800  |                          |
| システムリサーチ              | 4,000  | 2,150.00 | 8,600,000  |                          |
| インターネットイニシアティブ        | 36,600 | 2,436.00 | 89,157,600 |                          |
| さくらインターネット            | 14,700 | 665.00   | 9,775,500  | 貸付有価証券<br>3,500株（900株）   |
| ヴィンクス                 | 3,900  | 1,047.00 | 4,083,300  |                          |
| GMO グローバルサイン・ホールディングス | 3,100  | 5,600.00 | 17,360,000 | 貸付有価証券<br>1,500株（1,100株） |
| S R Aホールディングス         | 7,300  | 2,632.00 | 19,213,600 |                          |
| システムインテグレータ           | 3,900  | 671.00   | 2,616,900  |                          |
| 朝日ネット                 | 11,100 | 752.00   | 8,347,200  |                          |
| e B A S E             | 16,400 | 990.00   | 16,236,000 |                          |
| アバント                  | 14,700 | 1,647.00 | 24,210,900 |                          |
| アドソル日進                | 4,900  | 2,675.00 | 13,107,500 |                          |
| ODKソリューションズ           | 2,900  | 844.00   | 2,447,600  |                          |
| フリービット                | 8,200  | 925.00   | 7,585,000  | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| コムチュア                 | 12,600 | 2,607.00 | 32,848,200 | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| サイバーコム                | 2,400  | 1,550.00 | 3,720,000  |                          |
| アステリア                 | 9,900  | 824.00   | 8,157,600  | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| アイル                   | 7,600  | 1,764.00 | 13,406,400 |                          |
| マークラインズ               | 5,700  | 3,210.00 | 18,297,000 |                          |
| メディカル・データ・ビジョン        | 15,700 | 1,936.00 | 30,395,200 | 貸付有価証券<br>6,000株（2,800株） |
| g u m i               | 19,000 | 1,401.00 | 26,619,000 | 貸付有価証券<br>9,500株（3,700株） |
| ショーケース                | 3,000  | 839.00   | 2,517,000  | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| モバイルファクトリー            | 3,100  | 1,437.00 | 4,454,700  | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| テラスカイ                 | 4,400  | 2,783.00 | 12,245,200 | 貸付有価証券<br>2,800株（1,000株） |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 6,100  | 2,179.00 | 13,291,900 |                          |
| P C I ホールディングス        | 5,200  | 1,459.00 | 7,586,800  |                          |
| パイプドHD                | 2,800  | 1,673.00 | 4,684,400  |                          |
| アイビーシー                | 2,200  | 996.00   | 2,191,200  |                          |

|                   |        |          |            |                          |
|-------------------|--------|----------|------------|--------------------------|
| ネオジャパン            | 2,600  | 1,773.00 | 4,609,800  | 貸付有価証券<br>600株（300株）     |
| PR TIMES          | 2,900  | 3,145.00 | 9,120,500  | 貸付有価証券<br>1,200株（100株）   |
| ラクス               | 41,400 | 2,068.00 | 85,615,200 | 貸付有価証券<br>8,200株（8,200株） |
| ランドコンピュータ         | 2,100  | 1,105.00 | 2,320,500  |                          |
| ダブルスタンダード         | 1,800  | 3,580.00 | 6,444,000  | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| オープンドア            | 8,200  | 2,073.00 | 16,998,600 | 貸付有価証券<br>4,100株（2,100株） |
| マイネット             | 4,500  | 864.00   | 3,888,000  | 貸付有価証券<br>1,900株（1,900株） |
| アカツキ              | 5,500  | 4,035.00 | 22,192,500 |                          |
| ベネフィットジャパン        | 1,000  | 1,924.00 | 1,924,000  |                          |
| Ubicomホールディングス    | 3,600  | 3,155.00 | 11,358,000 |                          |
| カナミックネットワーク       | 14,700 | 651.00   | 9,569,700  |                          |
| ノムラシステムコーポレーション   | 6,000  | 312.00   | 1,872,000  |                          |
| チェンジ              | 25,300 | 3,315.00 | 83,869,500 | 貸付有価証券<br>3,300株（1,400株） |
| シンクロ・フード          | 8,200  | 378.00   | 3,099,600  |                          |
| オークネット            | 7,300  | 1,285.00 | 9,380,500  |                          |
| キャピタル・アセット・プランニング | 2,700  | 1,273.00 | 3,437,100  |                          |
| セグエグループ           | 3,500  | 1,332.00 | 4,662,000  |                          |
| エイトレッド            | 2,600  | 2,617.00 | 6,804,200  |                          |
| AOI TYO Holdings  | 13,900 | 636.00   | 8,840,400  | 貸付有価証券<br>6,300株         |
| マクロミル             | 28,100 | 875.00   | 24,587,500 |                          |
| ビーグリー             | 2,700  | 1,404.00 | 3,790,800  | 貸付有価証券<br>1,300株（300株）   |
| オロ                | 4,300  | 3,760.00 | 16,168,000 |                          |
| ユーザーローカル          | 2,100  | 4,700.00 | 9,870,000  |                          |
| テモナ               | 3,000  | 906.00   | 2,718,000  | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| ニーズウェル            | 2,800  | 635.00   | 1,778,000  |                          |
| サインポスト            | 3,300  | 932.00   | 3,075,600  |                          |
| ソルクシーズ            | 5,300  | 915.00   | 4,849,500  | 貸付有価証券                   |

|                       |         |          |             |                            |
|-----------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
|                       |         |          |             | 700株                       |
| フェイス                  | 4,200   | 918.00   | 3,855,600   |                            |
| プロトコーポレーション           | 16,400  | 1,189.00 | 19,499,600  |                            |
| ハイマックス                | 3,900   | 1,139.00 | 4,442,100   |                            |
| 野村総合研究所               | 238,900 | 3,380.00 | 807,482,000 |                            |
| サイバネットシステム            | 9,800   | 836.00   | 8,192,800   | 貸付有価証券<br>100株             |
| C Eホールディングス           | 7,300   | 592.00   | 4,321,600   |                            |
| 日本システム技術              | 2,400   | 1,592.00 | 3,820,800   |                            |
| インテージホールディングス         | 17,200  | 1,370.00 | 23,564,000  |                            |
| 東邦システムサイエンス           | 3,600   | 928.00   | 3,340,800   |                            |
| ソースネクスト               | 65,200  | 331.00   | 21,581,200  | 貸付有価証券<br>15,600株（15,600株） |
| インフォコム                | 12,500  | 2,767.00 | 34,587,500  |                            |
| HEROZ                 | 3,900   | 2,783.00 | 10,853,700  |                            |
| ラクスル                  | 14,900  | 4,905.00 | 73,084,500  |                            |
| I P S                 | 3,200   | 2,509.00 | 8,028,800   |                            |
| F I G                 | 14,900  | 286.00   | 4,261,400   |                            |
| システムサポート              | 4,100   | 1,520.00 | 6,232,000   |                            |
| イーソル                  | 7,500   | 1,196.00 | 8,970,000   | 貸付有価証券<br>2,400株           |
| アルテリア・ネットワークス         | 15,200  | 1,587.00 | 24,122,400  |                            |
| E d u L a b           | 1,300   | 6,330.00 | 8,229,000   |                            |
| 東海ソフト                 | 2,100   | 1,227.00 | 2,576,700   |                            |
| ウイングアーク1 s t          | 7,200   | 2,590.00 | 18,648,000  | 貸付有価証券<br>700株             |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング | 3,100   | 2,080.00 | 6,448,000   |                            |
| サーバーワークス              | 1,300   | 4,365.00 | 5,674,500   | 貸付有価証券<br>500株             |
| 東名                    | 1,300   | 1,132.00 | 1,471,600   |                            |
| ヴィッツ                  | 1,300   | 2,073.00 | 2,694,900   | 貸付有価証券<br>200株             |
| トビラシシステムズ             | 1,800   | 1,338.00 | 2,408,400   | 貸付有価証券<br>700株（600株）       |
| S a n s a n           | 12,200  | 8,660.00 | 105,652,000 | 貸付有価証券<br>700株             |
| L i n k - U           | 2,500   | 1,181.00 | 2,952,500   | 貸付有価証券                     |

|                   |           |           |             |                        |
|-------------------|-----------|-----------|-------------|------------------------|
|                   |           |           |             | 300株（100株）             |
| ギフトィ              | 8,300     | 3,140.00  | 26,062,000  | 貸付有価証券<br>1,000株（700株） |
| ベース               | 1,600     | 6,070.00  | 9,712,000   |                        |
| フォーカスシステムズ        | 9,200     | 929.00    | 8,546,800   |                        |
| クレスコ              | 9,000     | 1,697.00  | 15,273,000  |                        |
| フジ・メディア・ホールディングス  | 142,700   | 1,340.00  | 191,218,000 | 貸付有価証券<br>300株         |
| オービック             | 43,400    | 19,960.00 | 866,264,000 | 貸付有価証券<br>800株         |
| ジャストシステム          | 19,600    | 6,500.00  | 127,400,000 | 貸付有価証券<br>400株         |
| TDCソフト            | 12,000    | 1,053.00  | 12,636,000  |                        |
| Zホールディングス         | 1,889,800 | 475.20    | 898,032,960 |                        |
| トレンドマイクロ          | 73,500    | 5,350.00  | 393,225,000 | 貸付有価証券<br>100株         |
| IDホールディングス        | 5,200     | 1,365.00  | 7,098,000   |                        |
| 日本オラクル            | 27,900    | 10,850.00 | 302,715,000 |                        |
| アルファシステムズ         | 3,700     | 3,640.00  | 13,468,000  |                        |
| フューチャー            | 16,600    | 2,104.00  | 34,926,400  |                        |
| CAC Holdings      | 8,900     | 1,426.00  | 12,691,400  |                        |
| SBテクノロジー          | 4,900     | 3,160.00  | 15,484,000  | 貸付有価証券<br>100株         |
| トーセ               | 3,700     | 801.00    | 2,963,700   |                        |
| オービックビジネスコンサルティング | 14,100    | 6,340.00  | 89,394,000  |                        |
| 伊藤忠テクノソリューションズ    | 62,700    | 3,825.00  | 239,827,500 |                        |
| アイティフォー           | 17,900    | 793.00    | 14,194,700  |                        |
| 東計電算              | 2,000     | 4,330.00  | 8,660,000   |                        |
| エックスネット           | 2,200     | 1,020.00  | 2,244,000   |                        |
| 大塚商会              | 74,400    | 5,660.00  | 421,104,000 |                        |
| サイボウズ             | 16,100    | 2,357.00  | 37,947,700  | 貸付有価証券<br>600株         |
| 電通国際情報サービス        | 17,000    | 4,015.00  | 68,255,000  |                        |
| ACCESS            | 17,200    | 892.00    | 15,342,400  | 貸付有価証券<br>100株         |
| デジタルガレージ          | 22,700    | 4,605.00  | 104,533,500 |                        |
| EMシステムズ           | 22,700    | 825.00    | 18,727,500  |                        |



|                            |         |          |             |                          |
|----------------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| ウェザーニューズ                   | 4,100   | 5,420.00 | 22,222,000  | 貸付有価証券<br>2,400株         |
| C I J                      | 9,400   | 869.00   | 8,168,600   |                          |
| ビジネスエンジニアリン<br>グ           | 1,400   | 3,495.00 | 4,893,000   |                          |
| 日本エンタープライズ                 | 14,000  | 228.00   | 3,192,000   |                          |
| WOWOW                      | 6,600   | 2,705.00 | 17,853,000  |                          |
| スカラ                        | 12,200  | 759.00   | 9,259,800   | 貸付有価証券<br>200株           |
| インテリジェント ウェ<br>イブ          | 8,000   | 680.00   | 5,440,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| I M A G I C A G R O<br>U P | 11,700  | 503.00   | 5,885,100   |                          |
| ネットワンシステムズ                 | 56,100  | 3,405.00 | 191,020,500 | 貸付有価証券<br>500株           |
| システムソフト                    | 28,400  | 163.00   | 4,629,200   | 貸付有価証券<br>8,200株（1,900株） |
| アルゴグラフィックス                 | 10,700  | 3,075.00 | 32,902,500  |                          |
| マーベラス                      | 21,700  | 821.00   | 17,815,700  |                          |
| エイベックス                     | 23,700  | 1,501.00 | 35,573,700  | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| 日本ユニシス                     | 47,700  | 3,560.00 | 169,812,000 |                          |
| 兼松エレクトロニクス                 | 7,500   | 3,760.00 | 28,200,000  |                          |
| 都築電気                       | 6,100   | 1,833.00 | 11,181,300  | 貸付有価証券<br>100株           |
| T B Sホールディングス              | 91,200  | 2,185.00 | 199,272,000 |                          |
| 日本テレビホールディン<br>グス          | 114,800 | 1,441.00 | 165,426,800 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 朝日放送グループホール<br>ディングス       | 13,700  | 706.00   | 9,672,200   |                          |
| テレビ朝日ホールディン<br>グス          | 42,500  | 2,011.00 | 85,467,500  | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| スカパー J S A Tホール<br>ディングス   | 90,500  | 464.00   | 41,992,000  | 貸付有価証券<br>300株           |
| テレビ東京ホールディン<br>グス          | 9,800   | 2,282.00 | 22,363,600  |                          |
| 日本 B S 放送                  | 4,600   | 1,094.00 | 5,032,400   | 貸付有価証券<br>100株           |
| ビジョン                       | 17,100  | 1,070.00 | 18,297,000  |                          |
| スマートバリュー                   | 3,600   | 870.00   | 3,132,000   |                          |

|                          |           |           |               |                            |
|--------------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| USEN-NEXT HOLDINGS       | 13,100    | 2,113.00  | 27,680,300    | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| ワイヤレスゲート                 | 5,600     | 467.00    | 2,615,200     |                            |
| コネクシオ                    | 7,800     | 1,474.00  | 11,497,200    |                            |
| 日本通信                     | 121,500   | 222.00    | 26,973,000    | 貸付有価証券<br>22,200株（22,200株） |
| クロップス                    | 2,500     | 896.00    | 2,240,000     |                            |
| 日本電信電話                   | 1,609,000 | 2,854.00  | 4,592,086,000 |                            |
| KDDI                     | 1,103,200 | 3,440.00  | 3,795,008,000 | 貸付有価証券<br>500株             |
| ソフトバンク                   | 1,250,100 | 1,449.00  | 1,811,394,900 | 貸付有価証券<br>1,300株           |
| 光通信                      | 16,200    | 22,180.00 | 359,316,000   |                            |
| エムティーアイ                  | 13,300    | 776.00    | 10,320,800    |                            |
| GMOインターネット               | 48,700    | 3,160.00  | 153,892,000   |                            |
| ファイバーゲート                 | 4,500     | 1,571.00  | 7,069,500     | 貸付有価証券<br>800株（800株）       |
| アイドママーケティング<br>コミュニケーション | 3,500     | 413.00    | 1,445,500     |                            |
| KADOKAWA                 | 35,600    | 3,920.00  | 139,552,000   | 貸付有価証券<br>100株             |
| 学研ホールディングス               | 19,400    | 1,407.00  | 27,295,800    |                            |
| ゼンリン                     | 24,900    | 1,162.00  | 28,933,800    |                            |
| 昭文社ホールディングス              | 5,500     | 477.00    | 2,623,500     |                            |
| インプレスホールディング<br>ス        | 11,400    | 240.00    | 2,736,000     |                            |
| アイネット                    | 7,100     | 1,477.00  | 10,486,700    |                            |
| 松竹                       | 9,100     | 12,430.00 | 113,113,000   | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| 東宝                       | 81,200    | 4,410.00  | 358,092,000   |                            |
| 東映                       | 4,500     | 25,090.00 | 112,905,000   |                            |
| エヌ・ティ・ティ・デー<br>タ         | 366,300   | 1,751.00  | 641,391,300   |                            |
| ピー・シー・エー                 | 2,000     | 4,440.00  | 8,880,000     | 貸付有価証券<br>300株             |
| ビジネスブレイン太田昭<br>和         | 4,700     | 1,814.00  | 8,525,800     |                            |
| DTS                      | 28,500    | 2,610.00  | 74,385,000    |                            |
| スクウェア・エニックス<br>・ホールディングス | 58,700    | 6,130.00  | 359,831,000   |                            |

|                      |           |           |                |                          |
|----------------------|-----------|-----------|----------------|--------------------------|
| シーイーシー               | 14,700    | 1,394.00  | 20,491,800     |                          |
| カプコン                 | 117,900   | 3,360.00  | 396,144,000    | 貸付有価証券<br>800株           |
| アイ・エス・ビー             | 6,300     | 1,353.00  | 8,523,900      | 貸付有価証券<br>100株           |
| ジャステック               | 8,800     | 1,286.00  | 11,316,800     | 貸付有価証券<br>300株           |
| S C S K              | 31,700    | 6,330.00  | 200,661,000    |                          |
| 日本システムウエア            | 4,500     | 2,215.00  | 9,967,500      |                          |
| アイネス                 | 13,500    | 1,436.00  | 19,386,000     |                          |
| T K C                | 23,300    | 3,590.00  | 83,647,000     | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株） |
| 富士ソフト                | 14,700    | 5,520.00  | 81,144,000     | 貸付有価証券<br>8,100株         |
| N S D                | 44,200    | 1,810.00  | 80,002,000     |                          |
| コナミホールディングス          | 50,000    | 6,740.00  | 337,000,000    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 福井コンピュータホール<br>ディングス | 6,300     | 4,140.00  | 26,082,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| J B C Cホールディング<br>ス  | 9,300     | 1,387.00  | 12,899,100     |                          |
| ミロク情報サービス            | 13,600    | 1,868.00  | 25,404,800     | 貸付有価証券<br>400株           |
| ソフトバンクグループ           | 1,091,500 | 10,170.00 | 11,100,555,000 | 貸付有価証券<br>3,300株         |
| ハウスイ                 | 1,100     | 986.00    | 1,084,600      |                          |
| 高千穂交易                | 5,300     | 1,121.00  | 5,941,300      | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| オルバヘルスケアホール<br>ディングス | 2,200     | 1,723.00  | 3,790,600      |                          |
| 伊藤忠食品                | 3,300     | 5,090.00  | 16,797,000     |                          |
| エレマテック               | 11,000    | 1,215.00  | 13,365,000     | 貸付有価証券<br>400株           |
| J A L U X            | 3,900     | 1,633.00  | 6,368,700      |                          |
| あらた                  | 11,000    | 4,600.00  | 50,600,000     |                          |
| トーメンデバイス             | 1,800     | 4,160.00  | 7,488,000      |                          |
| 東京エレクトロン デバ<br>イス    | 4,500     | 6,610.00  | 29,745,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| フィールズ                | 12,100    | 525.00    | 6,352,500      |                          |
| 双日                   | 762,600   | 343.00    | 261,571,800    |                          |

|                     |         |          |             |                      |
|---------------------|---------|----------|-------------|----------------------|
| アルフレッサ ホールディングス     | 143,200 | 2,048.00 | 293,273,600 |                      |
| 横浜冷凍                | 38,700  | 895.00   | 34,636,500  |                      |
| 神栄                  | 1,900   | 1,324.00 | 2,515,600   | 貸付有価証券<br>700株       |
| ラサ商事                | 7,300   | 903.00   | 6,591,900   |                      |
| アルコニックス             | 14,700  | 1,649.00 | 24,240,300  |                      |
| 神戸物産                | 95,300  | 2,916.00 | 277,894,800 | 貸付有価証券<br>300株       |
| ハイパー                | 2,800   | 559.00   | 1,565,200   |                      |
| あい ホールディングス         | 19,700  | 2,242.00 | 44,167,400  |                      |
| ディーブイエックス           | 4,200   | 980.00   | 4,116,000   |                      |
| ダイワボウホールディングス       | 62,900  | 1,815.00 | 114,163,500 |                      |
| マクニカ・富士エレホールディングス   | 32,900  | 2,331.00 | 76,689,900  |                      |
| ラクト・ジャパン            | 6,000   | 2,893.00 | 17,358,000  | 貸付有価証券<br>100株       |
| グリムス                | 4,100   | 1,845.00 | 7,564,500   |                      |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 24,000  | 737.00   | 17,688,000  |                      |
| 八洲電機                | 10,700  | 971.00   | 10,389,700  |                      |
| メディアスホールディングス       | 7,800   | 982.00   | 7,659,600   |                      |
| レスターホールディングス        | 14,400  | 2,037.00 | 29,332,800  |                      |
| ジュテックホールディングス       | 3,100   | 1,000.00 | 3,100,000   |                      |
| 大光                  | 5,300   | 704.00   | 3,731,200   | 貸付有価証券<br>2,600株     |
| OCHIホールディングス        | 4,000   | 1,295.00 | 5,180,000   |                      |
| TOKAIホールディングス       | 66,900  | 916.00   | 61,280,400  |                      |
| 黒谷                  | 3,700   | 1,202.00 | 4,447,400   |                      |
| Cominix             | 2,400   | 772.00   | 1,852,800   |                      |
| 三洋貿易                | 13,900  | 1,120.00 | 15,568,000  |                      |
| ビューティガレージ           | 2,200   | 3,615.00 | 7,953,000   | 貸付有価証券<br>900株（100株） |
| ウイン・パートナーズ          | 10,000  | 1,014.00 | 10,140,000  |                      |

|                  |         |           |             |                          |
|------------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| ミタチ産業            | 3,800   | 689.00    | 2,618,200   |                          |
| シップヘルスケアホールディングス | 48,700  | 2,935.00  | 142,934,500 | 貸付有価証券<br>1,600株（1,400株） |
| 明治電機工業           | 4,700   | 1,408.00  | 6,617,600   |                          |
| デリカフーズホールディングス   | 5,300   | 629.00    | 3,333,700   |                          |
| スターティアホールディングス   | 2,700   | 1,115.00  | 3,010,500   | 貸付有価証券<br>300株           |
| コメダホールディングス      | 30,100  | 2,052.00  | 61,765,200  |                          |
| ピーバンドットコム        | 1,900   | 807.00    | 1,533,300   | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| アセンテック           | 3,500   | 1,464.00  | 5,124,000   | 貸付有価証券<br>400株           |
| 富士興産             | 4,200   | 1,296.00  | 5,443,200   |                          |
| 協栄産業             | 1,500   | 1,375.00  | 2,062,500   |                          |
| 小野建              | 12,400  | 1,390.00  | 17,236,000  | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |
| 南陽               | 2,800   | 1,801.00  | 5,042,800   |                          |
| 佐島電機             | 8,600   | 804.00    | 6,914,400   | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| エコートレーディング       | 2,900   | 606.00    | 1,757,400   |                          |
| 伯東               | 8,400   | 1,544.00  | 12,969,600  |                          |
| コンドーテック          | 10,700  | 1,031.00  | 11,031,700  |                          |
| 中山福              | 7,900   | 475.00    | 3,752,500   |                          |
| ナガイレーベン          | 18,300  | 2,574.00  | 47,104,200  |                          |
| 三菱食品             | 15,200  | 3,050.00  | 46,360,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| 松田産業             | 10,100  | 2,372.00  | 23,957,200  |                          |
| 第一興商             | 27,400  | 4,250.00  | 116,450,000 |                          |
| メディパルホールディングス    | 138,400 | 2,115.00  | 292,716,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| S P K            | 5,900   | 1,323.00  | 7,805,700   |                          |
| 萩原電気ホールディングス     | 5,100   | 2,669.00  | 13,611,900  |                          |
| アズワン             | 9,900   | 13,910.00 | 137,709,000 |                          |
| スズデン             | 4,800   | 1,346.00  | 6,460,800   |                          |
| 尾家産業             | 4,000   | 1,227.00  | 4,908,000   |                          |
| シモジマ             | 8,400   | 1,162.00  | 9,760,800   |                          |
| ドウシシャ            | 13,000  | 1,884.00  | 24,492,000  |                          |

|              |           |          |               |                          |
|--------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| 小津産業         | 3,000     | 2,151.00 | 6,453,000     | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| 高速           | 7,300     | 1,457.00 | 10,636,100    |                          |
| たけびし         | 4,800     | 1,488.00 | 7,142,400     |                          |
| リックス         | 3,100     | 1,505.00 | 4,665,500     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 丸文           | 12,200    | 524.00   | 6,392,800     |                          |
| ハピネット        | 11,500    | 1,521.00 | 17,491,500    | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株） |
| 橋本総業ホールディングス | 2,800     | 2,622.00 | 7,341,600     |                          |
| 日本ライフライン     | 44,600    | 1,489.00 | 66,409,400    | 貸付有価証券<br>300株           |
| タカショー        | 8,900     | 762.00   | 6,781,800     | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| マルカ          | 4,500     | 2,150.00 | 9,675,000     |                          |
| I DOM        | 46,500    | 619.00   | 28,783,500    |                          |
| 進和           | 8,200     | 2,084.00 | 17,088,800    |                          |
| エスケイジャパン     | 3,300     | 456.00   | 1,504,800     | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| ダイトロン        | 5,800     | 2,043.00 | 11,849,400    |                          |
| シークス         | 17,500    | 1,555.00 | 27,212,500    |                          |
| 田中商事         | 4,200     | 667.00   | 2,801,400     |                          |
| オーハシテクニカ     | 7,100     | 1,487.00 | 10,557,700    |                          |
| 白銅           | 4,900     | 1,822.00 | 8,927,800     |                          |
| ダイコー通産       | 1,600     | 1,795.00 | 2,872,000     |                          |
| 伊藤忠商事        | 965,700   | 3,564.00 | 3,441,754,800 | 貸付有価証券<br>200株           |
| 丸紅           | 1,361,600 | 992.60   | 1,351,524,160 |                          |
| 高島           | 2,200     | 1,780.00 | 3,916,000     |                          |
| 長瀬産業         | 75,800    | 1,706.00 | 129,314,800   |                          |
| 蝶理           | 8,800     | 1,552.00 | 13,657,600    |                          |
| 豊田通商         | 138,700   | 5,110.00 | 708,757,000   |                          |
| 三共生興         | 20,900    | 527.00   | 11,014,300    |                          |
| 兼松           | 55,200    | 1,514.00 | 83,572,800    |                          |
| ツカモトコーポレーション | 2,300     | 1,396.00 | 3,210,800     |                          |
| 三井物産         | 1,121,000 | 2,539.50 | 2,846,779,500 | 貸付有価証券<br>200株           |

|                     |         |          |               |                          |
|---------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 日本紙パルプ商事            | 7,200   | 3,670.00 | 26,424,000    |                          |
| カメイ                 | 18,000  | 1,165.00 | 20,970,000    |                          |
| 東都水産                | 1,600   | 4,255.00 | 6,808,000     | 貸付有価証券<br>400株           |
| ＯＵＧホールディングス         | 2,200   | 2,798.00 | 6,155,600     |                          |
| スターゼン               | 10,200  | 2,288.00 | 23,337,600    |                          |
| 山善                  | 53,900  | 1,025.00 | 55,247,500    | 貸付有価証券<br>3,000株（3,000株） |
| 椿本興業                | 2,500   | 3,565.00 | 8,912,500     |                          |
| 住友商事                | 871,400 | 1,560.00 | 1,359,384,000 |                          |
| 内田洋行                | 5,900   | 4,870.00 | 28,733,000    |                          |
| 三菱商事                | 840,600 | 3,011.00 | 2,531,046,600 | 貸付有価証券<br>200株           |
| 第一実業                | 6,300   | 4,210.00 | 26,523,000    |                          |
| キヤノンマーケティング<br>ジャパン | 34,200  | 2,602.00 | 88,988,400    |                          |
| 西華産業                | 7,300   | 1,720.00 | 12,556,000    |                          |
| 佐藤商事                | 11,400  | 1,091.00 | 12,437,400    |                          |
| 菱洋エレクトロ             | 10,500  | 2,719.00 | 28,549,500    |                          |
| 東京産業                | 12,500  | 636.00   | 7,950,000     |                          |
| ユアサ商事               | 14,100  | 3,135.00 | 44,203,500    |                          |
| 神鋼商事                | 3,100   | 2,549.00 | 7,901,900     |                          |
| トルク                 | 8,200   | 253.00   | 2,074,600     |                          |
| 阪和興業                | 27,600  | 3,605.00 | 99,498,000    |                          |
| 正栄食品工業              | 8,900   | 4,115.00 | 36,623,500    |                          |
| カナデン                | 11,200  | 1,170.00 | 13,104,000    |                          |
| 菱電商事                | 9,900   | 1,684.00 | 16,671,600    |                          |
| フルサト工業              | 7,000   | 1,641.00 | 11,487,000    |                          |
| 岩谷産業                | 33,100  | 7,220.00 | 238,982,000   |                          |
| ナイス                 | 5,500   | 2,015.00 | 11,082,500    |                          |
| 昭光通商                | 2,900   | 793.00   | 2,299,700     | 貸付有価証券<br>1,800株         |
| ニチモウ                | 2,100   | 1,981.00 | 4,160,100     |                          |
| 極東貿易                | 4,000   | 1,407.00 | 5,628,000     |                          |
| イワキ                 | 18,400  | 759.00   | 13,965,600    |                          |
| 三愛石油                | 34,000  | 1,272.00 | 43,248,000    |                          |
| 稲畑産業                | 33,200  | 1,665.00 | 55,278,000    |                          |
| G S I クレオス          | 6,800   | 1,225.00 | 8,330,000     |                          |

|                         |        |          |             |                  |
|-------------------------|--------|----------|-------------|------------------|
| 明和産業                    | 12,700 | 489.00   | 6,210,300   |                  |
| クワザワホールディングス            | 4,900  | 598.00   | 2,930,200   |                  |
| ヤマエ久野                   | 10,100 | 1,090.00 | 11,009,000  |                  |
| ワキタ                     | 27,200 | 1,100.00 | 29,920,000  |                  |
| 東邦ホールディングス              | 44,300 | 1,917.00 | 84,923,100  |                  |
| サンゲツ                    | 37,300 | 1,630.00 | 60,799,000  |                  |
| ミツウロコグループホールディングス       | 20,300 | 1,358.00 | 27,567,400  |                  |
| シナネンホールディングス            | 5,100  | 3,065.00 | 15,631,500  |                  |
| 伊藤忠エネクス                 | 30,500 | 1,094.00 | 33,367,000  |                  |
| サンリオ                    | 38,800 | 1,754.00 | 68,055,200  | 貸付有価証券<br>100株   |
| サンワテクノス                 | 9,100  | 1,283.00 | 11,675,300  |                  |
| リョーサン                   | 15,200 | 2,278.00 | 34,625,600  |                  |
| 新光商事                    | 18,600 | 762.00   | 14,173,200  |                  |
| トーホー                    | 6,200  | 1,747.00 | 10,831,400  |                  |
| 三信電気                    | 7,400  | 2,049.00 | 15,162,600  |                  |
| 東陽テクニカ                  | 13,600 | 1,114.00 | 15,150,400  |                  |
| モスフードサービス               | 19,500 | 3,075.00 | 59,962,500  |                  |
| 加賀電子                    | 12,500 | 2,488.00 | 31,100,000  |                  |
| ソーダニッカ                  | 13,100 | 593.00   | 7,768,300   |                  |
| 立花エレテック                 | 10,200 | 1,599.00 | 16,309,800  | 貸付有価証券<br>3,500株 |
| フォーバル                   | 4,800  | 817.00   | 3,921,600   |                  |
| PAL TAC                 | 22,100 | 5,480.00 | 121,108,000 |                  |
| 三谷産業                    | 18,100 | 417.00   | 7,547,700   | 貸付有価証券<br>400株   |
| 太平洋興発                   | 5,400  | 693.00   | 3,742,200   |                  |
| 西本Wismettac<br>ホールディングス | 3,100  | 2,696.00 | 8,357,600   |                  |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス       | 1,200  | 2,211.00 | 2,653,200   |                  |
| コーア商事ホールディングス           | 10,300 | 816.00   | 8,404,800   | 貸付有価証券<br>4,000株 |
| 国際紙パルプ商事                | 29,400 | 247.00   | 7,261,800   |                  |
| ヤマタネ                    | 5,900  | 1,489.00 | 8,785,100   |                  |
| 丸紅建材リース                 | 1,300  | 1,870.00 | 2,431,000   |                  |



|               |         |          |             |                  |
|---------------|---------|----------|-------------|------------------|
| 日鉄物産          | 9,800   | 4,685.00 | 45,913,000  |                  |
| 泉州電業          | 3,900   | 3,480.00 | 13,572,000  |                  |
| トラスコ中山        | 31,600  | 3,015.00 | 95,274,000  |                  |
| オートバックスセブン    | 51,200  | 1,495.00 | 76,544,000  |                  |
| モリト           | 10,100  | 614.00   | 6,201,400   |                  |
| 加藤産業          | 19,900  | 3,305.00 | 65,769,500  | 貸付有価証券<br>200株   |
| 北恵            | 3,500   | 942.00   | 3,297,000   |                  |
| イノテック         | 7,800   | 1,342.00 | 10,467,600  |                  |
| イエローハット       | 26,100  | 1,937.00 | 50,555,700  |                  |
| J Kホールディングス   | 12,500  | 849.00   | 10,612,500  | 貸付有価証券<br>7,800株 |
| 日伝            | 11,400  | 2,083.00 | 23,746,200  |                  |
| 北沢産業          | 9,300   | 257.00   | 2,390,100   |                  |
| 杉本商事          | 6,900   | 2,268.00 | 15,649,200  |                  |
| 因幡電機産業        | 36,800  | 2,617.00 | 96,305,600  |                  |
| 東テク           | 4,600   | 2,985.00 | 13,731,000  |                  |
| ミスミグループ本社     | 173,200 | 3,470.00 | 601,004,000 |                  |
| アルテック         | 10,100  | 325.00   | 3,282,500   |                  |
| タキヒヨー         | 4,600   | 1,859.00 | 8,551,400   |                  |
| 蔵王産業          | 2,700   | 1,432.00 | 3,866,400   |                  |
| スズケン          | 58,500  | 4,085.00 | 238,972,500 | 貸付有価証券<br>300株   |
| ジェコス          | 9,500   | 918.00   | 8,721,000   |                  |
| グローセル         | 15,000  | 431.00   | 6,465,000   |                  |
| ローソン          | 34,900  | 5,100.00 | 177,990,000 |                  |
| サンエー          | 10,400  | 4,310.00 | 44,824,000  |                  |
| カワチ薬品         | 9,600   | 2,396.00 | 23,001,600  |                  |
| エービーシー・マート    | 21,600  | 5,990.00 | 129,384,000 | 貸付有価証券<br>100株   |
| ハードオフコーポレーション | 6,100   | 795.00   | 4,849,500   |                  |
| アスクル          | 11,200  | 3,875.00 | 43,400,000  |                  |
| ゲオホールディングス    | 18,500  | 1,208.00 | 22,348,000  | 貸付有価証券<br>1,600株 |
| アダストリア        | 19,100  | 1,888.00 | 36,060,800  |                  |
| ジーフット         | 8,300   | 412.00   | 3,419,600   | 貸付有価証券<br>3,800株 |

|                     |         |          |             |                            |
|---------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| シー・ヴィ・エス・ベイ<br>エリア  | 2,000   | 396.00   | 792,000     |                            |
| くら寿司                | 16,200  | 3,900.00 | 63,180,000  | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| キャンドウ               | 6,600   | 2,168.00 | 14,308,800  | 貸付有価証券<br>3,300株（1,000株）   |
| アイケイ                | 4,000   | 826.00   | 3,304,000   |                            |
| パルグループホールディ<br>ングス  | 12,100  | 1,592.00 | 19,263,200  |                            |
| エディオン               | 58,500  | 1,188.00 | 69,498,000  | 貸付有価証券<br>13,400株（10,400株） |
| サーラコーポレーション         | 28,000  | 618.00   | 17,304,000  |                            |
| ワッツ                 | 6,700   | 902.00   | 6,043,400   |                            |
| ハローズ                | 5,500   | 3,010.00 | 16,555,000  | 貸付有価証券<br>800株（800株）       |
| フジオフードグループ本<br>社    | 11,600  | 1,447.00 | 16,785,200  | 貸付有価証券<br>5,200株           |
| あみやき亭               | 3,000   | 2,864.00 | 8,592,000   |                            |
| ひらまつ                | 25,400  | 162.00   | 4,114,800   | 貸付有価証券<br>4,700株（1,200株）   |
| 大黒天物産               | 4,400   | 8,690.00 | 38,236,000  | 貸付有価証券<br>1,900株           |
| ハニーズホールディング<br>ス    | 10,900  | 1,076.00 | 11,728,400  | 貸付有価証券<br>5,500株           |
| ファーマライズホール<br>ディングス | 3,300   | 782.00   | 2,580,600   |                            |
| アルペン                | 10,600  | 2,508.00 | 26,584,800  | 貸付有価証券<br>4,700株           |
| ハブ                  | 4,400   | 655.00   | 2,882,000   | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株）   |
| クオールホールディング<br>ス    | 18,600  | 1,364.00 | 25,370,400  |                            |
| ジンスホールディングス         | 9,400   | 7,800.00 | 73,320,000  | 貸付有価証券<br>300株             |
| ビックカメラ              | 81,900  | 1,145.00 | 93,775,500  | 貸付有価証券<br>1,700株           |
| DCMホールディングス         | 85,200  | 1,091.00 | 92,953,200  |                            |
| Monotaro            | 196,400 | 2,550.00 | 500,820,000 | 貸付有価証券<br>6,900株（6,600株）   |
| 東京一番フーズ             | 3,500   | 584.00   | 2,044,000   |                            |
| DDホールディングス          | 6,600   | 541.00   | 3,570,600   | 貸付有価証券                     |

|                        |         |          |             |                          |
|------------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
|                        |         |          |             | 3,500株（100株）             |
| きちりホールディングス            | 3,700   | 576.00   | 2,131,200   |                          |
| アークランドサービス<br>ホールディングス | 11,500  | 2,287.00 | 26,300,500  | 貸付有価証券<br>5,200株         |
| J. フロント リテイリ<br>ング     | 164,900 | 1,050.00 | 173,145,000 |                          |
| ドトール・日レスホール<br>ディングス   | 21,800  | 1,649.00 | 35,948,200  |                          |
| マツモトキヨシホール<br>ディングス    | 57,100  | 4,455.00 | 254,380,500 | 貸付有価証券<br>100株           |
| ブロンコビリー                | 7,200   | 2,435.00 | 17,532,000  | 貸付有価証券<br>3,600株         |
| Z O Z O                | 81,400  | 3,595.00 | 292,633,000 |                          |
| トレジャー・ファクト<br>リー       | 4,000   | 1,160.00 | 4,640,000   |                          |
| 物語コーポレーション             | 7,400   | 6,650.00 | 49,210,000  |                          |
| ココカラファイン               | 12,300  | 7,550.00 | 92,865,000  | 貸付有価証券<br>6,200株         |
| 三越伊勢丹ホールディン<br>グス      | 241,600 | 784.00   | 189,414,400 | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| H a m e e              | 3,500   | 1,583.00 | 5,540,500   | 貸付有価証券<br>1,600株（700株）   |
| マーケットエンタープラ<br>イズ      | 900     | 1,524.00 | 1,371,600   | 貸付有価証券<br>400株           |
| ウエルシアホールディン<br>グス      | 73,000  | 3,475.00 | 253,675,000 |                          |
| クリエイト S D ホール<br>ディングス | 20,400  | 3,400.00 | 69,360,000  | 貸付有価証券<br>9,500株         |
| 丸善 C H I ホールディン<br>グス  | 16,100  | 393.00   | 6,327,300   | 貸付有価証券<br>8,100株         |
| ミサワ                    | 2,800   | 688.00   | 1,926,400   |                          |
| ティーライフ                 | 1,800   | 1,358.00 | 2,444,400   |                          |
| エー・ピーホールディン<br>グス      | 2,600   | 432.00   | 1,123,200   |                          |
| チムニー                   | 4,200   | 1,255.00 | 5,271,000   | 貸付有価証券<br>800株           |
| シュッピン                  | 9,400   | 1,122.00 | 10,546,800  |                          |
| オイシックス・ラ・大地            | 18,200  | 3,050.00 | 55,510,000  | 貸付有価証券<br>3,500株（3,500株） |
| ネクステージ                 | 24,300  | 1,762.00 | 42,816,600  |                          |
| ジョイフル本田                | 40,400  | 1,365.00 | 55,146,000  |                          |

|                      |         |           |               |                           |
|----------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| 鳥貴族ホールディングス          | 5,100   | 1,632.00  | 8,323,200     | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| ホットランド               | 10,300  | 1,369.00  | 14,100,700    | 貸付有価証券<br>3,900株（300株）    |
| すかいらーくホールディングス       | 154,700 | 1,642.00  | 254,017,400   | 貸付有価証券<br>79,900株         |
| S F Pホールディングス        | 6,700   | 1,324.00  | 8,870,800     | 貸付有価証券<br>3,000株          |
| 綿半ホールディングス           | 10,300  | 1,305.00  | 13,441,500    |                           |
| ヨシックス                | 2,700   | 2,009.00  | 5,424,300     |                           |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 40,100  | 1,107.00  | 44,390,700    | 貸付有価証券<br>800株            |
| ゴルフダイジェスト・オンライン      | 7,200   | 1,492.00  | 10,742,400    | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| BEENOS               | 7,000   | 3,490.00  | 24,430,000    |                           |
| あさひ                  | 10,300  | 1,490.00  | 15,347,000    | 貸付有価証券<br>5,600株（300株）    |
| 日本調剤                 | 8,400   | 1,770.00  | 14,868,000    |                           |
| コスモス薬品               | 13,900  | 15,790.00 | 219,481,000   |                           |
| トーエル                 | 6,700   | 842.00    | 5,641,400     | 貸付有価証券<br>3,300株          |
| オンリー                 | 2,300   | 465.00    | 1,069,500     | 貸付有価証券<br>100株            |
| セブン&アイ・ホールディングス      | 540,100 | 4,703.00  | 2,540,090,300 |                           |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 74,200  | 803.00    | 59,582,600    | 貸付有価証券<br>32,600株（1,800株） |
| ツルハホールディングス          | 30,100  | 13,010.00 | 391,601,000   |                           |
| サンマルクホールディングス        | 10,900  | 1,700.00  | 18,530,000    |                           |
| フェリシモ                | 3,100   | 1,340.00  | 4,154,000     |                           |
| トリドールホールディングス        | 34,200  | 1,754.00  | 59,986,800    |                           |
| TOKYO BASE           | 12,400  | 736.00    | 9,126,400     | 貸付有価証券<br>4,100株          |
| ウイルプラスホールディングス       | 2,200   | 1,320.00  | 2,904,000     |                           |
| JMホールディングス           | 9,300   | 2,143.00  | 19,929,900    |                           |
| サツドラホールディングス         | 2,100   | 2,285.00  | 4,798,500     | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| アレンザホールディング          | 10,500  | 1,230.00  | 12,915,000    | 貸付有価証券                    |

| ス                    |         |          |             | 300株                     |
|----------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 串カツ田中ホールディングス        | 3,700   | 1,712.00 | 6,334,400   |                          |
| バロックジャパンリミテッド        | 9,600   | 768.00   | 7,372,800   |                          |
| クスリのアオキホールディングス      | 13,700  | 7,990.00 | 109,463,000 | 貸付有価証券<br>4,200株（200株）   |
| 力の源ホールディングス          | 6,300   | 614.00   | 3,868,200   |                          |
| FOOD & LIFE COMPANIE | 80,800  | 4,725.00 | 381,780,000 |                          |
| メディカルシステムネットワーク      | 12,000  | 715.00   | 8,580,000   |                          |
| はるやまホールディングス         | 6,500   | 669.00   | 4,348,500   |                          |
| ノジマ                  | 24,600  | 3,265.00 | 80,319,000  |                          |
| カップ・クリエイト            | 19,400  | 1,495.00 | 29,003,000  | 貸付有価証券<br>6,300株（300株）   |
| ライトオン                | 10,300  | 705.00   | 7,261,500   | 貸付有価証券<br>3,100株（3,100株） |
| 良品計画                 | 158,900 | 2,336.00 | 371,190,400 | 貸付有価証券<br>200株           |
| 三城ホールディングス           | 17,100  | 283.00   | 4,839,300   |                          |
| アドヴァン                | 14,100  | 975.00   | 13,747,500  |                          |
| アルビス                 | 4,400   | 2,336.00 | 10,278,400  |                          |
| コナカ                  | 16,300  | 341.00   | 5,558,300   | 貸付有価証券<br>100株           |
| ハウス オブ ローゼ           | 1,700   | 1,662.00 | 2,825,400   |                          |
| G-7ホールディングス          | 6,700   | 2,873.00 | 19,249,100  | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| イオン北海道               | 18,200  | 1,130.00 | 20,566,000  |                          |
| コジマ                  | 23,700  | 887.00   | 21,021,900  | 貸付有価証券<br>12,200株        |
| ヒマラヤ                 | 4,800   | 991.00   | 4,756,800   |                          |
| コーナン商事               | 19,600  | 3,070.00 | 60,172,000  | 貸付有価証券<br>100株           |
| エコス                  | 5,100   | 1,878.00 | 9,577,800   |                          |
| ワタミ                  | 18,100  | 984.00   | 17,810,400  | 貸付有価証券<br>2,900株（2,900株） |
| マルシェ                 | 3,600   | 481.00   | 1,731,600   |                          |
| パン・パシフィック・インターナショナルホ | 276,000 | 2,361.00 | 651,636,000 | 貸付有価証券<br>4,100株         |

|                |        |          |             |                           |
|----------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
| 西松屋チェーン        | 30,300 | 1,733.00 | 52,509,900  | 貸付有価証券<br>13,100株（2,100株） |
| ゼンショーホールディングス  | 74,100 | 2,823.00 | 209,184,300 |                           |
| 幸楽苑ホールディングス    | 8,800  | 1,636.00 | 14,396,800  | 貸付有価証券<br>700株（700株）      |
| ハークスレイ         | 2,900  | 914.00   | 2,650,600   |                           |
| サイゼリヤ          | 20,500 | 2,461.00 | 50,450,500  | 貸付有価証券<br>100株            |
| VTホールディングス     | 52,000 | 429.00   | 22,308,000  |                           |
| 魚力             | 4,300  | 1,902.00 | 8,178,600   |                           |
| ポプラ            | 3,600  | 310.00   | 1,116,000   |                           |
| フジ・コーポレーション    | 7,300  | 1,316.00 | 9,606,800   | 貸付有価証券<br>2,000株          |
| ユナイテッドアローズ     | 15,800 | 2,015.00 | 31,837,000  |                           |
| ハイデイ日高         | 19,900 | 1,736.00 | 34,546,400  | 貸付有価証券<br>11,100株         |
| 京都きもの友禅        | 8,800  | 267.00   | 2,349,600   |                           |
| コロワイド          | 45,900 | 1,862.00 | 85,465,800  | 貸付有価証券<br>26,700株（1,600株） |
| ピーシーデポコーポレーション | 16,000 | 465.00   | 7,440,000   | 貸付有価証券<br>1,900株          |
| 壺番屋            | 9,700  | 4,900.00 | 47,530,000  |                           |
| トップカルチャー       | 5,000  | 349.00   | 1,745,000   |                           |
| P L A N T      | 3,500  | 734.00   | 2,569,000   |                           |
| スギホールディングス     | 27,600 | 8,630.00 | 238,188,000 |                           |
| 薬王堂ホールディングス    | 6,000  | 2,406.00 | 14,436,000  |                           |
| スクロール          | 19,700 | 892.00   | 17,572,400  | 貸付有価証券<br>9,900株（3,100株）  |
| ヨンドシーホールディングス  | 12,700 | 1,892.00 | 24,028,400  |                           |
| 木曽路            | 18,000 | 2,280.00 | 41,040,000  |                           |
| S R Sホールディングス  | 17,700 | 830.00   | 14,691,000  | 貸付有価証券<br>7,800株（7,800株）  |
| 千趣会            | 24,900 | 402.00   | 10,009,800  | 貸付有価証券<br>15,900株         |
| タカキュー          | 10,700 | 136.00   | 1,455,200   | 貸付有価証券<br>300株（300株）      |
| リテールパートナーズ     | 16,700 | 1,208.00 | 20,173,600  | 貸付有価証券<br>100株            |

|                      |         |           |               |                           |
|----------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| ケーヨー                 | 25,500  | 723.00    | 18,436,500    |                           |
| 上新電機                 | 15,800  | 2,827.00  | 44,666,600    |                           |
| 日本瓦斯                 | 68,200  | 1,889.00  | 128,829,800   | 貸付有価証券<br>3,600株（3,600株）  |
| ロイヤルホールディングス         | 24,100  | 1,957.00  | 47,163,700    | 貸付有価証券<br>12,200株         |
| 東天紅                  | 1,000   | 1,004.00  | 1,004,000     |                           |
| いなげや                 | 15,400  | 1,569.00  | 24,162,600    |                           |
| チヨダ                  | 14,500  | 893.00    | 12,948,500    |                           |
| ライフコーポレーション          | 14,000  | 3,535.00  | 49,490,000    |                           |
| リンガーハット              | 17,000  | 2,267.00  | 38,539,000    |                           |
| MrMaxHD              | 19,000  | 647.00    | 12,293,000    | 貸付有価証券<br>300株            |
| テンアライド               | 12,700  | 330.00    | 4,191,000     | 貸付有価証券<br>6,200株          |
| AOKIホールディングス         | 27,600  | 639.00    | 17,636,400    |                           |
| オークワ                 | 21,700  | 1,171.00  | 25,410,700    | 貸付有価証券<br>9,400株          |
| コメリ                  | 21,300  | 2,868.00  | 61,088,400    |                           |
| 青山商事                 | 30,700  | 863.00    | 26,494,100    | 貸付有価証券<br>11,600株（5,200株） |
| しまむら                 | 16,100  | 10,990.00 | 176,939,000   |                           |
| はせがわ                 | 7,300   | 292.00    | 2,131,600     |                           |
| 高島屋                  | 100,600 | 1,230.00  | 123,738,000   |                           |
| 松屋                   | 30,200  | 945.00    | 28,539,000    |                           |
| エイチ・ツー・オー リ<br>テイリング | 65,400  | 864.00    | 56,505,600    |                           |
| 近鉄百貨店                | 5,300   | 3,145.00  | 16,668,500    |                           |
| 丸井グループ               | 116,800 | 2,097.00  | 244,929,600   | 貸付有価証券<br>200株            |
| アクシアル リテイリン<br>グ     | 11,500  | 4,245.00  | 48,817,500    |                           |
| 井筒屋                  | 7,000   | 254.00    | 1,778,000     | 貸付有価証券<br>2,000株          |
| イオン                  | 531,300 | 3,088.00  | 1,640,654,400 | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| イズミ                  | 28,100  | 4,375.00  | 122,937,500   |                           |
| 平和堂                  | 25,500  | 2,290.00  | 58,395,000    | 貸付有価証券<br>200株            |

|                    |         |           |               |                            |
|--------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| フジ                 | 16,700  | 2,130.00  | 35,571,000    |                            |
| ヤオコー               | 15,700  | 6,980.00  | 109,586,000   | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| ゼビオホールディングス        | 16,700  | 916.00    | 15,297,200    |                            |
| ケーズホールディングス        | 117,500 | 1,466.00  | 172,255,000   | 貸付有価証券<br>7,000株           |
| O l y m p i c グループ | 7,100   | 782.00    | 5,552,200     | 貸付有価証券<br>2,700株（2,600株）   |
| 日産東京販売ホールディングス     | 20,300  | 247.00    | 5,014,100     |                            |
| シルバーライフ            | 2,800   | 2,559.00  | 7,165,200     |                            |
| 一家ダイニングプロジェクト      | 2,800   | 562.00    | 1,573,600     |                            |
| Genky Drug Stores  | 6,100   | 3,415.00  | 20,831,500    | 貸付有価証券<br>3,000株           |
| ナルミヤ・インターナショナル     | 2,600   | 1,228.00  | 3,192,800     | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| ブックオフグループホールディングス  | 8,000   | 1,006.00  | 8,048,000     | 貸付有価証券<br>4,800株           |
| ギフト                | 1,700   | 2,148.00  | 3,651,600     | 貸付有価証券<br>600株             |
| アインホールディングス        | 20,000  | 6,350.00  | 127,000,000   |                            |
| 元気寿司               | 3,900   | 2,452.00  | 9,562,800     |                            |
| ヤマダホールディングス        | 462,800 | 562.00    | 260,093,600   |                            |
| アークランドサカモト         | 21,600  | 1,547.00  | 33,415,200    |                            |
| ニトリホールディングス        | 54,800  | 19,710.00 | 1,080,108,000 |                            |
| グルメ杵屋              | 9,800   | 960.00    | 9,408,000     |                            |
| 愛眼                 | 11,000  | 227.00    | 2,497,000     |                            |
| ケーユーホールディングス       | 7,200   | 989.00    | 7,120,800     |                            |
| 吉野家ホールディングス        | 45,400  | 2,070.00  | 93,978,000    | 貸付有価証券<br>12,300株（12,200株） |
| 松屋フーズホールディングス      | 6,600   | 3,525.00  | 23,265,000    |                            |
| サガミホールディングス        | 19,300  | 1,039.00  | 20,052,700    | 貸付有価証券<br>10,500株          |
| 関西スーパーマーケット        | 10,400  | 1,037.00  | 10,784,800    |                            |
| 王将フードサービス          | 9,100   | 5,690.00  | 51,779,000    | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| プレナス               | 15,500  | 2,045.00  | 31,697,500    | 貸付有価証券                     |



|                         |         |           |               | 100株                   |
|-------------------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| ミニストップ                  | 10,200  | 1,459.00  | 14,881,800    |                        |
| アークス                    | 26,300  | 2,431.00  | 63,935,300    |                        |
| バローホールディングス             | 28,200  | 2,349.00  | 66,241,800    |                        |
| 藤久                      | 3,200   | 791.00    | 2,531,200     |                        |
| ベルク                     | 6,800   | 5,920.00  | 40,256,000    | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| 大庄                      | 7,400   | 1,004.00  | 7,429,600     | 貸付有価証券<br>1,300株（600株） |
| ファーストリテイリング             | 18,500  | 87,660.00 | 1,621,710,000 |                        |
| サンドラッグ                  | 51,900  | 3,880.00  | 201,372,000   |                        |
| サックスパー ホール<br>ディングス     | 11,700  | 638.00    | 7,464,600     |                        |
| ヤマザワ                    | 3,200   | 1,702.00  | 5,446,400     |                        |
| やまや                     | 2,800   | 2,326.00  | 6,512,800     | 貸付有価証券<br>700株         |
| ベルーナ                    | 29,600  | 1,201.00  | 35,549,600    |                        |
| 島根銀行                    | 4,800   | 724.00    | 3,475,200     |                        |
| じもとホールディングス             | 9,300   | 713.00    | 6,630,900     |                        |
| めぶきフィナンシャルグ<br>ループ      | 718,400 | 249.00    | 178,881,600   |                        |
| 東京きらぼしフィナン<br>シャルグループ   | 17,300  | 1,254.00  | 21,694,200    |                        |
| 九州フィナンシャルグ<br>ループ       | 282,400 | 442.00    | 124,820,800   |                        |
| ゆうちょ銀行                  | 391,700 | 1,042.00  | 408,151,400   | 貸付有価証券<br>173,500株     |
| 富山第一銀行                  | 33,000  | 291.00    | 9,603,000     |                        |
| コンコルディア・フィナ<br>ンシャルグループ | 842,400 | 437.00    | 368,128,800   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 西日本フィナンシャル<br>ホールディングス  | 90,300  | 733.00    | 66,189,900    |                        |
| 三十三フィナンシャルグ<br>ループ      | 12,000  | 1,361.00  | 16,332,000    |                        |
| 第四北越フィナンシャル<br>グループ     | 22,500  | 2,419.00  | 54,427,500    | 貸付有価証券<br>800株         |
| ひろぎんホールディング<br>ス        | 203,900 | 620.00    | 126,418,000   | 貸付有価証券<br>2,600株       |
| 新生銀行                    | 112,700 | 1,623.00  | 182,912,100   | 貸付有価証券<br>200株         |
| あおぞら銀行                  | 82,400  | 2,437.00  | 200,808,800   |                        |

|                   |           |          |               |                    |
|-------------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 9,458,400 | 607.90   | 5,749,761,360 |                    |
| りそなホールディングス       | 1,595,600 | 468.20   | 747,059,920   | 貸付有価証券<br>208,100株 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 261,300   | 3,857.00 | 1,007,834,100 | 貸付有価証券<br>100株     |
| 三井住友フィナンシャルグループ   | 956,900   | 3,970.00 | 3,798,893,000 |                    |
| 千葉銀行              | 461,400   | 716.00   | 330,362,400   | 貸付有価証券<br>4,800株   |
| 群馬銀行              | 284,600   | 378.00   | 107,578,800   | 貸付有価証券<br>900株     |
| 武蔵野銀行             | 20,600    | 1,683.00 | 34,669,800    |                    |
| 千葉興業銀行            | 35,200    | 279.00   | 9,820,800     |                    |
| 筑波銀行              | 57,500    | 177.00   | 10,177,500    |                    |
| 七十七銀行             | 43,400    | 1,436.00 | 62,322,400    |                    |
| 青森銀行              | 10,700    | 2,346.00 | 25,102,200    |                    |
| 秋田銀行              | 8,300     | 1,404.00 | 11,653,200    |                    |
| 山形銀行              | 15,500    | 1,059.00 | 16,414,500    |                    |
| 岩手銀行              | 9,100     | 2,161.00 | 19,665,100    |                    |
| 東邦銀行              | 123,600   | 223.00   | 27,562,800    | 貸付有価証券<br>1,900株   |
| 東北銀行              | 6,600     | 1,064.00 | 7,022,400     |                    |
| みちのく銀行            | 8,900     | 1,025.00 | 9,122,500     |                    |
| ふくおかフィナンシャルグループ   | 124,800   | 1,972.00 | 246,105,600   | 貸付有価証券<br>5,300株   |
| 静岡銀行              | 336,700   | 867.00   | 291,918,900   | 貸付有価証券<br>1,200株   |
| 十六銀行              | 17,300    | 2,093.00 | 36,208,900    |                    |
| スルガ銀行             | 121,200   | 415.00   | 50,298,000    |                    |
| 八十二銀行             | 311,400   | 400.00   | 124,560,000   | 貸付有価証券<br>200株     |
| 山梨中央銀行            | 16,100    | 857.00   | 13,797,700    |                    |
| 大垣共立銀行            | 27,300    | 2,047.00 | 55,883,100    |                    |
| 福井銀行              | 11,800    | 1,770.00 | 20,886,000    |                    |
| 北國銀行              | 12,800    | 2,483.00 | 31,782,400    |                    |
| 清水銀行              | 5,700     | 1,638.00 | 9,336,600     |                    |
| 富山銀行              | 2,700     | 2,791.00 | 7,535,700     |                    |
| 滋賀銀行              | 27,700    | 2,195.00 | 60,801,500    |                    |

|                     |           |          |               |                   |
|---------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| 南都銀行                | 20,100    | 1,880.00 | 37,788,000    |                   |
| 百五銀行                | 124,400   | 330.00   | 41,052,000    | 貸付有価証券<br>200株    |
| 京都銀行                | 49,500    | 6,000.00 | 297,000,000   |                   |
| 紀陽銀行                | 49,000    | 1,500.00 | 73,500,000    |                   |
| ほくほくフィナンシャル<br>グループ | 92,000    | 981.00   | 90,252,000    |                   |
| 山陰合同銀行              | 87,100    | 523.00   | 45,553,300    |                   |
| 中国銀行                | 119,000   | 910.00   | 108,290,000   |                   |
| 鳥取銀行                | 4,400     | 1,147.00 | 5,046,800     |                   |
| 伊予銀行                | 183,200   | 635.00   | 116,332,000   |                   |
| 百十四銀行               | 14,700    | 1,570.00 | 23,079,000    |                   |
| 四国銀行                | 19,600    | 735.00   | 14,406,000    |                   |
| 阿波銀行                | 21,200    | 2,309.00 | 48,950,800    | 貸付有価証券<br>100株    |
| 大分銀行                | 8,000     | 1,940.00 | 15,520,000    |                   |
| 宮崎銀行                | 8,600     | 2,305.00 | 19,823,000    |                   |
| 佐賀銀行                | 7,800     | 1,394.00 | 10,873,200    |                   |
| 沖縄銀行                | 12,700    | 2,757.00 | 35,013,900    |                   |
| 琉球銀行                | 30,000    | 734.00   | 22,020,000    |                   |
| セブン銀行               | 462,000   | 234.00   | 108,108,000   | 貸付有価証券<br>38,700株 |
| みずほフィナンシャルグ<br>ループ  | 1,878,800 | 1,622.50 | 3,048,353,000 | 貸付有価証券<br>300株    |
| 高知銀行                | 5,000     | 829.00   | 4,145,000     |                   |
| 山口フィナンシャルグ<br>ループ   | 172,600   | 674.00   | 116,332,400   |                   |
| 長野銀行                | 4,500     | 1,199.00 | 5,395,500     |                   |
| 名古屋銀行               | 11,100    | 2,811.00 | 31,202,100    |                   |
| 北洋銀行                | 208,400   | 295.00   | 61,478,000    | 貸付有価証券<br>2,700株  |
| 愛知銀行                | 4,600     | 2,928.00 | 13,468,800    |                   |
| 中京銀行                | 5,000     | 1,726.00 | 8,630,000     |                   |
| 大光銀行                | 4,700     | 1,481.00 | 6,960,700     |                   |
| 愛媛銀行                | 19,300    | 936.00   | 18,064,800    |                   |
| トマト銀行               | 5,300     | 1,057.00 | 5,602,100     |                   |
| 京葉銀行                | 59,000    | 435.00   | 25,665,000    |                   |
| 栃木銀行                | 66,800    | 183.00   | 12,224,400    |                   |

|                      |           |          |               |                          |
|----------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| 北日本銀行                | 4,300     | 1,842.00 | 7,920,600     |                          |
| 東和銀行                 | 24,300    | 633.00   | 15,381,900    |                          |
| 福島銀行                 | 15,800    | 236.00   | 3,728,800     | 貸付有価証券<br>3,100株（300株）   |
| 大東銀行                 | 6,600     | 638.00   | 4,210,800     |                          |
| トモニホールディングス          | 106,900   | 309.00   | 33,032,100    |                          |
| フィデアホールディングス         | 134,200   | 131.00   | 17,580,200    |                          |
| 池田泉州ホールディングス         | 159,000   | 178.00   | 28,302,000    | 貸付有価証券<br>300株           |
| F P G                | 46,500    | 742.00   | 34,503,000    |                          |
| ジャパンインベストメントアドバイザー   | 9,300     | 1,685.00 | 15,670,500    | 貸付有価証券<br>1,600株（1,300株） |
| マーキュリアインベストメント       | 5,400     | 808.00   | 4,363,200     |                          |
| S B I ホールディングス       | 170,400   | 3,030.00 | 516,312,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日本アジア投資              | 11,700    | 253.00   | 2,960,100     |                          |
| ジャフコ グループ            | 21,300    | 7,840.00 | 166,992,000   |                          |
| 大和証券グループ本社           | 1,035,500 | 625.10   | 647,291,050   |                          |
| 野村ホールディングス           | 2,111,100 | 580.50   | 1,225,493,550 |                          |
| 岡三証券グループ             | 117,800   | 479.00   | 56,426,200    | 貸付有価証券<br>17,000株        |
| 丸三証券                 | 41,100    | 668.00   | 27,454,800    | 貸付有価証券<br>15,400株        |
| 東洋証券                 | 45,600    | 176.00   | 8,025,600     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 147,400   | 428.00   | 63,087,200    | 貸付有価証券<br>300株           |
| 光世証券                 | 3,300     | 712.00   | 2,349,600     |                          |
| 水戸証券                 | 36,900    | 312.00   | 11,512,800    | 貸付有価証券<br>100株           |
| いちよし証券               | 27,700    | 633.00   | 17,534,100    |                          |
| 松井証券                 | 67,700    | 872.00   | 59,034,400    |                          |
| マネックスグループ            | 124,000   | 918.00   | 113,832,000   | 貸付有価証券<br>6,100株         |
| 極東証券                 | 18,500    | 852.00   | 15,762,000    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 岩井コスモホールディングス        | 14,200    | 1,781.00 | 25,290,200    | 貸付有価証券<br>200株           |

|                      |         |          |               |                      |
|----------------------|---------|----------|---------------|----------------------|
| 藍澤証券                 | 24,800  | 1,044.00 | 25,891,200    |                      |
| マネーパートナーズグループ        | 14,700  | 257.00   | 3,777,900     | 貸付有価証券<br>800株       |
| スパークス・グループ           | 63,900  | 295.00   | 18,850,500    |                      |
| 小林洋行                 | 4,000   | 281.00   | 1,124,000     |                      |
| かんぽ生命保険              | 171,400 | 2,205.00 | 377,937,000   |                      |
| SOMPOホールディングス        | 243,700 | 4,255.00 | 1,036,943,500 | 貸付有価証券<br>1,800株     |
| アニコム ホールディングス        | 38,900  | 1,047.00 | 40,728,300    | 貸付有価証券<br>800株       |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 335,800 | 3,296.00 | 1,106,796,800 | 貸付有価証券<br>200株       |
| 第一生命ホールディングス         | 730,500 | 2,056.50 | 1,502,273,250 | 貸付有価証券<br>11,700株    |
| 東京海上ホールディングス         | 455,400 | 5,472.00 | 2,491,948,800 |                      |
| T&Dホールディングス          | 413,300 | 1,397.00 | 577,380,100   |                      |
| アドバンスクリエイト           | 6,500   | 1,047.00 | 6,805,500     |                      |
| 全国保証                 | 36,000  | 4,935.00 | 177,660,000   | 貸付有価証券<br>10,900株    |
| ジェイリース               | 4,600   | 823.00   | 3,785,800     | 貸付有価証券<br>300株       |
| イントラスト               | 3,900   | 660.00   | 2,574,000     |                      |
| 日本モーゲージサービス          | 7,000   | 1,022.00 | 7,154,000     | 貸付有価証券<br>900株（200株） |
| C a s a              | 3,900   | 928.00   | 3,619,200     | 貸付有価証券<br>1,900株     |
| アルヒ                  | 20,400  | 1,827.00 | 37,270,800    | 貸付有価証券<br>10,300株    |
| プレミアグループ             | 6,400   | 2,411.00 | 15,430,400    |                      |
| クレディセゾン              | 80,700  | 1,298.00 | 104,748,600   |                      |
| 芙蓉総合リース              | 14,500  | 7,540.00 | 109,330,000   |                      |
| みずほリース               | 21,300  | 3,360.00 | 71,568,000    | 貸付有価証券<br>10,800株    |
| 東京センチュリー             | 32,100  | 6,710.00 | 215,391,000   | 貸付有価証券<br>4,500株     |
| 日本証券金融               | 58,500  | 823.00   | 48,145,500    | 貸付有価証券<br>1,700株     |
| アイフル                 | 232,000 | 324.00   | 75,168,000    |                      |
| リコーリース               | 10,900  | 3,495.00 | 38,095,500    | 貸付有価証券               |

|                  |         |          |               |                        |
|------------------|---------|----------|---------------|------------------------|
|                  |         |          |               | 900株                   |
| イオンフィナンシャルサービス   | 84,600  | 1,271.00 | 107,526,600   |                        |
| アコム              | 277,900 | 472.00   | 131,168,800   | 貸付有価証券<br>2,600株       |
| ジャックス            | 15,300  | 2,193.00 | 33,552,900    |                        |
| オリエントコーポレーション    | 374,000 | 148.00   | 55,352,000    |                        |
| オリックス            | 839,400 | 1,821.00 | 1,528,547,400 | 貸付有価証券<br>600株         |
| 三菱HCキャピタル        | 478,200 | 641.00   | 306,526,200   |                        |
| 九州リースサービス        | 6,800   | 679.00   | 4,617,200     | 貸付有価証券<br>1,300株（100株） |
| 日本取引所グループ        | 373,500 | 2,647.50 | 988,841,250   | 貸付有価証券<br>1,300株       |
| イー・ギャランティ        | 15,900  | 2,120.00 | 33,708,000    |                        |
| アサックス            | 7,200   | 695.00   | 5,004,000     | 貸付有価証券<br>4,500株       |
| NECキャピタルソリューション  | 5,600   | 2,071.00 | 11,597,600    |                        |
| いちご              | 154,000 | 349.00   | 53,746,000    | 貸付有価証券<br>100株         |
| 日本駐車場開発          | 151,600 | 159.00   | 24,104,400    |                        |
| スター・マイカ・ホールディングス | 7,100   | 1,110.00 | 7,881,000     |                        |
| SREホールディングス      | 2,000   | 5,010.00 | 10,020,000    |                        |
| ADワークスグループ       | 27,400  | 163.00   | 4,466,200     |                        |
| ヒューリック           | 293,300 | 1,267.00 | 371,611,100   | 貸付有価証券<br>23,600株      |
| 三栄建築設計           | 5,500   | 1,985.00 | 10,917,500    |                        |
| 野村不動産ホールディングス    | 84,000  | 2,818.00 | 236,712,000   |                        |
| 三重交通グループホールディングス | 28,000  | 492.00   | 13,776,000    |                        |
| サムティ             | 19,600  | 2,055.00 | 40,278,000    |                        |
| ディア・ライフ          | 17,800  | 482.00   | 8,579,600     |                        |
| コーセーアールイー        | 4,100   | 621.00   | 2,546,100     | 貸付有価証券<br>500株         |
| 日本商業開発           | 8,800   | 1,743.00 | 15,338,400    | 貸付有価証券<br>4,400株       |
| プレサンスコーポレー       | 22,700  | 1,704.00 | 38,680,800    |                        |

| シヨン              |         |          |               |                  |
|------------------|---------|----------|---------------|------------------|
| ハウスコム            | 2,400   | 1,246.00 | 2,990,400     |                  |
| 日本管理センター         | 7,500   | 1,286.00 | 9,645,000     |                  |
| サンセイランディック       | 4,100   | 849.00   | 3,480,900     |                  |
| エストラスト           | 1,600   | 679.00   | 1,086,400     |                  |
| フージャースホールディングス   | 22,500  | 691.00   | 15,547,500    |                  |
| オープンハウス          | 43,900  | 4,540.00 | 199,306,000   |                  |
| 東急不動産ホールディングス    | 376,000 | 643.00   | 241,768,000   | 貸付有価証券<br>1,300株 |
| 飯田グループホールディングス   | 115,300 | 2,780.00 | 320,534,000   | 貸付有価証券<br>300株   |
| イーグランド           | 2,200   | 942.00   | 2,072,400     |                  |
| ムゲンエステート         | 8,500   | 502.00   | 4,267,000     |                  |
| ビーロット            | 6,500   | 669.00   | 4,348,500     |                  |
| ファーストブラザーズ       | 2,500   | 1,002.00 | 2,505,000     |                  |
| ハウズドゥ            | 6,800   | 1,068.00 | 7,262,400     |                  |
| シーアールイー          | 3,600   | 1,475.00 | 5,310,000     |                  |
| プロパティエージェント      | 2,200   | 2,494.00 | 5,486,800     |                  |
| ケイアイスター不動産       | 4,300   | 3,780.00 | 16,254,000    |                  |
| アグレ都市デザイン        | 2,500   | 1,009.00 | 2,522,500     |                  |
| グッドコムアセット        | 6,600   | 1,470.00 | 9,702,000     | 貸付有価証券<br>2,100株 |
| ジェイ・エス・ビー        | 2,600   | 3,455.00 | 8,983,000     |                  |
| テンポイノベーション       | 3,900   | 886.00   | 3,455,400     | 貸付有価証券<br>1,700株 |
| グローバル・リンク・マネジメント | 2,400   | 915.00   | 2,196,000     |                  |
| フェイスネットワーク       | 1,100   | 1,311.00 | 1,442,100     |                  |
| パーク24            | 74,200  | 2,230.00 | 165,466,000   | 貸付有価証券<br>800株   |
| パラカ              | 3,600   | 1,700.00 | 6,120,000     |                  |
| 三井不動産            | 630,200 | 2,515.00 | 1,584,953,000 | 貸付有価証券<br>100株   |
| 三菱地所             | 908,400 | 1,872.50 | 1,700,979,000 |                  |
| 平和不動産            | 23,700  | 3,910.00 | 92,667,000    |                  |
| 東京建物             | 136,600 | 1,727.00 | 235,908,200   |                  |
| ダイビル             | 35,100  | 1,278.00 | 44,857,800    |                  |
| 京阪神ビルディング        | 23,800  | 1,520.00 | 36,176,000    |                  |

|                    |         |          |               |                          |
|--------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 住友不動産              | 310,800 | 3,913.00 | 1,216,160,400 | 貸付有価証券<br>100株           |
| テーオーシー             | 27,100  | 741.00   | 20,081,100    |                          |
| 東京楽天地              | 2,300   | 4,245.00 | 9,763,500     |                          |
| レオパレス 2 1          | 114,700 | 153.00   | 17,549,100    | 貸付有価証券<br>600株           |
| スターツコーポレーショ<br>ン   | 16,500  | 2,756.00 | 45,474,000    |                          |
| フジ住宅               | 16,000  | 666.00   | 10,656,000    |                          |
| 空港施設               | 13,800  | 635.00   | 8,763,000     |                          |
| 明和地所               | 6,500   | 668.00   | 4,342,000     |                          |
| ゴールドクレスト           | 12,500  | 1,630.00 | 20,375,000    | 貸付有価証券<br>400株           |
| エスリード              | 5,400   | 1,678.00 | 9,061,200     |                          |
| 日神グループホールディ<br>ングス | 20,400  | 501.00   | 10,220,400    | 貸付有価証券<br>9,600株         |
| 日本エスコン             | 25,100  | 759.00   | 19,050,900    | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| タカラレーベン            | 57,900  | 369.00   | 21,365,100    | 貸付有価証券<br>200株           |
| A V A N T I A      | 7,100   | 907.00   | 6,439,700     |                          |
| イオンモール             | 69,300  | 1,757.00 | 121,760,100   |                          |
| 毎日コムネット            | 4,700   | 775.00   | 3,642,500     |                          |
| ファースト住建            | 5,900   | 1,244.00 | 7,339,600     |                          |
| カチタス               | 34,200  | 3,340.00 | 114,228,000   |                          |
| トーセイ               | 19,100  | 1,123.00 | 21,449,300    |                          |
| 穴吹興産               | 3,000   | 2,127.00 | 6,381,000     |                          |
| サンフロンティア不動産        | 17,000  | 1,024.00 | 17,408,000    |                          |
| エフ・ジェー・ネクスト        | 13,600  | 1,053.00 | 14,320,800    | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| インテリックス            | 3,100   | 862.00   | 2,672,200     |                          |
| ランドビジネス            | 5,800   | 402.00   | 2,331,600     |                          |
| サンネクスタグループ         | 4,400   | 991.00   | 4,360,400     |                          |
| グランディハウス           | 9,400   | 465.00   | 4,371,000     |                          |
| 日本空港ビルデング          | 48,000  | 4,870.00 | 233,760,000   | 貸付有価証券<br>6,200株（2,400株） |
| 明豊ファシリティワーク<br>ス   | 6,100   | 789.00   | 4,812,900     |                          |
| 日本工営               | 8,300   | 3,095.00 | 25,688,500    |                          |



|                    |         |          |             |                          |
|--------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| L I F U L L        | 40,900  | 409.00   | 16,728,100  | 貸付有価証券<br>600株           |
| ミクシィ               | 34,000  | 2,706.00 | 92,004,000  |                          |
| ジェイエシーリクルー<br>トメント | 9,200   | 1,792.00 | 16,486,400  |                          |
| 日本M&Aセンター          | 219,700 | 2,771.00 | 608,788,700 | 貸付有価証券<br>500株           |
| メンバーズ              | 4,000   | 2,976.00 | 11,904,000  |                          |
| 中広                 | 1,800   | 349.00   | 628,200     | 貸付有価証券<br>100株           |
| U T グループ           | 19,300  | 3,720.00 | 71,796,000  |                          |
| アイティメディア           | 4,500   | 1,993.00 | 8,968,500   | 貸付有価証券<br>2,100株（1,200株） |
| タケエイ               | 14,900  | 1,284.00 | 19,131,600  | 貸付有価証券<br>5,600株         |
| E・Jホールディングス        | 7,000   | 1,135.00 | 7,945,000   |                          |
| 夢真ビーネックスグルー<br>プ   | 35,500  | 1,428.00 | 50,694,000  | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| コシダカホールディング<br>ス   | 35,800  | 567.00   | 20,298,600  | 貸付有価証券<br>9,400株         |
| アルトナー              | 3,200   | 813.00   | 2,601,600   |                          |
| パソナグループ            | 14,500  | 1,941.00 | 28,144,500  |                          |
| C D S              | 3,300   | 1,568.00 | 5,174,400   |                          |
| リンクアンドモチベー<br>ション  | 24,600  | 690.00   | 16,974,000  | 貸付有価証券<br>5,700株（5,700株） |
| G C A              | 17,500  | 850.00   | 14,875,000  |                          |
| エス・エム・エス           | 45,500  | 3,060.00 | 139,230,000 |                          |
| サニーサイドアップグ<br>ループ  | 4,600   | 756.00   | 3,477,600   | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| パーソルホールディング<br>ス   | 133,900 | 2,118.00 | 283,600,200 |                          |
| リニカル               | 7,500   | 741.00   | 5,557,500   |                          |
| クックパッド             | 42,100  | 282.00   | 11,872,200  | 貸付有価証券<br>700株           |
| エスクリ               | 4,200   | 421.00   | 1,768,200   | 貸付有価証券<br>200株（100株）     |
| アイ・ケイ・ケイ           | 6,500   | 670.00   | 4,355,000   |                          |
| 学情                 | 4,700   | 1,375.00 | 6,462,500   | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| スタジオアリス            | 6,700   | 2,400.00 | 16,080,000  | 貸付有価証券                   |

|                  |         |          |               |                        |
|------------------|---------|----------|---------------|------------------------|
|                  |         |          |               | 4,200株                 |
| シミックホールディングス     | 7,400   | 1,577.00 | 11,669,800    |                        |
| エプコ              | 3,200   | 981.00   | 3,139,200     |                        |
| N J S            | 3,300   | 2,013.00 | 6,642,900     |                        |
| 総合警備保障           | 53,300  | 4,875.00 | 259,837,500   |                        |
| カカクコム            | 99,000  | 2,882.00 | 285,318,000   | 貸付有価証券<br>4,500株       |
| セントケア・ホールディング    | 9,800   | 1,194.00 | 11,701,200    |                        |
| サイネックス           | 2,300   | 666.00   | 1,531,800     |                        |
| ルネサンス            | 8,400   | 1,161.00 | 9,752,400     | 貸付有価証券<br>4,200株       |
| ディップ             | 20,900  | 3,230.00 | 67,507,000    |                        |
| デジタルホールディングス     | 9,300   | 1,931.00 | 17,958,300    | 貸付有価証券<br>1,200株（700株） |
| 新日本科学            | 16,300  | 733.00   | 11,947,900    | 貸付有価証券<br>400株         |
| ツクイホールディングス      | 6,300   | 921.00   | 5,802,300     | 貸付有価証券<br>200株         |
| キャリアデザインセンター     | 3,400   | 1,069.00 | 3,634,600     |                        |
| ベネフィット・ワン        | 48,700  | 2,742.00 | 133,535,400   | 貸付有価証券<br>700株         |
| エムスリー            | 236,300 | 7,462.00 | 1,763,270,600 | 貸付有価証券<br>500株         |
| ツカダ・グローバルホールディング | 10,700  | 347.00   | 3,712,900     |                        |
| プラス              | 1,700   | 522.00   | 887,400       | 貸付有価証券<br>400株（400株）   |
| アウトソーシング         | 76,700  | 1,904.00 | 146,036,800   |                        |
| ウェルネット           | 13,500  | 521.00   | 7,033,500     |                        |
| ワールドホールディングス     | 4,600   | 2,781.00 | 12,792,600    |                        |
| ディー・エヌ・エー        | 56,700  | 2,100.00 | 119,070,000   | 貸付有価証券<br>2,800株       |
| 博報堂D Yホールディングス   | 186,400 | 1,838.00 | 342,603,200   | 貸付有価証券<br>900株         |
| ぐるなび             | 23,300  | 592.00   | 13,793,600    |                        |
| タカミヤ             | 16,200  | 524.00   | 8,488,800     |                        |
| ジャパンベストレス        | 9,100   | 730.00   | 6,643,000     |                        |

|                    |         |          |             |                          |
|--------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| キューシステム            |         |          |             |                          |
| ファンコミュニケーションズ      | 36,800  | 398.00   | 14,646,400  |                          |
| ライク                | 3,500   | 2,315.00 | 8,102,500   | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| ビジネス・ブレークスルー       | 5,600   | 449.00   | 2,514,400   |                          |
| エスプール              | 34,400  | 958.00   | 32,955,200  |                          |
| WDBホールディングス        | 6,100   | 2,357.00 | 14,377,700  |                          |
| 手間いらず              | 1,700   | 5,570.00 | 9,469,000   | 貸付有価証券<br>200株（100株）     |
| ティア                | 7,800   | 491.00   | 3,829,800   |                          |
| CDG                | 1,200   | 1,594.00 | 1,912,800   |                          |
| アドウェイズ             | 21,800  | 861.00   | 18,769,800  | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| バリューコマース           | 9,000   | 3,350.00 | 30,150,000  |                          |
| インフォマート            | 135,500 | 900.00   | 121,950,000 |                          |
| JPホールディングス         | 38,200  | 317.00   | 12,109,400  | 貸付有価証券<br>3,500株         |
| EPSホールディングス        | 20,200  | 1,400.00 | 28,280,000  |                          |
| レグス                | 3,300   | 2,488.00 | 8,210,400   |                          |
| プレステージ・インターナショナル   | 50,200  | 744.00   | 37,348,800  | 貸付有価証券<br>200株           |
| アミューズ              | 7,300   | 2,361.00 | 17,235,300  |                          |
| ドリームインキュベータ        | 4,100   | 1,014.00 | 4,157,400   |                          |
| クイック               | 8,300   | 1,246.00 | 10,341,800  |                          |
| TAC                | 7,200   | 245.00   | 1,764,000   |                          |
| 電通グループ             | 150,600 | 3,535.00 | 532,371,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| テイクアンドギヴ・ニーズ       | 6,300   | 844.00   | 5,317,200   | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| ぴあ                 | 3,800   | 2,841.00 | 10,795,800  | 貸付有価証券<br>200株           |
| イオンファンタジー          | 5,200   | 2,026.00 | 10,535,200  |                          |
| シーティーエス            | 15,100  | 888.00   | 13,408,800  |                          |
| ネクシィーズグループ         | 4,700   | 996.00   | 4,681,200   | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株） |
| H. U. グループホールディングス | 37,500  | 3,655.00 | 137,062,500 |                          |
| アルプス技研             | 11,800  | 2,042.00 | 24,095,600  |                          |

|                    |         |           |               |                   |
|--------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| ダイオーズ              | 2,600   | 990.00    | 2,574,000     |                   |
| 日本空調サービス           | 14,000  | 743.00    | 10,402,000    |                   |
| オリエンタルランド          | 142,500 | 15,265.00 | 2,175,262,500 | 貸付有価証券<br>200株    |
| ダスキン               | 31,100  | 2,654.00  | 82,539,400    |                   |
| 明光ネットワークジャパ<br>ン   | 15,700  | 589.00    | 9,247,300     | 貸付有価証券<br>800株    |
| ファルコホールディング<br>ス   | 6,400   | 1,698.00  | 10,867,200    |                   |
| 秀英予備校              | 2,900   | 409.00    | 1,186,100     |                   |
| ラウンドワン             | 45,700  | 1,239.00  | 56,622,300    | 貸付有価証券<br>500株    |
| リゾートトラスト           | 61,400  | 1,698.00  | 104,257,200   | 貸付有価証券<br>900株    |
| ビー・エム・エル           | 17,200  | 3,835.00  | 65,962,000    | 貸付有価証券<br>100株    |
| りらいあコミュニケー<br>ションズ | 20,400  | 1,334.00  | 27,213,600    | 貸付有価証券<br>100株    |
| リソー教育              | 68,000  | 292.00    | 19,856,000    |                   |
| 早稲田アカデミー           | 5,700   | 926.00    | 5,278,200     | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| ユー・エス・エス           | 150,000 | 2,001.00  | 300,150,000   |                   |
| 東京個別指導学院           | 11,800  | 592.00    | 6,985,600     |                   |
| サイバーエージェント         | 330,200 | 2,190.00  | 723,138,000   | 貸付有価証券<br>200株    |
| 楽天グループ             | 624,900 | 1,334.00  | 833,616,600   | 貸付有価証券<br>10,000株 |
| クリーク・アンド・リ<br>バー社  | 7,000   | 1,581.00  | 11,067,000    | 貸付有価証券<br>100株    |
| モーニングスター           | 19,500  | 461.00    | 8,989,500     |                   |
| テー・オー・ダブリュー        | 23,400  | 326.00    | 7,628,400     |                   |
| 山田コンサルティンググ<br>ループ | 7,800   | 1,238.00  | 9,656,400     |                   |
| セントラルスポーツ          | 5,000   | 2,430.00  | 12,150,000    | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| フルキャストホールディ<br>ングス | 11,400  | 1,979.00  | 22,560,600    |                   |
| エン・ジャパン            | 23,800  | 3,440.00  | 81,872,000    |                   |
| リソルホールディングス        | 1,500   | 4,000.00  | 6,000,000     | 貸付有価証券<br>600株    |
| テクノプロ・ホールディ        | 26,700  | 8,470.00  | 226,149,000   | 貸付有価証券            |

|                         |        |           |            |                          |
|-------------------------|--------|-----------|------------|--------------------------|
| ングス                     |        |           |            | 100株                     |
| アトラグループ                 | 3,100  | 335.00    | 1,038,500  | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| インターワークス                | 3,800  | 390.00    | 1,482,000  |                          |
| アイ・アールジャパン<br>ホールディングス  | 5,400  | 13,130.00 | 70,902,000 | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| K e e P e r 技研          | 8,600  | 2,308.00  | 19,848,800 | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| ファーストロジック               | 2,600  | 775.00    | 2,015,000  |                          |
| 三機サービス                  | 2,600  | 1,076.00  | 2,797,600  | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| G u n o s y             | 8,300  | 1,022.00  | 8,482,600  |                          |
| デザインワン・ジャパン             | 3,300  | 255.00    | 841,500    |                          |
| イー・ガーディアン               | 5,400  | 2,786.00  | 15,044,400 |                          |
| リブセンス                   | 7,400  | 231.00    | 1,709,400  |                          |
| ジャパンマテリアル               | 41,200 | 1,275.00  | 52,530,000 |                          |
| ベクトル                    | 16,700 | 958.00    | 15,998,600 |                          |
| ウチヤマホールディング<br>ス        | 6,600  | 378.00    | 2,494,800  |                          |
| チャーム・ケア・コーポ<br>レーション    | 10,000 | 1,263.00  | 12,630,000 |                          |
| キャリアリンク                 | 4,400  | 2,236.00  | 9,838,400  | 貸付有価証券<br>2,500株         |
| I B J                   | 11,000 | 912.00    | 10,032,000 | 貸付有価証券<br>400株           |
| アサンテ                    | 4,800  | 1,823.00  | 8,750,400  |                          |
| N・フィールド                 | 1,700  | 1,197.00  | 2,034,900  |                          |
| バリューHR                  | 5,300  | 1,660.00  | 8,798,000  |                          |
| M&Aキャピタルパート<br>ナーズ      | 11,000 | 4,690.00  | 51,590,000 |                          |
| ライドオンエクスプレス<br>ホールディングス | 5,200  | 1,696.00  | 8,819,200  | 貸付有価証券<br>3,300株（3,300株） |
| E R I ホールディングス          | 3,700  | 588.00    | 2,175,600  |                          |
| アビスト                    | 2,100  | 3,060.00  | 6,426,000  |                          |
| シグマクシス                  | 7,300  | 2,139.00  | 15,614,700 |                          |
| ウィルグループ                 | 9,800  | 1,018.00  | 9,976,400  |                          |
| エスクロー・エージェン<br>ト・ジャパン   | 19,900 | 253.00    | 5,034,700  | 貸付有価証券<br>100株           |
| メドピア                    | 10,300 | 5,730.00  | 59,019,000 |                          |
| レアジョブ                   | 2,500  | 2,045.00  | 5,112,500  | 貸付有価証券                   |

|                       |           |           |               |                          |
|-----------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
|                       |           |           |               | 900株                     |
| リクルートホールディングス         | 959,600   | 5,257.00  | 5,044,617,200 |                          |
| エラン                   | 18,500    | 1,372.00  | 25,382,000    |                          |
| 土木管理総合試験所             | 6,500     | 406.00    | 2,639,000     |                          |
| ネットマーケティング            | 6,400     | 591.00    | 3,782,400     |                          |
| 日本郵政                  | 1,013,500 | 949.40    | 962,216,900   | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| ベルシステム24ホールディングス      | 22,400    | 1,694.00  | 37,945,600    |                          |
| 鎌倉新書                  | 13,500    | 1,365.00  | 18,427,500    | 貸付有価証券<br>4,500株（1,300株） |
| SMN                   | 2,900     | 805.00    | 2,334,500     |                          |
| 一蔵                    | 1,700     | 401.00    | 681,700       |                          |
| グローバルキッズCOMPANY       | 2,400     | 1,013.00  | 2,431,200     |                          |
| エアトリ                  | 8,400     | 2,246.00  | 18,866,400    | 貸付有価証券<br>200株           |
| アトラエ                  | 9,300     | 1,679.00  | 15,614,700    |                          |
| ストライク                 | 5,100     | 4,280.00  | 21,828,000    | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| ソラスト                  | 32,900    | 1,410.00  | 46,389,000    |                          |
| セラク                   | 4,200     | 2,311.00  | 9,706,200     |                          |
| インソース                 | 13,000    | 2,456.00  | 31,928,000    |                          |
| ベイカレント・コンサルティング       | 8,800     | 34,000.00 | 299,200,000   |                          |
| Orchestra Holdings    | 3,000     | 2,787.00  | 8,361,000     |                          |
| アイモバイル                | 3,800     | 1,368.00  | 5,198,400     | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株） |
| キャリアインデックス            | 5,500     | 602.00    | 3,311,000     | 貸付有価証券<br>700株（700株）     |
| MS-Japan              | 5,400     | 1,039.00  | 5,610,600     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 船場                    | 2,700     | 854.00    | 2,305,800     |                          |
| グレイステクノロジー            | 13,600    | 2,553.00  | 34,720,800    | 貸付有価証券<br>2,100株（2,000株） |
| ジャパンエレベーターサービスホールディング | 38,600    | 2,242.00  | 86,541,200    |                          |
| フルテック                 | 1,900     | 1,474.00  | 2,800,600     |                          |
| グリーンズ                 | 5,000     | 592.00    | 2,960,000     | 貸付有価証券                   |

|                  |        |          |            |                          |
|------------------|--------|----------|------------|--------------------------|
|                  |        |          |            | 700株                     |
| ツナググループ・ホールディングス | 2,900  | 306.00   | 887,400    | 貸付有価証券<br>600株（100株）     |
| GameWith         | 4,000  | 665.00   | 2,660,000  | 貸付有価証券<br>400株           |
| ソウルドアウト          | 3,200  | 1,587.00 | 5,078,400  | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| MS&Consulting    | 2,100  | 607.00   | 1,274,700  |                          |
| ウェルビー            | 4,900  | 1,482.00 | 7,261,800  |                          |
| エル・ティー・エス        | 1,300  | 4,445.00 | 5,778,500  | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| ミダック             | 2,900  | 5,430.00 | 15,747,000 | 貸付有価証券<br>800株（400株）     |
| 日総工産             | 10,500 | 776.00   | 8,148,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| キュービーネットホールディングス | 6,100  | 1,773.00 | 10,815,300 |                          |
| RPAホールディングス      | 15,400 | 765.00   | 11,781,000 | 貸付有価証券<br>5,000株（5,000株） |
| スプリックス           | 3,800  | 1,067.00 | 4,054,600  | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| マネジメントソリューションズ   | 6,500  | 1,976.00 | 12,844,000 |                          |
| プロレド・パートナーズ      | 2,400  | 2,964.00 | 7,113,600  | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| and factory      | 3,000  | 703.00   | 2,109,000  |                          |
| テノ・ホールディングス      | 1,400  | 1,130.00 | 1,582,000  |                          |
| フロンティア・マネジメント    | 3,000  | 1,659.00 | 4,977,000  |                          |
| ピアラ              | 900    | 1,582.00 | 1,423,800  |                          |
| コプロ・ホールディングス     | 1,700  | 1,326.00 | 2,254,200  | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| ギークス             | 2,300  | 1,709.00 | 3,930,700  |                          |
| カーブスホールディングス     | 36,800 | 821.00   | 30,212,800 |                          |
| フォーラムエンジニアリング    | 9,300  | 1,043.00 | 9,699,900  |                          |
| ダイレクトマーケティングミックス | 7,000  | 3,485.00 | 24,395,000 |                          |
| ポピンズホールディングス     | 3,500  | 4,600.00 | 16,100,000 | 貸付有価証券<br>1,200株         |

|                  |        |          |             |                           |
|------------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
| LITALICO         | 5,400  | 4,620.00 | 24,948,000  |                           |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 6,800  | 730.00   | 4,964,000   |                           |
| リログループ           | 73,200 | 2,291.00 | 167,701,200 | 貸付有価証券<br>22,000株         |
| 東祥               | 8,300  | 1,679.00 | 13,935,700  | 貸付有価証券<br>4,200株          |
| エイチ・アイ・エス        | 20,600 | 2,289.00 | 47,153,400  | 貸付有価証券<br>7,600株（4,200株）  |
| ラックランド           | 3,800  | 2,498.00 | 9,492,400   |                           |
| 共立メンテナンス         | 22,200 | 3,535.00 | 78,477,000  | 貸付有価証券<br>11,000株（3,800株） |
| イチネンホールディングス     | 13,900 | 1,299.00 | 18,056,100  |                           |
| 建設技術研究所          | 8,600  | 2,563.00 | 22,041,800  |                           |
| スペース             | 8,700  | 903.00   | 7,856,100   | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| 長大               | 5,300  | 1,774.00 | 9,402,200   |                           |
| 燦ホールディングス        | 5,800  | 1,065.00 | 6,177,000   |                           |
| スバル興業            | 800    | 8,170.00 | 6,536,000   |                           |
| 東京テアトル           | 5,200  | 1,256.00 | 6,531,200   |                           |
| タナベ経営            | 2,600  | 1,396.00 | 3,629,600   |                           |
| ナガワ              | 4,300  | 8,250.00 | 35,475,000  | 貸付有価証券<br>2,200株          |
| 東京都競馬            | 8,800  | 5,420.00 | 47,696,000  |                           |
| 常磐興産             | 5,400  | 1,425.00 | 7,695,000   |                           |
| カナモト             | 23,600 | 2,775.00 | 65,490,000  | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| 西尾レントオール         | 12,400 | 3,215.00 | 39,866,000  |                           |
| トランス・コスモス        | 12,700 | 3,115.00 | 39,560,500  | 貸付有価証券<br>100株            |
| 乃村工藝社            | 57,400 | 831.00   | 47,699,400  |                           |
| 藤田観光             | 5,300  | 1,937.00 | 10,266,100  | 貸付有価証券<br>2,700株          |
| KNT-CTホールディングス   | 7,100  | 1,074.00 | 7,625,400   | 貸付有価証券<br>4,500株          |
| 日本管財             | 14,300 | 2,245.00 | 32,103,500  | 貸付有価証券<br>8,600株          |
| トーカイ             | 12,900 | 2,462.00 | 31,759,800  |                           |
| 白洋舎              | 1,500  | 2,334.00 | 3,501,000   | 貸付有価証券                    |



|  |              |         |          |                 |
|--|--------------|---------|----------|-----------------|
|  |              |         |          | 900株            |
|  | セコム          | 132,000 | 9,317.00 | 1,229,844,000   |
|  | セントラル警備保障    | 6,400   | 2,990.00 | 19,136,000      |
|  | 丹青社          | 25,300  | 860.00   | 21,758,000      |
|  | メイテック        | 16,200  | 6,130.00 | 99,306,000      |
|  | 応用地質         | 15,100  | 1,328.00 | 20,052,800      |
|  | 船井総研ホールディングス | 27,400  | 2,269.00 | 62,170,600      |
|  | 進学会ホールディングス  | 5,200   | 423.00   | 2,199,600       |
|  | オオバ          | 9,400   | 859.00   | 8,074,600       |
|  | いであ          | 3,300   | 1,866.00 | 6,157,800       |
|  | 学究社          | 3,900   | 1,311.00 | 5,112,900       |
|  | ベネッセホールディングス | 49,100  | 2,443.00 | 119,951,300     |
|  | イオンディライト     | 16,500  | 3,385.00 | 55,852,500      |
|  | ナック          | 6,300   | 947.00   | 5,966,100       |
|  | ダイセキ         | 22,500  | 4,115.00 | 92,587,500      |
|  | ステップ         | 4,900   | 1,609.00 | 7,884,100       |
|  | 小計 銘柄数：2,172 |         |          | 375,833,453,070 |
|  | 組入時価比率：97.5% |         |          | 100.0%          |
|  | 合計           |         |          | 375,833,453,070 |

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

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

## (2)株式以外の有価証券(2021年5月10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 5月10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       | 9,684,638,100 | — | 9,730,920,000 | 46,035,390 |
| 合計       | 9,684,638,100 | — | 9,730,920,000 | 46,035,390 |

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2021年 5月10日現在)

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産の部            |                 |
| 流動資産            |                 |
| 預金              | 9,939,617,341   |
| コール・ローン         | 1,535,603,976   |
| 株式              | 933,363,590,174 |
| 投資証券            | 21,253,062,928  |
| 派生商品評価勘定        | 794,594,918     |
| 未収入金            | 34,172,914      |
| 未収配当金           | 947,956,934     |
| 差入委託証拠金         | 5,832,534,969   |
| 流動資産合計          | 973,701,134,154 |
| 資産合計            | 973,701,134,154 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 85,705          |
| 未払解約金           | 1,433,968,662   |
| 未払利息            | 764             |
| その他未払費用         | 4,129,400       |
| 流動負債合計          | 1,438,184,531   |
| 負債合計            | 1,438,184,531   |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 244,666,051,153 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 727,596,898,470 |
| 元本等合計           | 972,262,949,623 |
| 純資産合計           | 972,262,949,623 |
| 負債純資産合計         | 973,701,134,154 |

## 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 |
|-------------------|----|

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）  
該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

| 2021年 5月10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                  | 3,9738円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (39,738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

|                                           |
|-------------------------------------------|
| <p>自 2020年 5月12日</p> <p>至 2021年 5月10日</p> |
| 1.金融商品に対する取組方針                            |

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

## 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。

## 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 5月10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 5月10日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2020年 5月12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 | 232,138,550,632円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 52,782,857,283円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 40,255,356,762円  |
| 期末元本額                            | 244,666,051,153円 |
| 期末元本額の内訳＊                        |                  |
| バランスセレクト30                       | 35,819,081円      |
| バランスセレクト50                       | 107,047,263円     |

|                                                |                 |
|------------------------------------------------|-----------------|
| バランスセレクト70                                     | 125,605,101円    |
| 野村外国株式インデックスファンド                               | 479,232,806円    |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース）                             | 3,520,335,621円  |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース）                             | 4,528,560,345円  |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース）                             | 3,806,627,992円  |
| 野村資産設計ファンド2015                                 | 11,285,139円     |
| 野村資産設計ファンド2020                                 | 11,224,861円     |
| 野村資産設計ファンド2025                                 | 21,254,598円     |
| 野村資産設計ファンド2030                                 | 29,229,884円     |
| 野村資産設計ファンド2035                                 | 24,118,911円     |
| 野村資産設計ファンド2040                                 | 46,571,313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）                   | 45,076,363,570円 |
| のむラップ・ファンド（保守型）                                | 791,908,561円    |
| のむラップ・ファンド（普通型）                                | 7,315,549,901円  |
| のむラップ・ファンド（積極型）                                | 5,889,700,822円  |
| 野村資産設計ファンド2045                                 | 7,611,460円      |
| 野村インデックスファンド・外国株式                              | 5,345,148,142円  |
| マイ・ロード                                         | 1,032,742,731円  |
| ネクストコア                                         | 13,056,429円     |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス                         | 125,990,499円    |
| 野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）                    | 1,895,581,394円  |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース）                           | 611,695,709円    |
| 野村資産設計ファンド2050                                 | 11,393,271円     |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型               | 3,754,477円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型               | 1,939,609円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型               | 1,479,990円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型               | 1,187,432円      |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                              | 171,740,219円    |
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                              | 485,563,027円    |
| インデックス・ブレンド（タイプⅠ）                              | 2,322,436円      |
| インデックス・ブレンド（タイプⅡ）                              | 2,795,991円      |
| インデックス・ブレンド（タイプⅢ）                              | 17,883,908円     |
| インデックス・ブレンド（タイプⅣ）                              | 6,946,863円      |
| インデックス・ブレンド（タイプⅤ）                              | 29,282,066円     |
| 野村6資産均等バランス                                    | 978,476,959円    |
| 野村つみたて外国株投信                                    | 7,508,913,366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）            | 4,268,959,216円  |
| 世界6資産分散ファンド                                    | 40,003,105円     |
| 野村資産設計ファンド2060                                 | 5,603,304円      |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信                                 | 219,155,346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 | 2,611,613,467円  |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式                         | 1,949,717,646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）               | 161,123,355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）               | 75,767,645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）               | 774,148,114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）               | 1,453,310,875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）               | 1,718,288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）             | 5,207,963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）               | 976,934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）              | 1,646,075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）              | 25,290,464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）                    | 9,564,180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）                 | 8,770,975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）             | 32,314,463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）             | 104,436,993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）             | 2,456,215,376円  |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）                        | 30,264,321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）             | 197,850,139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）  | 12,667,240,988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） | 1,197,368円      |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け）                           | 1,529,240円      |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け）                           | 9,301,509円      |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け）                           | 9,910,592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）        | 75,538,531,841円 |
| マイバランス30（確定拠出年金向け）                             | 2,381,759,677円  |
| マイバランス50（確定拠出年金向け）                             | 8,695,331,968円  |
| マイバランス70（確定拠出年金向け）                             | 8,066,663,987円  |
| マイバランスDC30                                     | 819,625,982円    |
| マイバランスDC50                                     | 1,842,919,154円  |
| マイバランスDC70                                     | 1,514,452,932円  |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI                | 27,041,480,694円 |
| 野村DC運用戦略ファンド                                   | 253,010,969円    |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）                             | 20,090,323円     |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け）                          | 332,943,865円    |
| マイターゲット2030（確定拠出年金向け）                          | 274,994,978円    |
| マイターゲット2040（確定拠出年金向け）                          | 247,363,605円    |
| 野村世界6資産分散投信（DC）安定コース                           | 13,511,562円     |
| 野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース                         | 6,589,929円      |
| 野村世界6資産分散投信（DC）成長コース                           | 33,462,540円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030                    | 5,297,370円      |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040                    | 4,619,695円      |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050                    | 3,861,735円      |
| マイターゲット2035（確定拠出年金向け）                          | 135,236,129円    |
| マイターゲット2045（確定拠出年金向け）                          | 98,453,620円     |
| マイターゲット2055（確定拠出年金向け）                          | 55,745,329円     |
| マイターゲット2060（確定拠出年金向け）                          | 70,617,225円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060                    | 2,241,606円      |
| マイターゲット2065（確定拠出年金向け）                          | 8,426,494円      |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）                  | 38,256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5月10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 | 24.63  | 2,733,930.00  |    |
|    |     | HALLIBURTON CO               | 150,000 | 22.95  | 3,442,500.00  |    |
|    |     | SCHLUMBERGER LTD             | 234,000 | 31.89  | 7,462,260.00  |    |
|    |     | CABOT OIL & GAS CORP         | 64,000  | 17.39  | 1,112,960.00  |    |
|    |     | CHENIERE ENERGY INC          | 36,400  | 82.65  | 3,008,460.00  |    |
|    |     | CHEVRON CORP                 | 319,000 | 110.02 | 35,096,380.00 |    |
|    |     | CONOCOPHILLIPS               | 223,100 | 57.10  | 12,739,010.00 |    |
|    |     | DEVON ENERGY CORP            | 100,000 | 26.22  | 2,622,000.00  |    |
|    |     | EOG RESOURCES INC            | 98,100  | 83.10  | 8,152,110.00  |    |
|    |     | EXXON MOBIL CORP             | 700,700 | 62.43  | 43,744,701.00 |    |
|    |     | HESS CORP                    | 47,300  | 82.53  | 3,903,669.00  |    |
|    |     | KINDER MORGAN INC            | 344,000 | 17.84  | 6,136,960.00  |    |
|    |     | MARATHON PETROLEUM CORP      | 106,000 | 60.00  | 6,360,000.00  |    |
|    |     | OCCIDENTAL PETE CORP         | 158,000 | 27.39  | 4,327,620.00  |    |
|    |     | ONEOK INC                    | 74,000  | 53.38  | 3,950,120.00  |    |
|    |     | PHILLIPS 66                  | 71,100  | 86.04  | 6,117,444.00  |    |
|    |     | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 33,500  | 167.83 | 5,622,305.00  |    |
|    |     | VALERO ENERGY CORP           | 66,500  | 80.49  | 5,352,585.00  |    |
|    |     | WILLIAMS COS                 | 198,000 | 25.30  | 5,009,400.00  |    |
|    |     | AIR PRODUCTS                 | 36,300  | 290.55 | 10,546,965.00 |    |
|    |     | ALBEMARLE CORP               | 19,700  | 162.72 | 3,205,584.00  |    |
|    |     | AXALTA COATING SYSTEMS LTD   | 36,000  | 33.71  | 1,213,560.00  |    |
|    |     | CELANESE CORP-SERIES A       | 19,500  | 168.63 | 3,288,285.00  |    |
|    |     | CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   | 35,300  | 55.10  | 1,945,030.00  |    |
|    |     | CORTEVA INC                  | 121,700 | 48.86  | 5,946,262.00  |    |
|    |     | DOW INC                      | 124,500 | 69.04  | 8,595,480.00  |    |
|    |     | DUPONT DE NEMOURS INC        | 87,700  | 82.85  | 7,265,945.00  |    |
|    |     | EASTMAN CHEMICAL CO.         | 23,000  | 124.97 | 2,874,310.00  |    |

|                                   |         |        |               |
|-----------------------------------|---------|--------|---------------|
| ECOLAB INC                        | 43,000  | 228.43 | 9,822,490.00  |
| FMC CORP                          | 21,200  | 120.41 | 2,552,692.00  |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 37,178  | 146.45 | 5,444,718.10  |
| LINDE PLC                         | 87,200  | 298.93 | 26,066,696.00 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A          | 45,200  | 114.06 | 5,155,512.00  |
| MOSAIC CO/THE                     | 56,000  | 37.00  | 2,072,000.00  |
| PPG INDUSTRIES                    | 39,800  | 179.49 | 7,143,702.00  |
| RPM INTERNATIONAL INC             | 21,100  | 97.47  | 2,056,617.00  |
| SHERWIN-WILLIAMS                  | 40,290  | 287.23 | 11,572,496.70 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS         | 10,500  | 378.28 | 3,971,940.00  |
| VULCAN MATERIALS CO               | 22,300  | 191.71 | 4,275,133.00  |
| AMCOR PLC                         | 268,000 | 12.45  | 3,336,600.00  |
| AVERY DENNISON CORP               | 13,400  | 221.46 | 2,967,564.00  |
| BALL CORP                         | 55,100  | 90.70  | 4,997,570.00  |
| CROWN HOLDINGS INC                | 22,800  | 113.54 | 2,588,712.00  |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)        | 60,100  | 61.64  | 3,704,564.00  |
| PACKAGING CORP OP AMERICA         | 16,100  | 153.16 | 2,465,876.00  |
| SEALED AIR CORP                   | 26,500  | 57.06  | 1,512,090.00  |
| WESTROCK CO                       | 43,200  | 59.74  | 2,580,768.00  |
| FREEMONT-MCMORAN INC              | 239,000 | 43.97  | 10,508,830.00 |
| NEWMONT CORP                      | 131,700 | 67.33  | 8,867,361.00  |
| NUCOR CORP                        | 50,900  | 98.76  | 5,026,884.00  |
| STEEL DYNAMICS                    | 33,400  | 63.36  | 2,116,224.00  |
| BOEING CO                         | 88,500  | 235.47 | 20,839,095.00 |
| GENERAL DYNAMICS                  | 41,000  | 194.82 | 7,987,620.00  |
| HEICO CORP                        | 6,300   | 141.63 | 892,269.00    |
| HEICO CORP-CLASS A                | 12,300  | 131.00 | 1,611,300.00  |
| HOWMET AEROSPACE INC              | 66,000  | 33.57  | 2,215,620.00  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE      | 6,500   | 216.99 | 1,410,435.00  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC         | 34,400  | 219.25 | 7,542,200.00  |
| LOCKHEED MARTIN                   | 42,000  | 390.34 | 16,394,280.00 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP             | 26,000  | 370.63 | 9,636,380.00  |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP        | 250,600 | 85.71  | 21,478,926.00 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC         | 5,810   | 435.99 | 2,533,101.90  |
| TEXTRON INC                       | 37,900  | 68.08  | 2,580,232.00  |



|                                    |           |        |               |  |
|------------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| TRANSDIGM GROUP INC                | 8,680     | 607.99 | 5,277,353.20  |  |
| ALLEGION PLC                       | 14,800    | 141.25 | 2,090,500.00  |  |
| CARRIER GLOBAL CORP                | 139,000   | 44.84  | 6,232,760.00  |  |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 23,400    | 111.56 | 2,610,504.00  |  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 118,500   | 65.70  | 7,785,450.00  |  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC           | 5,700     | 348.00 | 1,983,600.00  |  |
| MASCO CORP                         | 42,500    | 66.86  | 2,841,550.00  |  |
| OWENS CORNING INC                  | 16,800    | 106.92 | 1,796,256.00  |  |
| SMITH (A.O.) CORP                  | 21,800    | 71.13  | 1,550,634.00  |  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC             | 40,300    | 183.68 | 7,402,304.00  |  |
| AMETEK INC                         | 37,300    | 137.33 | 5,122,409.00  |  |
| EATON CORP PLC                     | 65,400    | 147.52 | 9,647,808.00  |  |
| EMERSON ELEC                       | 98,200    | 95.05  | 9,333,910.00  |  |
| GENERAC HOLDINGS INC               | 10,200    | 327.38 | 3,339,276.00  |  |
| PLUG POWER INC                     | 77,600    | 23.05  | 1,788,680.00  |  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC            | 19,600    | 270.68 | 5,305,328.00  |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING       | 24,500    | 58.84  | 1,441,580.00  |  |
| SUNRUN INC                         | 18,500    | 45.64  | 844,340.00    |  |
| 3M CORP                            | 95,600    | 203.07 | 19,413,492.00 |  |
| GENERAL ELEC CO                    | 1,453,000 | 13.30  | 19,324,900.00 |  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC        | 116,500   | 228.79 | 26,654,035.00 |  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD         | 35,400    | 66.75  | 2,362,950.00  |  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC             | 17,590    | 444.46 | 7,818,051.40  |  |
| CATERPILLAR INC DEL                | 89,900    | 240.99 | 21,665,001.00 |  |
| CUMMINS INC                        | 24,900    | 266.39 | 6,633,111.00  |  |
| DEERE & COMPANY                    | 49,400    | 394.22 | 19,474,468.00 |  |
| DOVER CORP                         | 24,300    | 152.91 | 3,715,713.00  |  |
| FORTIVE CORP                       | 51,800    | 72.82  | 3,772,076.00  |  |
| IDEX CORP                          | 12,300    | 226.00 | 2,779,800.00  |  |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC            | 52,900    | 238.28 | 12,605,012.00 |  |
| INGERSOLL-RAND INC                 | 58,000    | 50.53  | 2,930,740.00  |  |
| NORDSON CORP                       | 8,700     | 208.83 | 1,816,821.00  |  |
| OTIS WORLDWIDE CORP                | 69,600    | 78.19  | 5,442,024.00  |  |
| PACCAR                             | 58,300    | 94.50  | 5,509,350.00  |  |

|                                             |         |        |               |  |
|---------------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| PARKER HANNIFIN CORP                        | 21,600  | 319.26 | 6,896,016.00  |  |
| PENTAIR PLC                                 | 27,500  | 67.94  | 1,868,350.00  |  |
| SNAP-ON INC                                 | 8,400   | 251.56 | 2,113,104.00  |  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC                  | 25,900  | 219.69 | 5,689,971.00  |  |
| WABTEC CORP                                 | 28,800  | 81.87  | 2,357,856.00  |  |
| XYLEM INC                                   | 30,300  | 119.34 | 3,616,002.00  |  |
| FASTENAL CO                                 | 96,900  | 53.25  | 5,159,925.00  |  |
| GRAINGER(W.W.) INC                          | 7,440   | 465.64 | 3,464,361.60  |  |
| UNITED RENTALS INC                          | 12,200  | 347.33 | 4,237,426.00  |  |
| CINTAS CORP                                 | 14,300  | 360.67 | 5,157,581.00  |  |
| COPART INC                                  | 35,800  | 124.56 | 4,459,248.00  |  |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A                  | 36,100  | 110.88 | 4,002,768.00  |  |
| ROLLINS INC                                 | 35,850  | 37.12  | 1,330,752.00  |  |
| WASTE CONNECTIONS INC                       | 44,500  | 123.34 | 5,488,630.00  |  |
| WASTE MANAGEMENT INC                        | 69,300  | 141.38 | 9,797,634.00  |  |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC                  | 22,000  | 99.51  | 2,189,220.00  |  |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH<br>INC        | 27,100  | 118.67 | 3,215,957.00  |  |
| FEDEX CORPORATION                           | 41,700  | 314.69 | 13,122,573.00 |  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B                  | 117,400 | 217.50 | 25,534,500.00 |  |
| XPO LOGISTICS INC                           | 14,300  | 147.00 | 2,102,100.00  |  |
| DELTA AIR LINES INC                         | 25,200  | 46.11  | 1,161,972.00  |  |
| SOUTHWEST AIRLINES                          | 24,900  | 61.66  | 1,535,334.00  |  |
| AMERCO                                      | 1,720   | 620.41 | 1,067,105.20  |  |
| CSX CORP                                    | 127,900 | 103.13 | 13,190,327.00 |  |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC                 | 13,200  | 178.27 | 2,353,164.00  |  |
| KANSAS CITY SOUTHERN                        | 15,100  | 305.22 | 4,608,822.00  |  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION<br>HOLDINGS INC | 20,800  | 49.37  | 1,026,896.00  |  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP                       | 41,800  | 289.81 | 12,114,058.00 |  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE                   | 15,300  | 269.57 | 4,124,421.00  |  |
| UBER TECHNOLOGIES INC                       | 161,500 | 47.03  | 7,595,345.00  |  |
| UNION PAC CORP                              | 111,300 | 229.48 | 25,541,124.00 |  |
| APTIV PLC                                   | 45,400  | 148.77 | 6,754,158.00  |  |
| AUTOLIV INC                                 | 14,000  | 103.84 | 1,453,760.00  |  |
| BORGWARNER INC                              | 40,400  | 53.80  | 2,173,520.00  |  |

|                              |         |          |               |  |
|------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| LEAR CORP                    | 9,700   | 195.12   | 1,892,664.00  |  |
| FORD MOTOR COMPANY           | 656,000 | 11.82    | 7,753,920.00  |  |
| GENERAL MOTORS CO            | 215,300 | 58.99    | 12,700,547.00 |  |
| TESLA INC                    | 125,660 | 672.37   | 84,490,014.20 |  |
| DR HORTON INC                | 56,100  | 103.87   | 5,827,107.00  |  |
| GARMIN LTD                   | 24,200  | 143.56   | 3,474,152.00  |  |
| LENNAR CORP-A                | 46,500  | 108.05   | 5,024,325.00  |  |
| MOHAWK INDUSTRIES            | 10,200  | 229.74   | 2,343,348.00  |  |
| NEWELL BRANDS INC            | 66,000  | 29.07    | 1,918,620.00  |  |
| NVR INC                      | 559     | 5,211.38 | 2,913,161.42  |  |
| PULTEGROUP INC               | 43,000  | 61.73    | 2,654,390.00  |  |
| WHIRLPOOL CORP               | 10,300  | 252.95   | 2,605,385.00  |  |
| HASBRO INC                   | 21,400  | 99.15    | 2,121,810.00  |  |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A    | 40,200  | 83.81    | 3,369,162.00  |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 20,800  | 330.24   | 6,868,992.00  |  |
| NIKE INC-B                   | 208,300 | 137.81   | 28,705,823.00 |  |
| V F CORP                     | 56,300  | 89.88    | 5,060,244.00  |  |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 8,700   | 151.21   | 1,315,527.00  |  |
| ARAMARK                      | 39,000  | 38.09    | 1,485,510.00  |  |
| CARNIVAL CORP                | 129,000 | 26.76    | 3,452,040.00  |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 4,460   | 1,426.05 | 6,360,183.00  |  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 22,000  | 142.38   | 3,132,360.00  |  |
| DOMINOS PIZZA INC            | 6,310   | 432.47   | 2,728,885.70  |  |
| DRAFTKINGS INC - CL A        | 27,700  | 48.42    | 1,341,234.00  |  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 46,800  | 123.44   | 5,776,992.00  |  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 58,600  | 57.70    | 3,381,220.00  |  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA   | 46,400  | 146.69   | 6,806,416.00  |  |
| MCDONALD'S CORP              | 123,600 | 234.84   | 29,026,224.00 |  |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR   | 34,000  | 18.21    | 619,140.00    |  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 80,000  | 39.92    | 3,193,600.00  |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 38,600  | 84.29    | 3,253,594.00  |  |
| STARBUCKS CORP               | 194,900 | 114.34   | 22,284,866.00 |  |
| VAIL RESORTS INC             | 6,700   | 312.80   | 2,095,760.00  |  |
| WYNN RESORTS LTD             | 17,100  | 126.29   | 2,159,559.00  |  |
| YUM BRANDS INC               | 50,800  | 121.23   | 6,158,484.00  |  |

|                              |         |          |                |  |
|------------------------------|---------|----------|----------------|--|
| GENUINE PARTS CO             | 23,200  | 133.46   | 3,096,272.00   |  |
| LKQ CORP                     | 49,000  | 49.78    | 2,439,220.00   |  |
| POOL CORP                    | 6,500   | 444.01   | 2,886,065.00   |  |
| AMAZON.COM INC               | 70,670  | 3,291.61 | 232,618,078.70 |  |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 6,750   | 2,327.08 | 15,707,790.00  |  |
| CHEWY INC - CLASS A          | 12,300  | 71.00    | 873,300.00     |  |
| EBAY INC                     | 112,800 | 59.78    | 6,743,184.00   |  |
| ETSY INC                     | 20,900  | 165.51   | 3,459,159.00   |  |
| EXPEDIA GROUP INC            | 22,300  | 173.46   | 3,868,158.00   |  |
| MERCADOLIBRE INC             | 7,430   | 1,481.26 | 11,005,761.80  |  |
| WAYFAIR INC - CLASS A        | 11,500  | 305.49   | 3,513,135.00   |  |
| DOLLAR GENERAL CORP          | 41,800  | 220.20   | 9,204,360.00   |  |
| DOLLAR TREE INC              | 38,200  | 116.25   | 4,440,750.00   |  |
| TARGET CORP                  | 83,600  | 214.71   | 17,949,756.00  |  |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 10,900  | 204.47   | 2,228,723.00   |  |
| AUTOZONE                     | 3,770   | 1,507.20 | 5,682,144.00   |  |
| BEST BUY COMPANY INC         | 39,300  | 122.34   | 4,807,962.00   |  |
| BURLINGTON STORES INC        | 11,400  | 331.01   | 3,773,514.00   |  |
| CARMAX INC                   | 27,900  | 129.99   | 3,626,721.00   |  |
| CARVANA CO                   | 10,200  | 247.81   | 2,527,662.00   |  |
| HOME DEPOT                   | 178,400 | 339.25   | 60,522,200.00  |  |
| LOWES COS INC                | 121,400 | 208.40   | 25,299,760.00  |  |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,      | 11,830  | 562.32   | 6,652,245.60   |  |
| ROSS STORES INC              | 59,800  | 132.96   | 7,951,008.00   |  |
| TJX COS INC                  | 200,300 | 73.78    | 14,778,134.00  |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 19,500  | 195.46   | 3,811,470.00   |  |
| ULTA BEAUTY INC              | 8,600   | 322.74   | 2,775,564.00   |  |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 73,310  | 384.32   | 28,174,499.20  |  |
| KROGER CO                    | 126,000 | 37.73    | 4,753,980.00   |  |
| SYSCO CORP                   | 81,300  | 86.26    | 7,012,938.00   |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 120,300 | 54.53    | 6,559,959.00   |  |
| WALMART INC                  | 234,800 | 140.20   | 32,918,960.00  |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B       | 52,700  | 76.68    | 4,041,036.00   |  |
| COCA COLA CO                 | 676,500 | 54.51    | 36,876,015.00  |  |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | 32,600  | 56.81    | 1,852,006.00   |  |

|                             |         |        |               |  |
|-----------------------------|---------|--------|---------------|--|
| CONSTELLATION BRANDS INC-A  | 28,300  | 240.92 | 6,818,036.00  |  |
| KEURIG DR PEPPER INC        | 92,000  | 36.60  | 3,367,200.00  |  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B  | 31,400  | 59.51  | 1,868,614.00  |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP       | 66,600  | 91.25  | 6,077,250.00  |  |
| PEPSICO INC                 | 229,000 | 145.56 | 33,333,240.00 |  |
| ARCHER DANIELS MIDLAND      | 93,800  | 67.02  | 6,286,476.00  |  |
| BUNGE LIMITED               | 22,000  | 91.32  | 2,009,040.00  |  |
| CAMPBELL SOUP CO            | 30,900  | 49.55  | 1,531,095.00  |  |
| CONAGRA BRANDS INC          | 82,100  | 37.95  | 3,115,695.00  |  |
| GENERAL MILLS               | 102,800 | 63.05  | 6,481,540.00  |  |
| HERSHEY CO/THE              | 25,100  | 168.49 | 4,229,099.00  |  |
| HORMEL FOODS CORP           | 50,000  | 47.14  | 2,357,000.00  |  |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW       | 18,600  | 136.60 | 2,540,760.00  |  |
| KELLOGG CO                  | 43,300  | 66.95  | 2,898,935.00  |  |
| KRAFT HEINZ CO/THE          | 109,000 | 43.48  | 4,739,320.00  |  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC    | 23,900  | 78.97  | 1,887,383.00  |  |
| MCCORMICK & CO INC.         | 40,200  | 89.33  | 3,591,066.00  |  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC  | 238,600 | 61.85  | 14,757,410.00 |  |
| TYSON FOODS INC-CL A        | 50,100  | 78.82  | 3,948,882.00  |  |
| ALTRIA GROUP INC            | 310,500 | 49.95  | 15,509,475.00 |  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 258,600 | 97.41  | 25,190,226.00 |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC      | 39,800  | 87.43  | 3,479,714.00  |  |
| CLOROX CO                   | 21,300  | 183.01 | 3,898,113.00  |  |
| COLGATE PALMOLIVE CO.       | 136,300 | 82.18  | 11,201,134.00 |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP         | 57,200  | 135.50 | 7,750,600.00  |  |
| PROCTER & GAMBLE CO         | 410,900 | 135.15 | 55,533,135.00 |  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 37,800  | 303.35 | 11,466,630.00 |  |
| ABBOTT LABORATORIES         | 293,700 | 118.95 | 34,935,615.00 |  |
| ABIOMED INC                 | 7,200   | 296.81 | 2,137,032.00  |  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC        | 12,570  | 598.34 | 7,521,133.80  |  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.   | 85,500  | 86.62  | 7,406,010.00  |  |
| BECTON,DICKINSON            | 48,400  | 239.39 | 11,586,476.00 |  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP      | 235,000 | 43.13  | 10,135,550.00 |  |
| DANAHER CORP                | 106,000 | 258.48 | 27,398,880.00 |  |
| DENTSPLY SIRONA INC         | 35,200  | 68.47  | 2,410,144.00  |  |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| DEXCOM INC                   | 16,100  | 358.74 | 5,775,714.00  |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP    | 104,200 | 92.17  | 9,604,114.00  |  |
| HOLOGIC INC                  | 43,400  | 65.63  | 2,848,342.00  |  |
| IDEXX LABORATORIES INC       | 14,290  | 544.26 | 7,777,475.40  |  |
| INSULET CORP                 | 10,600  | 234.19 | 2,482,414.00  |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC       | 19,430  | 857.09 | 16,653,258.70 |  |
| MASIMO CORP                  | 8,200   | 224.16 | 1,838,112.00  |  |
| MEDTRONIC PLC                | 223,000 | 126.70 | 28,254,100.00 |  |
| NOVOCURE LTD                 | 14,000  | 192.45 | 2,694,300.00  |  |
| RESMED INC                   | 24,500  | 195.16 | 4,781,420.00  |  |
| STERIS PLC                   | 13,800  | 211.50 | 2,918,700.00  |  |
| STRYKER CORP                 | 56,500  | 254.78 | 14,395,070.00 |  |
| TELEFLEX INC                 | 7,560   | 412.55 | 3,118,878.00  |  |
| THE COOPER COMPANIES, INC.   | 9,100   | 404.34 | 3,679,494.00  |  |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 12,400  | 333.68 | 4,137,632.00  |  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 34,900  | 172.49 | 6,019,901.00  |  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 25,700  | 120.86 | 3,106,102.00  |  |
| ANTHEM INC                   | 40,900  | 396.57 | 16,219,713.00 |  |
| CARDINAL HEALTH INC          | 47,200  | 58.16  | 2,745,152.00  |  |
| CENTENE CORP                 | 97,500  | 70.45  | 6,868,875.00  |  |
| CIGNA CORP                   | 59,500  | 261.18 | 15,540,210.00 |  |
| CVS HEALTH CORP              | 218,400 | 85.11  | 18,588,024.00 |  |
| DAVITA INC                   | 12,500  | 126.80 | 1,585,000.00  |  |
| HCA HEALTHCARE INC           | 45,400  | 210.52 | 9,557,608.00  |  |
| HENRY SCHEIN INC             | 23,100  | 80.61  | 1,862,091.00  |  |
| HUMANA INC                   | 21,700  | 465.08 | 10,092,236.00 |  |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 15,800  | 278.14 | 4,394,612.00  |  |
| MCKESSON CORP                | 26,200  | 197.61 | 5,177,382.00  |  |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 9,700   | 267.84 | 2,598,048.00  |  |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 21,900  | 138.95 | 3,043,005.00  |  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 157,200 | 417.65 | 65,654,580.00 |  |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 13,000  | 155.19 | 2,017,470.00  |  |
| ABBVIE INC                   | 292,600 | 115.75 | 33,868,450.00 |  |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 36,900  | 170.43 | 6,288,867.00  |  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 18,700  | 131.30 | 2,455,310.00  |  |

|                             |           |        |               |  |
|-----------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| AMGEN INC                   | 96,100    | 254.21 | 24,429,581.00 |  |
| BIOGEN INC                  | 25,200    | 274.04 | 6,905,808.00  |  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 30,600    | 77.77  | 2,379,762.00  |  |
| EXACT SCIENCES CORP         | 25,800    | 104.50 | 2,696,100.00  |  |
| GILEAD SCIENCES INC         | 208,200   | 66.54  | 13,853,628.00 |  |
| INCYTE CORP                 | 31,200    | 82.74  | 2,581,488.00  |  |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC   | 21,400    | 36.54  | 781,956.00    |  |
| MODERNA INC                 | 46,300    | 163.15 | 7,553,845.00  |  |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC  | 14,200    | 91.04  | 1,292,768.00  |  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS   | 17,520    | 496.75 | 8,703,060.00  |  |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC    | 12,600    | 74.57  | 939,582.00    |  |
| SEAGEN INC                  | 20,700    | 139.49 | 2,887,443.00  |  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS      | 43,600    | 215.01 | 9,374,436.00  |  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO     | 374,200   | 64.44  | 24,113,448.00 |  |
| CATALENT INC                | 28,000    | 107.56 | 3,011,680.00  |  |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC    | 74,000    | 32.88  | 2,433,120.00  |  |
| ELI LILLY & CO.             | 142,700   | 195.42 | 27,886,434.00 |  |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC    | 35,900    | 87.93  | 3,156,687.00  |  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC    | 9,000     | 174.59 | 1,571,310.00  |  |
| JOHNSON & JOHNSON           | 436,200   | 168.50 | 73,499,700.00 |  |
| MERCK & CO INC              | 419,300   | 78.41  | 32,877,313.00 |  |
| PFIZER INC                  | 921,000   | 39.58  | 36,453,180.00 |  |
| ROYALTY PHARMA PLC-CL A     | 28,900    | 40.97  | 1,184,033.00  |  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR  | 173,000   | 10.40  | 1,799,200.00  |  |
| VIATRIS INC                 | 200,723   | 14.08  | 2,826,179.84  |  |
| ZOETIS INC                  | 79,400    | 171.55 | 13,621,070.00 |  |
| BANK OF AMERICA CORP        | 1,290,000 | 42.18  | 54,412,200.00 |  |
| CITIGROUP                   | 345,700   | 75.08  | 25,955,156.00 |  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP    | 70,000    | 49.44  | 3,460,800.00  |  |
| FIFTH THIRD BANCORP         | 120,000   | 42.35  | 5,082,000.00  |  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA      | 29,000    | 187.87 | 5,448,230.00  |  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC   | 172,000   | 15.80  | 2,717,600.00  |  |
| JPMORGAN CHASE & CO         | 505,100   | 161.24 | 81,442,324.00 |  |
| KEYCORP                     | 158,000   | 23.07  | 3,645,060.00  |  |
| M & T BANK CORP             | 21,700    | 163.15 | 3,540,355.00  |  |

|                              |         |          |               |  |
|------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| PNC FINANCIAL                | 69,800  | 198.91   | 13,883,918.00 |  |
| REGIONS FINANCIAL CORP       | 162,000 | 22.89    | 3,708,180.00  |  |
| SVB FINANCIAL GROUP          | 8,700   | 587.98   | 5,115,426.00  |  |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 225,300 | 61.57    | 13,871,721.00 |  |
| US BANCORP                   | 223,100 | 61.37    | 13,691,647.00 |  |
| WELLS FARGO CO               | 650,000 | 46.54    | 30,251,000.00 |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B  | 227,200 | 290.93   | 66,099,296.00 |  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 69,000  | 35.01    | 2,415,690.00  |  |
| VOYA FINANCIAL INC           | 21,700  | 70.00    | 1,519,000.00  |  |
| AFLAC INC                    | 108,900 | 56.11    | 6,110,379.00  |  |
| ALLEGHANY CORP               | 2,300   | 729.80   | 1,678,540.00  |  |
| ALLSTATE CORP                | 49,600  | 132.26   | 6,560,096.00  |  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 12,500  | 128.70   | 1,608,750.00  |  |
| AMERICAN INTL GROUP          | 145,000 | 51.19    | 7,422,550.00  |  |
| AON PLC                      | 37,500  | 258.52   | 9,694,500.00  |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 65,000  | 40.79    | 2,651,350.00  |  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 31,900  | 151.16   | 4,822,004.00  |  |
| ASSURANT INC                 | 10,200  | 160.71   | 1,639,242.00  |  |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A   | 21,200  | 63.05    | 1,336,660.00  |  |
| BROWN & BROWN INC            | 38,800  | 53.69    | 2,083,172.00  |  |
| CHUBB LTD                    | 74,300  | 176.39   | 13,105,777.00 |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 24,600  | 120.35   | 2,960,610.00  |  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 4,400   | 210.33   | 925,452.00    |  |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 6,200   | 273.10   | 1,693,220.00  |  |
| FNF GROUP                    | 45,400  | 46.19    | 2,097,026.00  |  |
| GLOBE LIFE INC               | 15,700  | 105.99   | 1,664,043.00  |  |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES  | 58,900  | 66.65    | 3,925,685.00  |  |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 29,900  | 69.30    | 2,072,070.00  |  |
| LOEWS CORP                   | 43,100  | 58.44    | 2,518,764.00  |  |
| MARKEL CORP                  | 2,330   | 1,220.37 | 2,843,462.10  |  |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 84,800  | 137.97   | 11,699,856.00 |  |
| METLIFE INC                  | 125,400 | 67.16    | 8,421,864.00  |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 44,400  | 66.66    | 2,959,704.00  |  |
| PROGRESSIVE CO               | 96,100  | 105.18   | 10,107,798.00 |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 66,600  | 105.95   | 7,056,270.00  |  |



|                                       |         |        |               |  |
|---------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA          | 10,500  | 126.26 | 1,325,730.00  |  |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD            | 7,800   | 164.88 | 1,286,064.00  |  |
| TRAVELERS COS INC/THE                 | 42,600  | 160.81 | 6,850,506.00  |  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC              | 21,800  | 270.07 | 5,887,526.00  |  |
| WR BERKLEY CORP                       | 23,900  | 81.45  | 1,946,655.00  |  |
| ACCENTURE PLC-CL A                    | 105,000 | 291.53 | 30,610,650.00 |  |
| AKAMAI TECHNOLOGIES                   | 27,400  | 110.81 | 3,036,194.00  |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESS                | 70,600  | 194.89 | 13,759,234.00 |  |
| BLACK KNIGHT INC                      | 27,000  | 75.15  | 2,029,050.00  |  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS<br>INC | 19,400  | 164.20 | 3,185,480.00  |  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP         | 87,500  | 74.81  | 6,546,312.50  |  |
| EPAM SYSTEMS INC                      | 9,500   | 460.20 | 4,371,900.00  |  |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION         | 103,500 | 151.59 | 15,689,565.00 |  |
| FISERV INC                            | 95,200  | 117.65 | 11,200,280.00 |  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC             | 13,500  | 285.66 | 3,856,410.00  |  |
| GARTNER INC                           | 14,100  | 234.00 | 3,299,400.00  |  |
| GLOBAL PAYMENTS INC                   | 49,200  | 201.41 | 9,909,372.00  |  |
| GODADDY INC - CLASS A                 | 26,900  | 81.06  | 2,180,514.00  |  |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES       | 148,500 | 145.46 | 21,600,810.00 |  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC           | 12,700  | 156.13 | 1,982,851.00  |  |
| MASTERCARD INC                        | 147,400 | 375.40 | 55,333,960.00 |  |
| MONGODB INC                           | 8,800   | 260.32 | 2,290,816.00  |  |
| OKTA INC                              | 20,300  | 237.27 | 4,816,581.00  |  |
| PAYCHEX INC                           | 54,800  | 101.01 | 5,535,348.00  |  |
| PAYPAL HOLDINGS INC                   | 184,500 | 253.36 | 46,744,920.00 |  |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A                 | 3,900   | 206.04 | 803,556.00    |  |
| SQUARE INC - A                        | 63,600  | 233.35 | 14,841,060.00 |  |
| TWILIO INC - A                        | 23,300  | 307.15 | 7,156,595.00  |  |
| VERISIGN INC                          | 17,600  | 222.89 | 3,922,864.00  |  |
| VISA INC-CLASS A SHARES               | 280,400 | 232.12 | 65,086,448.00 |  |
| WESTERN UNION CO                      | 66,000  | 25.11  | 1,657,260.00  |  |
| WIX.COM LTD                           | 9,400   | 288.79 | 2,714,626.00  |  |
| ADOBE INC                             | 79,490  | 488.73 | 38,849,147.70 |  |
| ANSYS INC                             | 14,500  | 332.38 | 4,819,510.00  |  |
| AUTODESK INC.                         | 36,700  | 285.76 | 10,487,392.00 |  |

|                                        |           |        |                |  |
|----------------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| AVALARA INC                            | 13,100    | 125.63 | 1,645,753.00   |  |
| CADENCE DESIGN SYS INC                 | 46,900    | 129.05 | 6,052,445.00   |  |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC               | 21,600    | 87.40  | 1,887,840.00   |  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | 18,700    | 119.87 | 2,241,569.00   |  |
| CITRIX SYSTEMS INC                     | 19,800    | 121.03 | 2,396,394.00   |  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A               | 32,900    | 71.62  | 2,356,298.00   |  |
| COUPA SOFTWARE INC                     | 11,400    | 237.84 | 2,711,376.00   |  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A           | 29,000    | 189.18 | 5,486,220.00   |  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL           | 7,100     | 120.23 | 853,633.00     |  |
| DATADOG INC - CLASS A                  | 29,300    | 77.29  | 2,264,597.00   |  |
| DOCUSIGN INC                           | 29,300    | 195.28 | 5,721,704.00   |  |
| DROPBOX INC-CLASS A                    | 51,000    | 24.70  | 1,259,700.00   |  |
| DYNATRACE INC                          | 29,000    | 46.78  | 1,356,620.00   |  |
| FAIR ISAAC CORP                        | 4,630     | 496.17 | 2,297,267.10   |  |
| FORTINET INC                           | 22,400    | 211.77 | 4,743,648.00   |  |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC                 | 13,600    | 98.70  | 1,342,320.00   |  |
| HUBSPOT INC                            | 7,040     | 509.66 | 3,588,006.40   |  |
| INTUIT INC                             | 43,300    | 401.04 | 17,365,032.00  |  |
| MICROSOFT CORP                         | 1,190,200 | 252.46 | 300,477,892.00 |  |
| NORTONLIFELOCK INC                     | 91,000    | 21.09  | 1,919,645.00   |  |
| ORACLE CORPORATION                     | 323,000   | 80.40  | 25,969,200.00  |  |
| PALO ALTO NETWORKS INC                 | 15,600    | 342.34 | 5,340,504.00   |  |
| PAYCOM SOFTWARE INC                    | 8,100     | 327.58 | 2,653,398.00   |  |
| PTC INC                                | 18,700    | 131.16 | 2,452,692.00   |  |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A                | 12,500    | 257.04 | 3,213,000.00   |  |
| SALESFORCE.COM INC                     | 150,800   | 216.50 | 32,648,200.00  |  |
| SERVICENOW INC                         | 32,330    | 483.51 | 15,631,878.30  |  |
| SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A            | 76,100    | 41.23  | 3,137,603.00   |  |
| SPLUNK INC                             | 27,000    | 117.82 | 3,181,140.00   |  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS             | 37,000    | 73.35  | 2,713,950.00   |  |
| SYNOPSYS INC                           | 25,500    | 241.84 | 6,166,920.00   |  |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A            | 6,860     | 661.43 | 4,537,409.80   |  |
| TYLER TECHNOLOGIES INC                 | 6,520     | 399.87 | 2,607,152.40   |  |
| VMWARE INC - CLASS A                   | 14,200    | 163.41 | 2,320,422.00   |  |
|                                        |           |        |                |  |

|                              |           |        |                |  |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| WORKDAY INC-CLASS A          | 29,100    | 236.71 | 6,888,261.00   |  |
| ZENDESK INC                  | 18,800    | 135.67 | 2,550,596.00   |  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 32,300    | 295.24 | 9,536,252.00   |  |
| ZSCALER INC                  | 11,900    | 169.32 | 2,014,908.00   |  |
| ARISTA NETWORKS INC          | 9,600     | 328.52 | 3,153,792.00   |  |
| CISCO SYSTEMS                | 700,200   | 53.43  | 37,411,686.00  |  |
| F5 NETWORKS INC              | 10,400    | 184.28 | 1,916,512.00   |  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 53,000    | 27.20  | 1,441,600.00   |  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 27,600    | 199.07 | 5,494,332.00   |  |
| APPLE INC                    | 2,817,400 | 130.21 | 366,853,654.00 |  |
| DELL TECHNOLOGIES-C          | 40,700    | 101.06 | 4,113,142.00   |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 220,000   | 16.48  | 3,625,600.00   |  |
| HP INC                       | 225,000   | 35.57  | 8,003,250.00   |  |
| NETAPP INC                   | 35,200    | 79.52  | 2,799,104.00   |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 37,300    | 91.56  | 3,415,188.00   |  |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 51,600    | 71.65  | 3,697,140.00   |  |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 100,400   | 68.11  | 6,838,244.00   |  |
| ARROW ELECTRS INC            | 12,100    | 117.50 | 1,421,750.00   |  |
| CDW CORPORATION              | 23,900    | 174.87 | 4,179,393.00   |  |
| COGNEX CORP                  | 27,800    | 77.58  | 2,156,724.00   |  |
| CORNING INC                  | 129,000   | 46.00  | 5,934,000.00   |  |
| IPG PHOTONICS CORP           | 5,900     | 197.30 | 1,164,070.00   |  |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC    | 30,400    | 143.41 | 4,359,664.00   |  |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 55,400    | 138.00 | 7,645,200.00   |  |
| TRIMBLE INC                  | 42,200    | 79.33  | 3,347,726.00   |  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 8,900     | 488.58 | 4,348,362.00   |  |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 199,300   | 78.81  | 15,706,833.00  |  |
| ANALOG DEVICES INC           | 61,800    | 157.26 | 9,718,668.00   |  |
| APPLIED MATERIALS            | 150,700   | 132.95 | 20,035,565.00  |  |
| BROADCOM INC                 | 66,860    | 452.58 | 30,259,498.80  |  |
| ENPHASE ENERGY INC           | 19,500    | 122.96 | 2,397,720.00   |  |
| INTEL CORP                   | 679,100   | 57.67  | 39,163,697.00  |  |
| KLA CORP                     | 25,500    | 319.70 | 8,152,350.00   |  |
| LAM RESEARCH                 | 23,730    | 630.54 | 14,962,714.20  |  |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 132,800   | 45.96  | 6,103,488.00   |  |
|                              |           |        |                |  |

|                              |           |        |               |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS    | 45,200    | 96.58  | 4,365,416.00  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         | 42,700    | 149.75 | 6,394,325.00  |
| MICRON TECHNOLOGY            | 184,500   | 85.98  | 15,863,310.00 |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 6,900     | 342.79 | 2,365,251.00  |
| NVIDIA CORP                  | 102,580   | 592.49 | 60,777,624.20 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 46,800    | 197.92 | 9,262,656.00  |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 68,000    | 38.63  | 2,626,840.00  |
| QORVO INC                    | 19,400    | 184.18 | 3,573,092.00  |
| QUALCOMM INC                 | 186,800   | 137.85 | 25,750,380.00 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 27,100    | 175.12 | 4,745,752.00  |
| SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC  | 8,200     | 220.40 | 1,807,280.00  |
| TERADYNE INC                 | 27,200    | 128.17 | 3,486,224.00  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 152,100   | 187.76 | 28,558,296.00 |
| XILINX INC                   | 41,200    | 124.43 | 5,126,516.00  |
| AT & T INC                   | 1,181,000 | 32.16  | 37,980,960.00 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A         | 24,000    | 27.72  | 665,280.00    |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C         | 64,000    | 27.80  | 1,779,200.00  |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC       | 147,000   | 13.99  | 2,056,530.00  |
| VERIZON COMMUNICATIONS       | 685,700   | 58.72  | 40,264,304.00 |
| T-MOBILE US INC              | 93,100    | 139.12 | 12,952,072.00 |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 40,900    | 56.74  | 2,320,666.00  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 83,400    | 87.19  | 7,271,646.00  |
| DUKE ENERGY CORP             | 123,000   | 100.86 | 12,405,780.00 |
| EDISON INTERNATIONAL         | 61,200    | 58.58  | 3,585,096.00  |
| ENTERGY CORP                 | 33,600    | 108.31 | 3,639,216.00  |
| EVERGY INC                   | 35,900    | 63.82  | 2,291,138.00  |
| EVERSOURCE ENERGY            | 56,400    | 84.07  | 4,741,548.00  |
| EXELON CORPORATION           | 163,700   | 44.68  | 7,314,116.00  |
| FIRSTENERGY CORP             | 86,600    | 37.52  | 3,249,232.00  |
| NEXTERA ENERGY INC           | 325,200   | 74.53  | 24,237,156.00 |
| NRG ENERGY INC               | 40,500    | 34.76  | 1,407,780.00  |
| OGE ENERGY CORP              | 32,500    | 33.93  | 1,102,725.00  |
| PG&E CORP                    | 237,000   | 10.94  | 2,592,780.00  |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP   | 19,100    | 86.12  | 1,644,892.00  |
| PPL CORPORATION              | 129,000   | 29.25  | 3,773,250.00  |
|                              |           |        |               |

|                               |         |        |               |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|
| SOUTHERN CO.                  | 176,700 | 66.26  | 11,708,142.00 |
| XCEL ENERGY INC               | 88,500  | 71.32  | 6,311,820.00  |
| ATMOS ENERGY CORP             | 20,200  | 103.00 | 2,080,600.00  |
| UGI CORP                      | 36,000  | 45.62  | 1,642,320.00  |
| AMEREN CORPORATION            | 41,500  | 84.98  | 3,526,670.00  |
| CENTERPOINT ENERGY INC        | 94,000  | 24.49  | 2,302,060.00  |
| CMS ENERGY CORP               | 48,200  | 63.99  | 3,084,318.00  |
| CONSOLIDATED EDISON INC       | 57,000  | 78.09  | 4,451,130.00  |
| DOMINION ENERGY INC           | 134,000 | 78.45  | 10,512,300.00 |
| DTE ENERGY COMPANY            | 32,800  | 141.69 | 4,647,432.00  |
| NISOURCE INC                  | 65,000  | 25.98  | 1,688,700.00  |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE         | 85,800  | 63.15  | 5,418,270.00  |
| SEMPRA ENERGY                 | 47,300  | 137.82 | 6,518,886.00  |
| WEC ENERGY GROUP INC          | 53,600  | 97.64  | 5,233,504.00  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC   | 30,600  | 152.77 | 4,674,762.00  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC       | 39,600  | 46.64  | 1,846,944.00  |
| ALLY FINANCIAL INC            | 63,000  | 54.10  | 3,408,300.00  |
| AMERICAN EXPRESS CO           | 113,600 | 158.98 | 18,060,128.00 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 76,600  | 157.71 | 12,080,586.00 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 50,000  | 119.46 | 5,973,000.00  |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 86,000  | 45.90  | 3,947,400.00  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 19,200  | 265.65 | 5,100,480.00  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC  | 27,500  | 58.22  | 1,601,050.00  |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP   | 134,300 | 51.82  | 6,959,426.00  |
| BLACKROCK INC                 | 25,430  | 873.83 | 22,221,496.90 |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A    | 112,600 | 90.04  | 10,138,504.00 |
| CARLYLE GROUP INC/THE         | 22,000  | 44.98  | 989,560.00    |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC       | 17,900  | 108.10 | 1,934,990.00  |
| CME GROUP INC                 | 60,000  | 202.92 | 12,175,200.00 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC  | 6,400   | 337.05 | 2,157,120.00  |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 51,000  | 34.10  | 1,739,100.00  |
| GOLDMAN SACHS GROUP           | 54,300  | 370.89 | 20,139,327.00 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 93,000  | 114.81 | 10,677,330.00 |
| INVESCO LTD                   | 68,000  | 28.38  | 1,929,840.00  |
| KKR & CO INC-A                | 85,500  | 58.72  | 5,020,560.00  |
|                               |         |        |               |

|                              |         |          |               |
|------------------------------|---------|----------|---------------|
| MARKETAXESS HOLDINGS INC     | 6,130   | 437.17   | 2,679,852.10  |
| MOODYS CORP                  | 28,300  | 334.50   | 9,466,350.00  |
| MORGAN STANLEY               | 233,100 | 87.70    | 20,442,870.00 |
| MSCI INC                     | 13,720  | 482.31   | 6,617,293.20  |
| NASDAQ INC                   | 18,400  | 164.56   | 3,027,904.00  |
| NORTHERN TRUST CORP          | 32,100  | 119.28   | 3,828,888.00  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC  | 19,600  | 136.64   | 2,678,144.00  |
| S&P GLOBAL INC               | 39,600  | 390.71   | 15,472,116.00 |
| SCHWAB(CHARLES)CORP          | 253,900 | 71.75    | 18,217,325.00 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      | 19,100  | 63.27    | 1,208,457.00  |
| STATE STREET CORP            | 59,600  | 87.23    | 5,198,908.00  |
| T ROWE PRICE GROUP INC       | 38,200  | 189.23   | 7,228,586.00  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 16,400  | 82.53    | 1,353,492.00  |
| AES CORP                     | 110,000 | 25.79    | 2,836,900.00  |
| VISTRA CORP                  | 70,000  | 16.05    | 1,123,500.00  |
| CERNER CORP                  | 52,000  | 76.68    | 3,987,360.00  |
| TELADOC HEALTH INC           | 19,300  | 151.04   | 2,915,072.00  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 22,700  | 259.96   | 5,901,092.00  |
| IOX GENOMICS INC-CLASS A     | 10,000  | 146.36   | 1,463,600.00  |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 51,900  | 133.90   | 6,949,410.00  |
| AVANTOR INC                  | 84,000  | 31.22    | 2,622,480.00  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A       | 3,640   | 608.01   | 2,213,156.40  |
| ILLUMINA INC                 | 24,430  | 383.94   | 9,379,654.20  |
| IQVIA HOLDINGS INC           | 32,200  | 234.39   | 7,547,358.00  |
| METTLER-TOLEDO INTL          | 3,870   | 1,278.56 | 4,948,027.20  |
| PERKINELMER INC              | 18,800  | 140.97   | 2,650,236.00  |
| PPD INC                      | 20,000  | 46.10    | 922,000.00    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 65,500  | 468.45   | 30,683,475.00 |
| WATERS CORP                  | 10,500  | 314.65   | 3,303,825.00  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 22,600  | 84.11    | 1,900,886.00  |
| COSTAR GROUP INC             | 6,620   | 850.67   | 5,631,435.40  |
| EQUIFAX INC                  | 19,700  | 239.56   | 4,719,332.00  |
| IHS MARKIT LTD               | 63,800  | 107.87   | 6,882,106.00  |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 21,300  | 139.95   | 2,980,935.00  |
| LEIDOS HOLDINGS INC          | 21,500  | 104.03   | 2,236,645.00  |
|                              | 20,300  | 90.32    | 1,833,496.00  |

|                                   |         |          |                |  |
|-----------------------------------|---------|----------|----------------|--|
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC     |         |          |                |  |
| TRUNSON                           | 31,100  | 106.21   | 3,303,131.00   |  |
| VERISK ANALYTICS INC              | 26,000  | 178.77   | 4,648,020.00   |  |
| CBRE GROUP INC                    | 54,800  | 86.90    | 4,762,120.00   |  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD        | 184,000 | 4.86     | 894,240.00     |  |
| ALTICE USA INC-A                  | 36,000  | 37.14    | 1,337,040.00   |  |
| CABLE ONE INC                     | 820     | 1,756.23 | 1,440,108.60   |  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A      | 23,050  | 693.44   | 15,983,792.00  |  |
| COMCAST CORP-CL A                 | 756,600 | 58.11    | 43,966,026.00  |  |
| DISCOVERY INC - A                 | 24,500  | 37.56    | 920,220.00     |  |
| DISCOVERY INC - C                 | 49,100  | 32.62    | 1,601,642.00   |  |
| DISH NETWORK CORP-A               | 38,400  | 46.53    | 1,786,752.00   |  |
| FOX CORP-CLASS A                  | 58,000  | 38.32    | 2,222,560.00   |  |
| FOX CORP-CLASS B                  | 25,400  | 37.17    | 944,118.00     |  |
| INTERPUBRIC GROUP                 | 67,000  | 33.47    | 2,242,490.00   |  |
| LIBERTY BROADBAND CORP-A          | 4,000   | 161.65   | 646,600.00     |  |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C          | 25,900  | 166.37   | 4,308,983.00   |  |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C            | 29,900  | 42.85    | 1,281,215.00   |  |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP            | 12,900  | 42.61    | 549,669.00     |  |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I            | 67,000  | 27.44    | 1,838,480.00   |  |
| OMNICOM GROUP                     | 34,500  | 84.96    | 2,931,120.00   |  |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC            | 175,000 | 6.04     | 1,057,000.00   |  |
| VIACOMCBS INC-CLASS B             | 95,100  | 39.39    | 3,745,989.00   |  |
| ACTIVISION BLIZZARD INC           | 129,000 | 94.80    | 12,229,200.00  |  |
| DISNEY (WALT) CO                  | 300,000 | 184.84   | 55,452,000.00  |  |
| ELECTRONIC ARTS                   | 48,500  | 142.42   | 6,907,370.00   |  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C      | 34,000  | 44.25    | 1,504,500.00   |  |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN      | 26,600  | 79.96    | 2,126,936.00   |  |
| NETFLIX INC                       | 73,210  | 503.84   | 36,886,126.40  |  |
| ROKU INC                          | 17,580  | 317.00   | 5,572,860.00   |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 19,400  | 170.07   | 3,299,358.00   |  |
| ALPHABET INC-CL A                 | 49,820  | 2,351.93 | 117,173,152.60 |  |
| ALPHABET INC-CL C                 | 49,200  | 2,398.69 | 118,015,548.00 |  |
| FACEBOOK INC-A                    | 398,400 | 319.08   | 127,121,472.00 |  |
| IAC/INTERACTIVE CORP              | 13,600  | 241.40   | 3,283,040.00   |  |

|       |                                |         |        |                   |       |
|-------|--------------------------------|---------|--------|-------------------|-------|
| 小計    | MATCH GROUP INC                | 41,600  | 146.19 | 6,081,504.00      |       |
|       | PINTEREST INC- CLASS A         | 84,700  | 59.86  | 5,070,142.00      |       |
|       | SNAP INC-A                     | 152,200 | 54.70  | 8,325,340.00      |       |
|       | TWITTER INC                    | 132,800 | 53.79  | 7,143,312.00      |       |
|       | ZILLOW GROUP INC - A           | 9,800   | 119.40 | 1,170,120.00      |       |
|       | ZILLOW GROUP INC - C           | 24,600  | 118.54 | 2,916,207.00      |       |
|       | 銘柄数：591                        |         |        | 6,140,605,633.96  |       |
|       | 組入時価比率：68.7%                   |         |        | (667,913,674,805) | 71.6% |
| カナダドル | CAMECO CORP                    | 72,000  | 24.44  | 1,759,680.00      |       |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 199,000 | 41.70  | 8,298,300.00      |       |
|       | CENOVUS ENERGY INC             | 216,000 | 9.57   | 2,067,120.00      |       |
|       | ENBRIDGE INC                   | 333,000 | 48.09  | 16,013,970.00     |       |
|       | IMPERIAL OIL                   | 37,500  | 38.09  | 1,428,375.00      |       |
|       | INTER PIPELINE LTD             | 75,000  | 17.94  | 1,345,500.00      |       |
|       | KEYERA CORP                    | 34,000  | 28.89  | 982,260.00        |       |
|       | PARKLAND CORP                  | 21,700  | 39.82  | 864,094.00        |       |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP          | 88,000  | 38.06  | 3,349,280.00      |       |
|       | SUNCOR ENERGY INC              | 249,000 | 28.66  | 7,136,340.00      |       |
|       | TC ENERGY CORP                 | 158,000 | 61.94  | 9,786,520.00      |       |
|       | NUTRIEN LTD                    | 96,100  | 74.54  | 7,163,294.00      |       |
|       | CCL INDUSTRIES INC - CL B      | 24,700  | 71.41  | 1,763,827.00      |       |
|       | AGNICO EAGLE MINES LTD         | 41,000  | 83.93  | 3,441,130.00      |       |
|       | B2GOLD CORP                    | 175,000 | 6.28   | 1,099,000.00      |       |
|       | BARRICK GOLD                   | 299,000 | 29.02  | 8,676,980.00      |       |
|       | FIRST QUANTUM MINERALS LTD     | 93,000  | 33.70  | 3,134,100.00      |       |
|       | FRANCO-NEVADA CORP             | 32,300  | 179.58 | 5,800,434.00      |       |
|       | KINROSS GOLD CORP              | 217,000 | 9.39   | 2,037,630.00      |       |
|       | KIRKLAND LAKE GOLD LTD         | 42,700  | 49.60  | 2,117,920.00      |       |
|       | LUNDIN MINING CORP             | 118,000 | 14.84  | 1,751,120.00      |       |
|       | PAN AMERICAN SILVER CORP       | 35,300  | 42.50  | 1,500,250.00      |       |
|       | SSR MINING INC                 | 34,000  | 21.07  | 716,380.00        |       |
|       | TECK RESOURCES LTD-CLS B       | 79,000  | 31.09  | 2,456,110.00      |       |
|       | WHEATON PRECIOUS METALS CORP   | 76,100  | 53.16  | 4,045,476.00      |       |
|       | YAMANA GOLD INC                | 164,000 | 6.16   | 1,010,240.00      |       |



|                                        |         |        |               |  |
|----------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| WEST FRASER TIMBER                     | 14,000  | 104.96 | 1,469,440.00  |  |
| CAE INC                                | 50,000  | 38.07  | 1,903,500.00  |  |
| WSP GLOBAL INC                         | 19,800  | 127.83 | 2,531,034.00  |  |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC              | 37,000  | 18.69  | 691,530.00    |  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD                | 12,800  | 105.30 | 1,347,840.00  |  |
| GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT         | 30,000  | 39.65  | 1,189,500.00  |  |
| RITCHIE BROS. AUCTIONEERS              | 18,300  | 81.42  | 1,489,986.00  |  |
| AIR CANADA                             | 32,000  | 24.92  | 797,440.00    |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO               | 118,600 | 136.42 | 16,179,412.00 |  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD           | 22,100  | 483.02 | 10,674,742.00 |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC                | 48,200  | 119.52 | 5,760,864.00  |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                  | 31,800  | 44.47  | 1,414,146.00  |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL<br>INC | 49,400  | 84.38  | 4,168,372.00  |  |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A               | 10,200  | 199.44 | 2,034,288.00  |  |
| DOLLARAMA INC                          | 46,600  | 54.10  | 2,521,060.00  |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B             | 145,000 | 41.86  | 6,069,700.00  |  |
| EMPIRE CO LTD A                        | 26,000  | 39.91  | 1,037,660.00  |  |
| LOBLAW COMPANIES                       | 28,500  | 70.61  | 2,012,385.00  |  |
| METRO INC                              | 43,500  | 57.52  | 2,502,120.00  |  |
| WESTON(GEORGE)LTD                      | 12,300  | 111.73 | 1,374,279.00  |  |
| SAPUTO INC                             | 41,000  | 39.70  | 1,627,700.00  |  |
| BAUSCH HEALTH COS INC                  | 51,000  | 34.08  | 1,738,080.00  |  |
| CANOPY GROWTH CORP                     | 35,000  | 30.68  | 1,073,800.00  |  |
| BANK OF MONTREAL                       | 105,600 | 117.84 | 12,443,904.00 |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX            | 199,400 | 79.43  | 15,838,342.00 |  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF<br>COMMERCE  | 75,000  | 130.70 | 9,802,500.00  |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA                | 55,000  | 90.88  | 4,998,400.00  |  |
| ROYAL BANK OF CANADA                   | 234,800 | 120.26 | 28,237,048.00 |  |
| TORONTO DOMINION BANK                  | 300,700 | 86.10  | 25,890,270.00 |  |
| ONEX CORPORATION                       | 13,200  | 84.91  | 1,120,812.00  |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD            | 4,140   | 575.50 | 2,382,570.00  |  |
| GREAT-WEST LIFE CO INC                 | 42,000  | 36.26  | 1,522,920.00  |  |
| IA FINANCIAL CORP INC                  | 18,300  | 70.83  | 1,296,189.00  |  |
| INTACT FINANCIAL CORP                  | 24,500  | 164.94 | 4,041,030.00  |  |

|     |                              |         |          |                  |  |
|-----|------------------------------|---------|----------|------------------|--|
|     | MANULIFE FINANCIAL CORP      | 326,000 | 25.85    | 8,427,100.00     |  |
|     | POWER CORPORATION OF CANADA  | 97,000  | 36.69    | 3,558,930.00     |  |
|     | SUN LIFE FINANCIAL INC       | 98,800  | 66.20    | 6,540,560.00     |  |
|     | CGI INC                      | 37,200  | 110.56   | 4,112,832.00     |  |
|     | SHOPIFY INC - CLASS A        | 18,240  | 1,345.36 | 24,539,366.40    |  |
|     | BLACKBERRY LTD               | 94,000  | 10.28    | 966,320.00       |  |
|     | CONSTELLATION SOFTWARE INC   | 3,410   | 1,802.86 | 6,147,752.60     |  |
|     | OPEN TEXT CORP               | 47,000  | 58.17    | 2,733,990.00     |  |
|     | BCE INC                      | 25,600  | 59.11    | 1,513,216.00     |  |
|     | TELUS CORP                   | 58,600  | 26.29    | 1,540,594.00     |  |
|     | ROGERS COMMUNICATIONS-CL B   | 58,200  | 61.64    | 3,587,448.00     |  |
|     | EMERA INC                    | 42,500  | 56.12    | 2,385,100.00     |  |
|     | FORTIS INC                   | 75,300  | 54.97    | 4,139,241.00     |  |
|     | HYDRO ONE LTD                | 55,000  | 29.81    | 1,639,550.00     |  |
|     | ALTAGAS LTD                  | 42,000  | 23.99    | 1,007,580.00     |  |
|     | ALGONQUIN POWER & UTILITIES  | 97,000  | 19.29    | 1,871,130.00     |  |
|     | ATCO LTD CLI                 | 13,000  | 42.47    | 552,110.00       |  |
|     | CANADIAN UTILITIES LTD A     | 20,300  | 34.94    | 709,282.00       |  |
|     | BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 210,800 | 56.33    | 11,874,364.00    |  |
|     | IGM FINANCIAL INC            | 15,000  | 44.79    | 671,850.00       |  |
|     | TMX GROUP LTD                | 9,500   | 134.91   | 1,281,645.00     |  |
|     | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A   | 18,750  | 48.44    | 908,250.00       |  |
|     | NORTHLAND POWER INC          | 30,000  | 39.24    | 1,177,200.00     |  |
|     | THOMSON REUTERS CORP         | 27,800  | 118.04   | 3,281,512.00     |  |
|     | FIRSTSERVICE CORP            | 6,000   | 198.36   | 1,190,160.00     |  |
|     | QUEBECOR INC-CL B            | 27,000  | 34.12    | 921,240.00       |  |
|     | SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 77,000  | 35.92    | 2,765,840.00     |  |
| 小計  | 銘柄数：87                       |         |          | 378,972,356.00   |  |
|     |                              |         |          | (34,005,189,503) |  |
|     | 組入時価比率：3.5%                  |         |          | 3.6%             |  |
| ユーロ | TENARIS SA                   | 71,000  | 9.54     | 677,482.00       |  |
|     | ENI SPA                      | 411,000 | 10.32    | 4,241,520.00     |  |
|     | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS  | 81,000  | 10.14    | 821,745.00       |  |
|     | NESTE OYJ                    | 71,400  | 51.72    | 3,692,808.00     |  |
|     | OMV AG                       | 25,000  | 44.16    | 1,104,000.00     |  |

|                             |         |        |               |  |
|-----------------------------|---------|--------|---------------|--|
| REPSOL SA                   | 244,896 | 10.80  | 2,645,366.59  |  |
| TOTAL SE                    | 415,900 | 39.05  | 16,240,895.00 |  |
| VOPAK                       | 11,400  | 37.89  | 431,946.00    |  |
| AIR LIQUIDE SA              | 79,100  | 143.28 | 11,333,448.00 |  |
| AKZO NOBEL                  | 31,200  | 103.45 | 3,227,640.00  |  |
| ARKEMA                      | 11,600  | 108.20 | 1,255,120.00  |  |
| BASF SE                     | 151,200 | 70.38  | 10,641,456.00 |  |
| COVESTRO AG                 | 30,500  | 58.02  | 1,769,610.00  |  |
| EVONIK INDUSTRIES AG        | 33,000  | 30.04  | 991,320.00    |  |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD      | 10,500  | 43.92  | 461,160.00    |  |
| KONINKLIJKE DSM NV          | 29,100  | 152.25 | 4,430,475.00  |  |
| LANXESS                     | 12,700  | 64.44  | 818,388.00    |  |
| SOLVAY SA                   | 11,600  | 112.45 | 1,304,420.00  |  |
| SYMRISE AG                  | 20,900  | 107.20 | 2,240,480.00  |  |
| UMICORE                     | 34,300  | 51.48  | 1,765,764.00  |  |
| CRH PLC                     | 132,200 | 41.94  | 5,544,468.00  |  |
| HEIDELBERGCEMENT AG         | 24,900  | 74.60  | 1,857,540.00  |  |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 42,300  | 44.02  | 1,862,046.00  |  |
| ARCELORMITTAL               | 119,000 | 26.99  | 3,211,810.00  |  |
| VOESTALPINE AG              | 20,000  | 38.10  | 762,000.00    |  |
| STORA ENSO OYJ-R            | 96,000  | 16.03  | 1,538,880.00  |  |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 91,000  | 33.07  | 3,009,370.00  |  |
| AIRBUS SE                   | 96,800  | 98.37  | 9,522,216.00  |  |
| DASSAULT AVIATION SA        | 330     | 966.50 | 318,945.00    |  |
| MTU AERO ENGINES AG         | 9,200   | 212.40 | 1,954,080.00  |  |
| SAFRAN SA                   | 53,800  | 125.20 | 6,735,760.00  |  |
| THALES SA                   | 18,600  | 86.04  | 1,600,344.00  |  |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)  | 82,800  | 56.38  | 4,668,264.00  |  |
| KINGSPAN GROUP PLC          | 26,400  | 76.46  | 2,018,544.00  |  |
| ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV | 37,099  | 28.37  | 1,052,498.63  |  |
| BOUYGUES                    | 40,000  | 35.07  | 1,402,800.00  |  |
| EIFFAGE SA                  | 14,100  | 94.34  | 1,330,194.00  |  |
| FERROVIAL SA                | 79,790  | 24.97  | 1,992,356.30  |  |
| HOCHTIEF AG                 | 3,800   | 75.60  | 287,280.00    |  |
| VINCI                       | 87,300  | 95.69  | 8,353,737.00  |  |
|                             |         |        |               |  |

|                                    |         |        |               |  |
|------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| LEGRAND SA                         | 45,200  | 85.76  | 3,876,352.00  |  |
| PRYSMIAN SPA                       | 43,000  | 26.45  | 1,137,350.00  |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE              | 88,700  | 134.96 | 11,970,952.00 |  |
| SIEMENS ENERGY AG                  | 66,000  | 26.23  | 1,731,180.00  |  |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | 38,000  | 27.70  | 1,052,600.00  |  |
| SIEMENS AG                         | 126,300 | 144.28 | 18,222,564.00 |  |
| ALSTOM                             | 43,300  | 46.66  | 2,020,378.00  |  |
| CNH INDUSTRIAL NV                  | 170,000 | 13.72  | 2,333,250.00  |  |
| GEA GROUP AG                       | 24,200  | 36.43  | 881,606.00    |  |
| KION GROUP AG                      | 11,000  | 84.10  | 925,100.00    |  |
| KNORR-BREMSE AG                    | 12,700  | 104.25 | 1,323,975.00  |  |
| KONE OYJ                           | 57,400  | 68.10  | 3,908,940.00  |  |
| RATIONAL AG                        | 830     | 774.40 | 642,752.00    |  |
| WARTSILA OYJ                       | 66,000  | 10.71  | 706,860.00    |  |
| BRENNTAG SE                        | 26,800  | 76.20  | 2,042,160.00  |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG               | 165,900 | 51.00  | 8,460,900.00  |  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG             | 56,000  | 11.23  | 629,328.00    |  |
| ADP                                | 4,700   | 115.55 | 543,085.00    |  |
| AENA SME SA                        | 11,700  | 150.30 | 1,758,510.00  |  |
| ATLANTIA SPA                       | 79,000  | 16.29  | 1,286,910.00  |  |
| GETLINK                            | 72,000  | 13.69  | 986,040.00    |  |
| CONTINENTAL AG                     | 18,900  | 114.62 | 2,166,318.00  |  |
| FAURECIA                           | 20,688  | 44.80  | 926,822.40    |  |
| MICHELIN (CGDE)                    | 28,700  | 123.70 | 3,550,190.00  |  |
| VALEO SA                           | 37,300  | 27.74  | 1,034,702.00  |  |
| BAYER MOTOREN WERK                 | 55,900  | 83.64  | 4,675,476.00  |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD       | 10,200  | 69.25  | 706,350.00    |  |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES       | 143,100 | 73.41  | 10,504,971.00 |  |
| FERRARI NV                         | 21,300  | 165.50 | 3,525,150.00  |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE       | 25,400  | 87.50  | 2,222,500.00  |  |
| RENAULT SA                         | 33,700  | 34.15  | 1,150,855.00  |  |
| STELLANTIS NV                      | 334,074 | 14.94  | 4,991,733.70  |  |
| VOLKSWAGEN AG                      | 5,100   | 261.40 | 1,333,140.00  |  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                 | 31,200  | 210.75 | 6,575,400.00  |  |
| SEB SA                             | 4,180   | 154.40 | 645,392.00    |  |

|                                     |         |          |               |  |
|-------------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| ADIDAS AG                           | 31,300  | 280.60   | 8,782,780.00  |  |
| ESSILORLUXOTTICA                    | 47,800  | 140.70   | 6,725,460.00  |  |
| HERMES INTERNATIONAL                | 5,330   | 1,073.00 | 5,719,090.00  |  |
| KERING SA                           | 12,700  | 695.10   | 8,827,770.00  |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 46,000  | 631.40   | 29,044,400.00 |  |
| MONCLER SPA                         | 32,100  | 51.26    | 1,645,446.00  |  |
| PUMA SE                             | 16,300  | 89.82    | 1,464,066.00  |  |
| ACCOR SA                            | 32,000  | 33.47    | 1,071,040.00  |  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC           | 26,600  | 168.65   | 4,486,090.00  |  |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM          | 15,400  | 43.02    | 662,508.00    |  |
| SODEXO                              | 13,800  | 86.24    | 1,190,112.00  |  |
| DELIVERY HERO SE                    | 22,100  | 125.25   | 2,768,025.00  |  |
| HELLOFRESH SE                       | 24,000  | 65.48    | 1,571,520.00  |  |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV            | 20,600  | 81.86    | 1,686,316.00  |  |
| PROSUS NV                           | 81,600  | 89.74    | 7,322,784.00  |  |
| ZALANDO SE                          | 24,900  | 86.68    | 2,158,332.00  |  |
| INDITEX SA                          | 184,000 | 30.78    | 5,663,520.00  |  |
| CARREFOUR SUPERMARCHÉ               | 95,000  | 16.52    | 1,569,400.00  |  |
| COLRUYT SA                          | 8,700   | 49.75    | 432,825.00    |  |
| JERONIMO MARTINS                    | 38,000  | 15.49    | 588,620.00    |  |
| KESKO OYJ-B SHS                     | 44,000  | 26.00    | 1,144,000.00  |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV       | 186,000 | 23.05    | 4,288,230.00  |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV          | 127,700 | 61.28    | 7,825,456.00  |  |
| DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV            | 91,000  | 10.28    | 935,480.00    |  |
| HEINEKEN HOLDING NV                 | 20,000  | 84.75    | 1,695,000.00  |  |
| HEINEKEN NV                         | 43,800  | 99.44    | 4,355,472.00  |  |
| PERNOD RICARD SA                    | 34,300  | 174.15   | 5,973,345.00  |  |
| REMY COINTREAU                      | 3,900   | 166.00   | 647,400.00    |  |
| DANONE                              | 103,800 | 59.16    | 6,140,808.00  |  |
| JDE PEET'S BV                       | 11,000  | 32.50    | 357,500.00    |  |
| KERRY GROUP PLC-A                   | 25,900  | 109.50   | 2,836,050.00  |  |
| HENKEL AG & CO KGAA                 | 18,000  | 83.00    | 1,494,000.00  |  |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG          | 28,900  | 95.92    | 2,772,088.00  |  |
| BEIERSDORF AG                       | 16,000  | 96.06    | 1,536,960.00  |  |
| LOREAL-ORD                          | 42,000  | 349.90   | 14,695,800.00 |  |

|                                      |           |        |               |  |
|--------------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| BIOMERIEUX                           | 6,900     | 96.94  | 668,886.00    |  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR             | 7,200     | 145.05 | 1,044,360.00  |  |
| DIASORIN SPA                         | 4,000     | 140.80 | 563,200.00    |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV               | 152,700   | 48.07  | 7,340,289.00  |  |
| SARTORIUS AG-VORZUG                  | 5,790     | 448.10 | 2,594,499.00  |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG              | 46,000    | 48.79  | 2,244,340.00  |  |
| AMPLIFON SPA                         | 20,300    | 35.83  | 727,349.00    |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE               | 36,600    | 64.64  | 2,365,824.00  |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA               | 67,300    | 41.66  | 2,804,054.50  |  |
| ORPEA                                | 9,300     | 106.50 | 990,450.00    |  |
| ARGENX SE                            | 7,600     | 219.10 | 1,665,160.00  |  |
| GALAPAGOS NV                         | 7,000     | 63.14  | 441,980.00    |  |
| GRIFOLS SA                           | 46,800    | 23.32  | 1,091,376.00  |  |
| BAYER AG-REG                         | 161,600   | 54.13  | 8,747,408.00  |  |
| IPSEN                                | 5,500     | 80.46  | 442,530.00    |  |
| MERCK KGAA                           | 21,100    | 142.75 | 3,012,025.00  |  |
| ORION OYJ                            | 16,500    | 36.52  | 602,580.00    |  |
| RECORDATI SPA                        | 16,800    | 45.02  | 756,336.00    |  |
| SANOFI                               | 186,900   | 85.44  | 15,968,736.00 |  |
| UCB SA                               | 20,600    | 76.66  | 1,579,196.00  |  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA                 | 70,000    | 10.94  | 766,080.00    |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. | 1,090,000 | 4.82   | 5,255,435.00  |  |
| BANCO SANTANDER SA                   | 2,850,000 | 3.21   | 9,165,600.00  |  |
| BNP PARIBAS                          | 185,000   | 54.78  | 10,134,300.00 |  |
| CAIXABANK                            | 760,000   | 2.69   | 2,045,920.00  |  |
| COMMERZBANK AG                       | 158,000   | 5.61   | 887,012.00    |  |
| CREDIT AGRICOLE SA                   | 184,000   | 12.87  | 2,368,080.00  |  |
| ERSTE GROUP BANK AG                  | 49,000    | 31.20  | 1,528,800.00  |  |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA          | 101,000   | 14.14  | 1,428,645.00  |  |
| ING GROEP NV                         | 639,000   | 10.81  | 6,910,146.00  |  |
| INTESA SANPAOLO                      | 2,780,000 | 2.36   | 6,566,360.00  |  |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD       | 139,810   | 0.00   | 0.00          |  |
| KBC GROEP NV                         | 40,900    | 66.32  | 2,712,488.00  |  |
| MEDIOBANCA S.P.A.                    | 107,000   | 9.52   | 1,019,282.00  |  |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG     | 20,100    | 18.70  | 375,870.00    |  |

|                            |         |          |               |  |
|----------------------------|---------|----------|---------------|--|
| SOCIETE GENERALE           | 129,000 | 24.91    | 3,213,390.00  |  |
| UNICREDIT SPA              | 361,000 | 9.35     | 3,375,350.00  |  |
| EURAZEO SE                 | 5,953   | 70.15    | 417,602.95    |  |
| EXOR NV                    | 17,200  | 69.04    | 1,187,488.00  |  |
| GROUPE BRUXELLES LAM       | 19,500  | 91.14    | 1,777,230.00  |  |
| SOFINA SA                  | 2,300   | 317.60   | 730,480.00    |  |
| WENDEL                     | 4,300   | 114.70   | 493,210.00    |  |
| AEGON NV                   | 293,000 | 3.95     | 1,159,108.00  |  |
| AGEAS                      | 28,900  | 51.44    | 1,486,616.00  |  |
| ALLIANZ SE-REG             | 68,000  | 214.35   | 14,575,800.00 |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI     | 188,000 | 17.37    | 3,265,560.00  |  |
| AXA SA                     | 317,000 | 22.73    | 7,205,410.00  |  |
| CNP ASSURANCES             | 28,000  | 15.00    | 420,000.00    |  |
| HANNOVER RUECK SE          | 9,600   | 152.75   | 1,466,400.00  |  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 22,900  | 248.70   | 5,695,230.00  |  |
| NN GROUP NV                | 47,000  | 42.65    | 2,004,550.00  |  |
| POSTE ITALIANE SPA         | 88,000  | 11.00    | 968,000.00    |  |
| SAMPO OYJ-A SHS            | 80,400  | 40.49    | 3,255,396.00  |  |
| SCOR SE                    | 23,200  | 28.16    | 653,312.00    |  |
| ADYEN NV                   | 3,050   | 1,913.00 | 5,834,650.00  |  |
| AMADEUS IT GROUP SA        | 76,000  | 59.02    | 4,485,520.00  |  |
| ATOS SE                    | 15,300  | 56.24    | 860,472.00    |  |
| BECHTLE AG                 | 4,400   | 163.20   | 718,080.00    |  |
| CAPGEMINI SA               | 27,300  | 155.10   | 4,234,230.00  |  |
| EDENRED                    | 42,400  | 46.98    | 1,991,952.00  |  |
| NEXI SPA                   | 74,000  | 15.62    | 1,155,880.00  |  |
| WORLDLINE SA               | 38,699  | 78.38    | 3,033,227.62  |  |
| DASSAULT SYSTEMES SA       | 22,300  | 188.55   | 4,204,665.00  |  |
| NEMETSCHEK SE              | 9,200   | 57.96    | 533,232.00    |  |
| SAP SE                     | 172,400 | 117.36   | 20,232,864.00 |  |
| TEAMVIEWER AG              | 25,200  | 34.52    | 869,904.00    |  |
| NOKIA OYJ                  | 923,000 | 4.26     | 3,937,979.50  |  |
| ASM INTERNATIONAL NV       | 7,800   | 262.30   | 2,045,940.00  |  |
| ASML HOLDING NV            | 70,390  | 543.90   | 38,285,121.00 |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG   | 218,800 | 32.50    | 7,111,000.00  |  |

|                                   |           |        |               |  |
|-----------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| STMICROELECTRONICS NV             | 107,800   | 30.94  | 3,335,332.00  |  |
| CELLNEX TELECOM SA                | 75,218    | 47.67  | 3,585,642.06  |  |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG              | 558,000   | 16.53  | 9,225,972.00  |  |
| ELISA OYJ                         | 22,100    | 47.80  | 1,056,380.00  |  |
| ILIAD SA                          | 2,400     | 147.90 | 354,960.00    |  |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL      | 55,000    | 9.52   | 524,040.00    |  |
| KONINKLIJKE KPN NV                | 560,000   | 2.80   | 1,570,240.00  |  |
| ORANGE SA                         | 325,000   | 10.48  | 3,406,650.00  |  |
| PROXIMUS                          | 26,000    | 17.42  | 453,050.00    |  |
| TELECOM ITALIA SPA                | 1,170,000 | 0.41   | 489,411.00    |  |
| TELECOM ITALIA-RNC                | 880,000   | 0.46   | 405,064.00    |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 150,000   | 2.45   | 368,850.00    |  |
| TELEFONICA SA                     | 820,000   | 3.91   | 3,207,840.00  |  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE      | 16,800    | 35.43  | 595,224.00    |  |
| ELECTRICITE DE FRANCE             | 109,000   | 11.80  | 1,286,200.00  |  |
| ELIA GROUP SA/NV                  | 4,800     | 89.75  | 430,800.00    |  |
| ENDESA S.A.                       | 50,000    | 22.35  | 1,117,500.00  |  |
| ENEL SPA                          | 1,358,000 | 8.26   | 11,227,944.00 |  |
| ENERGIAS DE PORTUGAL              | 476,000   | 4.62   | 2,199,120.00  |  |
| FORTUM OYJ                        | 72,000    | 23.00  | 1,656,000.00  |  |
| IBERDROLA SA                      | 1,022,000 | 11.52  | 11,773,440.00 |  |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA      | 70,000    | 15.75  | 1,102,850.00  |  |
| TERNA SPA                         | 222,000   | 6.18   | 1,372,848.00  |  |
| VERBUND AG                        | 11,000    | 69.40  | 763,400.00    |  |
| ENAGAS SA                         | 39,000    | 18.79  | 732,810.00    |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA           | 50,000    | 21.48  | 1,074,000.00  |  |
| SNAM SPA                          | 351,158   | 4.78   | 1,681,695.66  |  |
| E.ON SE                           | 380,000   | 10.57  | 4,016,600.00  |  |
| ENGIE                             | 308,000   | 12.61  | 3,884,496.00  |  |
| RWE AG                            | 108,500   | 32.16  | 3,489,360.00  |  |
| SUEZ                              | 52,000    | 19.85  | 1,032,200.00  |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT              | 87,000    | 26.31  | 2,288,970.00  |  |
| AMUNDI SA                         | 10,000    | 77.60  | 776,000.00    |  |
| DEUTSCHE BANK AG-REG              | 334,000   | 11.48  | 3,835,656.00  |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 32,000    | 141.10 | 4,515,200.00  |  |



|      |                             |           |        |                   |  |
|------|-----------------------------|-----------|--------|-------------------|--|
|      | NATIXIS                     | 158,000   | 4.06   | 642,270.00        |  |
|      | UNIPER SE                   | 31,100    | 30.92  | 961,612.00        |  |
|      | EUROFINS SCIENTIFIC SE      | 21,600    | 82.63  | 1,784,808.00      |  |
|      | QIAGEN N.V.                 | 39,400    | 39.77  | 1,566,938.00      |  |
|      | SARTORIUS STEDIM BIOTECH    | 4,540     | 374.50 | 1,700,230.00      |  |
|      | BUREAU VERITAS SA           | 47,000    | 25.13  | 1,181,110.00      |  |
|      | RANDSTAD NV                 | 18,400    | 61.80  | 1,137,120.00      |  |
|      | TELEPERFORMANCE             | 9,600     | 322.70 | 3,097,920.00      |  |
|      | WOLTERS KLUWER              | 44,400    | 79.00  | 3,507,600.00      |  |
|      | AROUNDTOWN SA               | 173,000   | 6.62   | 1,145,260.00      |  |
|      | DEUTSCHE WOHNEN SE          | 55,500    | 43.18  | 2,396,490.00      |  |
|      | LEG IMMOBILIEN SE           | 12,500    | 115.50 | 1,443,750.00      |  |
|      | VONOVIA SE                  | 87,800    | 51.82  | 4,549,796.00      |  |
|      | PUBLICIS GROUPE             | 38,000    | 55.84  | 2,121,920.00      |  |
|      | SES FDR                     | 56,000    | 6.71   | 375,984.00        |  |
|      | BOLLORE                     | 138,000   | 4.26   | 587,880.00        |  |
|      | UBISOFT ENTERTAINMENT       | 14,400    | 62.82  | 904,608.00        |  |
|      | VIVENDI SA                  | 140,000   | 29.82  | 4,174,800.00      |  |
|      | SCOUT24 AG                  | 17,100    | 70.38  | 1,203,498.00      |  |
| 小計   | 銘柄数：234                     |           |        | 772,664,446.91    |  |
|      |                             |           |        | (102,238,959,615) |  |
|      | 組入時価比率：10.5%                |           |        | 11.0%             |  |
| 英ポンド | BP PLC                      | 3,339,000 | 3.13   | 10,469,434.50     |  |
|      | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 676,000   | 14.30  | 9,668,152.00      |  |
|      | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B     | 610,000   | 13.68  | 8,347,240.00      |  |
|      | CRODA INTERNATIONAL PLC     | 22,300    | 67.32  | 1,501,236.00      |  |
|      | JOHNSON MATTHEY PLC         | 30,200    | 32.73  | 988,446.00        |  |
|      | ANGLO AMERICAN PLC          | 206,000   | 33.81  | 6,965,890.00      |  |
|      | ANTOFAGASTA PLC             | 62,000    | 18.74  | 1,161,880.00      |  |
|      | BHP GROUP PLC               | 347,000   | 23.37  | 8,111,125.00      |  |
|      | EVRAZ PLC                   | 76,000    | 6.89   | 523,792.00        |  |
|      | FRESNILLO PLC               | 30,000    | 9.11   | 273,300.00        |  |
|      | GLENCORE PLC                | 1,680,000 | 3.22   | 5,422,200.00      |  |
|      | RIO TINTO PLC-REG           | 185,000   | 65.35  | 12,089,750.00     |  |
|      | MONDI PLC                   | 84,000    | 19.64  | 1,649,760.00      |  |
|      | BAE SYSTEMS PLC             | 547,000   | 5.08   | 2,778,760.00      |  |

|                                   |           |        |               |  |
|-----------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          | 1,380,000 | 1.06   | 1,473,012.00  |  |
| DCC PLC                           | 16,000    | 61.78  | 988,480.00    |  |
| MELROSE INDUSTRIES PLC            | 850,000   | 1.67   | 1,425,025.00  |  |
| SMITHS GROUP PLC                  | 61,000    | 16.19  | 987,895.00    |  |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC      | 11,600    | 120.55 | 1,398,380.00  |  |
| ASHTED GROUP PLC                  | 73,500    | 48.10  | 3,535,350.00  |  |
| BUNZLE                            | 55,000    | 23.48  | 1,291,400.00  |  |
| FERGUSON PLC                      | 36,600    | 94.32  | 3,452,112.00  |  |
| RENTOKIL INTIAL PLC               | 318,000   | 4.90   | 1,558,836.00  |  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC          | 159,000   | 7.80   | 1,241,154.00  |  |
| PERSIMMON PLC                     | 52,600    | 31.99  | 1,682,674.00  |  |
| TAYLOR WIMPEY PLC                 | 620,000   | 1.80   | 1,120,650.00  |  |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS         | 19,500    | 47.50  | 926,250.00    |  |
| BURBERRY GROUP PLC                | 66,000    | 21.91  | 1,446,060.00  |  |
| COMPASS GROUP PLC                 | 292,000   | 16.25  | 4,745,000.00  |  |
| ENTAIN PLC                        | 102,000   | 16.59  | 1,692,690.00  |  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 28,800    | 51.16  | 1,473,408.00  |  |
| WHITBREAD PLC                     | 31,650    | 32.92  | 1,041,918.00  |  |
| OCADO GROUP PLC                   | 83,000    | 19.75  | 1,639,250.00  |  |
| NEXT PLC                          | 21,900    | 82.64  | 1,809,816.00  |  |
| JD SPORTS FASHION PLC             | 93,000    | 9.21   | 856,902.00    |  |
| KINGFISHER PLC                    | 349,000   | 3.63   | 1,268,615.00  |  |
| MORRISON SUPERMARKETS             | 370,000   | 1.79   | 663,225.00    |  |
| SAINSBURY                         | 299,000   | 2.51   | 751,088.00    |  |
| TESCO PLC                         | 1,302,631 | 2.27   | 2,963,485.52  |  |
| COCA-COLA HBC AG-DI               | 34,000    | 25.46  | 865,640.00    |  |
| DIAGEO PLC                        | 390,100   | 32.84  | 12,810,884.00 |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC      | 62,000    | 23.50  | 1,457,000.00  |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC      | 383,000   | 28.38  | 10,871,455.00 |  |
| IMPERIAL BRANDS PLC               | 161,000   | 16.03  | 2,580,830.00  |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 119,000   | 63.55  | 7,562,450.00  |  |
| UNILEVER PLC                      | 434,200   | 42.73  | 18,553,366.00 |  |
| SMITH & NEPHEW PLC                | 150,000   | 15.83  | 2,374,500.00  |  |
| NMC HEALTH PLC                    | 13,300    | 0.24   | 3,192.00      |  |
| ASTRAZENECA PLC                   | 217,900   | 77.35  | 16,854,565.00 |  |

|                                 |            |       |               |  |
|---------------------------------|------------|-------|---------------|--|
| GLAXOSMITHKLINE PLC             | 827,000    | 13.55 | 11,210,812.00 |  |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC       | 29,600     | 23.50 | 695,600.00    |  |
| BARCLAYS PLC                    | 2,920,000  | 1.81  | 5,300,968.00  |  |
| HSBC HOLDINGS PLC               | 3,362,000  | 4.51  | 15,169,344.00 |  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        | 11,590,000 | 0.46  | 5,395,724.50  |  |
| NATWEST GROUP PLC               | 770,000    | 2.00  | 1,540,000.00  |  |
| STANDARD CHARTERED PLC          | 443,000    | 5.16  | 2,288,538.00  |  |
| M&G PLC                         | 440,000    | 2.17  | 957,000.00    |  |
| ADMIRAL GROUP PLC               | 30,800     | 29.78 | 917,224.00    |  |
| AVIVA PLC                       | 670,000    | 4.09  | 2,744,320.00  |  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP     | 219,000    | 2.92  | 640,794.00    |  |
| LEGAL & GENERAL                 | 1,010,000  | 2.84  | 2,876,480.00  |  |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC      | 89,000     | 7.35  | 654,328.00    |  |
| PRUDENTIAL PLC                  | 428,000    | 15.79 | 6,758,120.00  |  |
| RSA INSURANCE GROUP PLC         | 162,000    | 6.84  | 1,108,080.00  |  |
| AVEVA GROUP PLC                 | 19,911     | 33.48 | 666,620.28    |  |
| SAGE GROUP PLC (THE)            | 175,000    | 6.35  | 1,112,650.00  |  |
| HALMA PLC                       | 65,000     | 25.97 | 1,688,050.00  |  |
| BT GROUP PLC                    | 1,530,000  | 1.69  | 2,594,880.00  |  |
| VODAFONE GROUP PLC              | 4,500,000  | 1.41  | 6,381,900.00  |  |
| SSE PLC                         | 177,000    | 14.87 | 2,631,990.00  |  |
| NATIONAL GRID PLC               | 591,000    | 9.31  | 5,506,347.00  |  |
| SEVERN TRENT PLC                | 37,000     | 25.07 | 927,590.00    |  |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC      | 106,000    | 9.90  | 1,049,400.00  |  |
| 3I GROUP PLC                    | 167,000    | 12.48 | 2,084,160.00  |  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 52,000     | 17.48 | 909,220.00    |  |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 53,200     | 71.70 | 3,814,440.00  |  |
| SCHRODERS PLC                   | 19,700     | 36.11 | 711,367.00    |  |
| ST JAMES S PLACE PLC            | 95,000     | 13.85 | 1,315,750.00  |  |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC      | 366,000    | 2.78  | 1,020,408.00  |  |
| EXPERIAN PLC                    | 152,900    | 28.09 | 4,294,961.00  |  |
| INTERTEK GROUP PLC              | 25,600     | 61.90 | 1,584,640.00  |  |
| RELX PLC                        | 324,000    | 19.13 | 6,198,120.00  |  |
| INFORMA PLC                     | 248,000    | 5.75  | 1,426,496.00  |  |
| PEARSON                         | 126,000    | 8.46  | 1,066,212.00  |  |

|        |                               |         |           |                  |      |
|--------|-------------------------------|---------|-----------|------------------|------|
| 小計     | WPP PLC                       | 200,000 | 9.89      | 1,979,600.00     |      |
|        | AUTO TRADER GROUP PLC         | 171,000 | 5.75      | 983,250.00       |      |
| スイスフラン | 銘柄数：86                        |         |           | 293,522,906.80   |      |
|        | 組入時価比率：4.6%                   |         |           | (44,806,271,723) | 4.8% |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG               | 32,000  | 19.55     | 625,600.00       |      |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG     | 1,440   | 852.50    | 1,227,600.00     |      |
|        | GIVAUDAN-REG                  | 1,550   | 3,884.00  | 6,020,200.00     |      |
|        | SIKA AG-REG                   | 23,800  | 282.30    | 6,718,740.00     |      |
|        | LAFARGEHOLCIM LTD             | 88,400  | 55.48     | 4,904,432.00     |      |
|        | GEBERIT AG-REG                | 6,280   | 632.00    | 3,968,960.00     |      |
|        | ABB LTD                       | 303,000 | 30.61     | 9,274,830.00     |      |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG      | 3,000   | 255.40    | 766,200.00       |      |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT   | 6,700   | 261.60    | 1,752,720.00     |      |
|        | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG    | 8,400   | 278.40    | 2,338,560.00     |      |
|        | CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A | 85,700  | 95.66     | 8,198,062.00     |      |
|        | THE SWATCH GROUP AG-B         | 4,700   | 293.10    | 1,377,570.00     |      |
|        | THE SWATCH GROUP AG-REG       | 7,400   | 57.45     | 425,130.00       |      |
|        | BARRY CALLEBAUT AG            | 460     | 2,050.00  | 943,000.00       |      |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC    | 177     | 8,470.00  | 1,499,190.00     |      |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG   | 16      | 91,000.00 | 1,456,000.00     |      |
|        | NESTLE SA-REG                 | 477,400 | 109.12    | 52,093,888.00    |      |
|        | ALCON INC                     | 82,700  | 64.24     | 5,312,648.00     |      |
|        | SONOVA HOLDING AG-REG         | 8,858   | 273.00    | 2,418,234.00     |      |
|        | STRAUMANN HOLDING AG-REG      | 1,790   | 1,377.00  | 2,464,830.00     |      |
|        | NOVARTIS AG-REG               | 367,000 | 79.49     | 29,172,830.00    |      |
|        | ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)  | 116,400 | 303.20    | 35,292,480.00    |      |
|        | ROCHE HOLDINGS AG-BEARER      | 5,300   | 321.80    | 1,705,540.00     |      |
|        | VIFOR PHARMA AG               | 7,600   | 125.80    | 956,080.00       |      |
|        | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG  | 5,400   | 88.90     | 480,060.00       |      |
|        | BALOISE HOLDING AG            | 7,400   | 151.10    | 1,118,140.00     |      |
|        | SWISS LIFE HOLDING AG         | 5,220   | 459.80    | 2,400,156.00     |      |
|        | SWISS RE LTD                  | 48,300  | 87.74     | 4,237,842.00     |      |
|        | ZURICH INSURANCE GROUP AG     | 25,170  | 385.70    | 9,708,069.00     |      |
|        | TEMENOS AG-REG                | 10,400  | 130.50    | 1,357,200.00     |      |

|               |                            |         |          |                  |  |
|---------------|----------------------------|---------|----------|------------------|--|
|               | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 27,000  | 103.80   | 2,802,600.00     |  |
|               | SWISSCOM AG-REG            | 4,450   | 494.80   | 2,201,860.00     |  |
|               | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 412,000 | 9.25     | 3,812,648.00     |  |
|               | JULIUS BAER GROUP LTD      | 35,800  | 57.80    | 2,069,240.00     |  |
|               | PARTNERS GROUP HOLDING AG  | 3,170   | 1,340.50 | 4,249,385.00     |  |
|               | UBS GROUP AG               | 602,000 | 14.13    | 8,506,260.00     |  |
|               | LONZA AG-REG               | 12,180  | 577.40   | 7,032,732.00     |  |
|               | ADECCO GROUP AG-REG        | 24,900  | 61.14    | 1,522,386.00     |  |
|               | SGS SA-REG                 | 980     | 2,751.00 | 2,695,980.00     |  |
|               | SWISS PRIME SITE-REG       | 13,500  | 90.00    | 1,215,000.00     |  |
| 小計            | 銘柄数：40                     |         |          | 236,322,882.00   |  |
|               |                            |         |          | (28,526,535,086) |  |
|               | 組入時価比率：2.9%                |         |          | 3.1%             |  |
| スウェーデン<br>ローナ | LUNDIN ENERGY AB           | 28,800  | 275.10   | 7,922,880.00     |  |
|               | BOLIDEN AB                 | 44,000  | 353.30   | 15,545,200.00    |  |
|               | BOLIDEN AB-RED             | 44,000  | 6.00     | 264,000.00       |  |
|               | SVENSKA CELLULOZA AB-B     | 100,000 | 150.20   | 15,020,000.00    |  |
|               | ASSA ABLOY AB-B            | 170,000 | 255.70   | 43,469,000.00    |  |
|               | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS   | 51,000  | 325.00   | 16,575,000.00    |  |
|               | SKANSKA AB-B SHS           | 60,000  | 236.10   | 14,166,000.00    |  |
|               | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 26,000  | 261.40   | 6,796,400.00     |  |
|               | ALFA LAVAL AB              | 51,000  | 301.10   | 15,356,100.00    |  |
|               | ATLAS COPCO AB-A           | 112,900 | 522.60   | 59,001,540.00    |  |
|               | ATLAS COPCO AB-B           | 62,700  | 450.50   | 28,246,350.00    |  |
|               | EPIROC AB - A              | 113,000 | 193.50   | 21,865,500.00    |  |
|               | EPIROC AB - B              | 69,000  | 173.30   | 11,957,700.00    |  |
|               | SANDVIK AB                 | 184,000 | 228.60   | 42,062,400.00    |  |
|               | SKF AB-B SHARES            | 60,000  | 227.50   | 13,650,000.00    |  |
|               | VOLVO AB-B SHS             | 233,000 | 217.40   | 50,654,200.00    |  |
|               | SECURITAS AB-B SHS         | 54,000  | 141.85   | 7,659,900.00     |  |
|               | ELECTROLUX AB-B            | 34,000  | 237.50   | 8,075,000.00     |  |
|               | HUSQVARNA AB-B SHS         | 73,000  | 121.35   | 8,858,550.00     |  |
|               | EVOLUTION GAMING GROUP     | 27,300  | 1,608.60 | 43,914,780.00    |  |
|               | HENNES&MAURITZ AB-B        | 130,000 | 211.75   | 27,527,500.00    |  |
|               | ICA GRUPPEN AB             | 17,100  | 400.70   | 6,851,970.00     |  |

|               |    |                                  |         |        |                  |  |
|---------------|----|----------------------------------|---------|--------|------------------|--|
|               |    | SWEDISH MATCH AB                 | 260,000 | 74.10  | 19,266,000.00    |  |
|               |    | ESSITY AKTIEBOLAG-B              | 103,000 | 287.70 | 29,633,100.00    |  |
|               |    | NORDEA BANK ABP                  | 548,000 | 85.94  | 47,095,120.00    |  |
|               |    | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 267,000 | 109.35 | 29,196,450.00    |  |
|               |    | SVENSKA HANDELSBANKEN-A          | 267,000 | 98.42  | 26,278,140.00    |  |
|               |    | SWEDBANK AB                      | 148,000 | 150.20 | 22,229,600.00    |  |
|               |    | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS          | 15,000  | 328.80 | 4,932,000.00     |  |
|               |    | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS          | 25,000  | 309.00 | 7,725,000.00     |  |
|               |    | INVESTOR AB-B SHS                | 76,700  | 726.80 | 55,745,560.00    |  |
|               |    | KINNEVIK AB - B                  | 39,000  | 421.05 | 16,420,950.00    |  |
|               |    | LUNDBERGS AB-B SHS               | 12,600  | 487.20 | 6,138,720.00     |  |
|               |    | ERICSSON LM-B                    | 491,000 | 116.38 | 57,142,580.00    |  |
|               |    | HEXAGON AB-B SHS                 | 45,600  | 816.60 | 37,236,960.00    |  |
|               |    | TELIA CO AB                      | 428,000 | 36.29  | 15,532,120.00    |  |
|               |    | TELE 2 AB-B SHS                  | 78,000  | 111.95 | 8,732,100.00     |  |
|               |    | EQT AB                           | 42,000  | 276.20 | 11,600,400.00    |  |
|               |    | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS      | 15,100  | 499.00 | 7,534,900.00     |  |
|               | 小計 | 銘柄数：39                           |         |        | 867,879,670.00   |  |
|               |    |                                  |         |        | (11,369,223,677) |  |
|               |    | 組入時価比率：1.2%                      |         |        | 1.2%             |  |
| ノルウェーク<br>ローネ |    | EQUINOR ASA                      | 160,000 | 178.20 | 28,512,000.00    |  |
|               |    | YARA INTERNATIONAL ASA           | 29,600  | 427.50 | 12,654,000.00    |  |
|               |    | NORSK HYDRO                      | 218,000 | 55.00  | 11,990,000.00    |  |
|               |    | MOWI ASA                         | 70,000  | 218.70 | 15,309,000.00    |  |
|               |    | ORKLA ASA                        | 133,000 | 84.74  | 11,270,420.00    |  |
|               |    | DNB ASA                          | 155,000 | 183.25 | 28,403,750.00    |  |
|               |    | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA        | 31,000  | 190.10 | 5,893,100.00     |  |
|               |    | TELENOR ASA                      | 116,000 | 146.60 | 17,005,600.00    |  |
|               |    | SCHIBSTED ASA-B SHS              | 18,100  | 367.20 | 6,646,320.00     |  |
|               |    | SCHIBSTED ASA-CL A               | 10,600  | 414.50 | 4,393,700.00     |  |
|               |    | ADEVINTA ASA                     | 45,000  | 144.75 | 6,513,750.00     |  |
|               | 小計 | 銘柄数：11                           |         |        | 148,591,640.00   |  |
|               |    |                                  |         |        | (1,970,325,146)  |  |
|               |    | 組入時価比率：0.2%                      |         |        | 0.2%             |  |
| デンマークク        |    | CHR HANSEN HOLDING A/S           | 18,200  | 559.20 | 10,177,440.00    |  |

## ローネ

|                                  |         |           |                 |  |
|----------------------------------|---------|-----------|-----------------|--|
| NOVOZYMES A/S-B SHARES           | 33,700  | 448.30    | 15,107,710.00   |  |
| ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS | 1,120   | 2,989.00  | 3,347,680.00    |  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S          | 166,000 | 245.00    | 40,670,000.00   |  |
| DSV PANALPINA A S                | 33,800  | 1,405.50  | 47,505,900.00   |  |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A        | 560     | 15,200.00 | 8,512,000.00    |  |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B           | 1,040   | 15,985.00 | 16,624,400.00   |  |
| PANDORA A/S                      | 16,000  | 780.20    | 12,483,200.00   |  |
| CARLSBERG B                      | 16,800  | 1,122.00  | 18,849,600.00   |  |
| AMBU A/S-B                       | 29,000  | 329.50    | 9,555,500.00    |  |
| COLOPLAST-B                      | 19,400  | 985.20    | 19,112,880.00   |  |
| DEMANT A/S                       | 16,000  | 324.00    | 5,184,000.00    |  |
| GN STORE NORD A/S                | 21,200  | 520.00    | 11,024,000.00   |  |
| GENMAB A/S                       | 11,060  | 2,295.00  | 25,382,700.00   |  |
| H LUNDBECK A/S                   | 10,500  | 192.00    | 2,016,000.00    |  |
| NOVO NORDISK A/S-B               | 284,200 | 463.60    | 131,755,120.00  |  |
| DANSKE BANK AS                   | 109,000 | 120.40    | 13,123,600.00   |  |
| TRYG A/S                         | 60,666  | 146.25    | 8,872,402.50    |  |
| ORSTED A/S                       | 31,800  | 892.40    | 28,378,320.00   |  |
| 小計銘柄数：19                         |         |           | 427,682,452.50  |  |
|                                  |         |           | (7,608,470,829) |  |
| 組入時価比率：0.8%                      |         |           | 0.8%            |  |
| 豪ドル                              |         |           |                 |  |
| AMPOL LTD                        | 40,000  | 26.52     | 1,060,800.00    |  |
| OIL SEARCH LTD                   | 350,000 | 3.94      | 1,379,000.00    |  |
| ORIGIN ENERGY LTD                | 265,000 | 4.14      | 1,097,100.00    |  |
| SANTOS LTD.                      | 310,000 | 7.05      | 2,185,500.00    |  |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON     | 17,000  | 29.86     | 507,620.00      |  |
| WOODSIDE PETROLEUM               | 163,000 | 23.26     | 3,791,380.00    |  |
| ORICA LTD                        | 59,000  | 13.95     | 823,050.00      |  |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC      | 73,000  | 43.33     | 3,163,090.00    |  |
| BHP GROUP LIMITED                | 486,000 | 50.09     | 24,343,740.00   |  |
| BLUESCOPE STEEL LTD              | 90,000  | 22.66     | 2,039,400.00    |  |
| EVOLUTION MINING LTD             | 272,000 | 4.80      | 1,305,600.00    |  |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD       | 276,000 | 22.97     | 6,339,720.00    |  |
| NEWCREST MINING                  | 132,000 | 27.33     | 3,607,560.00    |  |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD      | 194,000 | 10.88     | 2,110,720.00    |  |

|                                |         |        |               |  |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| RIO TINTO LTD                  | 60,700  | 127.11 | 7,715,577.00  |  |
| SOUTH32 LTD                    | 780,000 | 3.00   | 2,340,000.00  |  |
| CIMIC GROUP LTD                | 18,000  | 18.93  | 340,740.00    |  |
| BRAMBLES LTD                   | 247,000 | 10.57  | 2,610,790.00  |  |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED         | 170,000 | 4.77   | 810,900.00    |  |
| AURIZON HOLDINGS LTD           | 305,000 | 3.73   | 1,137,650.00  |  |
| SYDNEY AIRPORT                 | 200,621 | 5.92   | 1,187,676.32  |  |
| TRANSURBAN GROUP               | 462,000 | 14.00  | 6,468,000.00  |  |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD         | 99,000  | 37.63  | 3,725,370.00  |  |
| CROWN RESORTS LTD              | 55,000  | 12.12  | 666,600.00    |  |
| TABCORP HOLDINGS               | 370,909 | 5.09   | 1,887,926.81  |  |
| WESFARMERS LIMITED             | 190,200 | 54.26  | 10,320,252.00 |  |
| COLES GROUP LTD                | 227,000 | 16.13  | 3,661,510.00  |  |
| WOOLWORTHS GROUP LTD           | 212,000 | 39.42  | 8,357,040.00  |  |
| COCA-COLA AMATIL LTD           | 77,000  | 13.30  | 1,024,100.00  |  |
| TREASURY WINE ESTATES LTD      | 111,000 | 10.16  | 1,127,760.00  |  |
| COCHLEAR LTD                   | 10,300  | 218.00 | 2,245,400.00  |  |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD         | 29,500  | 62.96  | 1,857,320.00  |  |
| SONIC HEALTHCARE LTD           | 78,000  | 34.84  | 2,717,520.00  |  |
| CSL LIMITED                    | 75,800  | 274.51 | 20,807,858.00 |  |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK   | 475,000 | 27.75  | 13,181,250.00 |  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 295,100 | 93.92  | 27,715,792.00 |  |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK        | 541,000 | 26.78  | 14,487,980.00 |  |
| WESTPAC BANKING CORP           | 594,000 | 26.09  | 15,497,460.00 |  |
| AMP LIMITED                    | 530,000 | 1.07   | 569,750.00    |  |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD  | 430,000 | 5.13   | 2,205,900.00  |  |
| MEDIBANK PRIVATE LTD           | 450,000 | 3.06   | 1,377,000.00  |  |
| QBE INSURANCE                  | 244,000 | 10.63  | 2,593,720.00  |  |
| SUNCORP GROUP LTD              | 222,000 | 10.98  | 2,437,560.00  |  |
| AFTERPAY LTD                   | 34,800  | 95.38  | 3,319,224.00  |  |
| COMPUTERSHARE LTD              | 84,636  | 14.06  | 1,189,982.16  |  |
| WISETECH GLOBAL LTD            | 21,000  | 28.23  | 592,830.00    |  |
| XERO LIMITED                   | 19,800  | 133.75 | 2,648,250.00  |  |
| TELSTRA CORP LTD               | 730,000 | 3.47   | 2,533,100.00  |  |
| TPG TELECOM LTD                | 52,000  | 5.43   | 282,360.00    |  |



|  |            |                                          |           |        |                  |  |
|--|------------|------------------------------------------|-----------|--------|------------------|--|
|  |            | AUSNET SERVICES                          | 330,000   | 1.89   | 623,700.00       |  |
|  |            | APA GROUP                                | 205,000   | 9.87   | 2,023,350.00     |  |
|  |            | AGL ENERGY LTD                           | 105,000   | 8.81   | 925,050.00       |  |
|  |            | ASX LTD                                  | 30,700    | 71.90  | 2,207,330.00     |  |
|  |            | MACQUARIE GROUP LIMITED                  | 56,800    | 158.45 | 8,999,960.00     |  |
|  |            | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD             | 19,200    | 46.90  | 900,480.00       |  |
|  |            | REA GROUP LTD                            | 8,800     | 156.05 | 1,373,240.00     |  |
|  |            | SEEK LTD                                 | 60,000    | 30.00  | 1,800,000.00     |  |
|  |            | 小計 銘柄数：57                                |           |        | 244,249,538.29   |  |
|  |            |                                          |           |        | (20,868,680,551) |  |
|  |            | 組入時価比率：2.1%                              |           |        | 2.2%             |  |
|  | ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD                | 223,000   | 7.60   | 1,694,800.00     |  |
|  |            | A2 MILK CO LTD                           | 117,000   | 7.59   | 888,030.00       |  |
|  |            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L | 93,000    | 33.80  | 3,143,400.00     |  |
|  |            | RYMAN HEALTHCARE LTD                     | 74,000    | 14.16  | 1,047,840.00     |  |
|  |            | SPARK NEW ZEALAND LTD                    | 307,000   | 4.58   | 1,406,060.00     |  |
|  |            | MERCURY NZ LTD                           | 100,000   | 6.88   | 688,000.00       |  |
|  |            | MERIDIAN ENERGY LTD                      | 201,000   | 5.33   | 1,071,330.00     |  |
|  |            | 小計 銘柄数：7                                 |           |        | 9,939,460.00     |  |
|  |            |                                          |           |        | (787,702,205)    |  |
|  |            | 組入時価比率：0.1%                              |           |        | 0.1%             |  |
|  | 香港ドル       | XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD              | 280,000   | 26.55  | 7,434,000.00     |  |
|  |            | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD                | 460,040   | 64.35  | 29,603,574.00    |  |
|  |            | TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED    | 233,000   | 149.30 | 34,786,900.00    |  |
|  |            | MTR CORP                                 | 272,000   | 44.20  | 12,022,400.00    |  |
|  |            | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L             | 356,000   | 66.70  | 23,745,200.00    |  |
|  |            | SANDS CHINA LTD                          | 384,000   | 34.55  | 13,267,200.00    |  |
|  |            | SJM HOLDINGS LIMITED                     | 270,000   | 9.13   | 2,465,100.00     |  |
|  |            | WYNN MACAU LTD                           | 228,000   | 13.68  | 3,119,040.00     |  |
|  |            | BUDWEISER BREWING CO APAC LT             | 290,000   | 26.10  | 7,569,000.00     |  |
|  |            | WH GROUP LIMITED                         | 1,610,000 | 6.87   | 11,060,700.00    |  |
|  |            | BANK OF EAST ASIA                        | 220,060   | 16.00  | 3,520,960.00     |  |
|  |            | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD               | 610,000   | 29.15  | 17,781,500.00    |  |
|  |            | HANG SENG BANK                           | 131,000   | 162.30 | 21,261,300.00    |  |

|              |                                      |           |        |                 |  |
|--------------|--------------------------------------|-----------|--------|-----------------|--|
|              | AIA GROUP LTD                        | 1,998,000 | 101.50 | 202,797,000.00  |  |
|              | ASM PACIFIC TECHNOLOGY               | 48,000    | 112.00 | 5,376,000.00    |  |
|              | HKT TRUST AND HKT LTD                | 599,600   | 11.40  | 6,835,440.00    |  |
|              | PCCW LTD                             | 750,000   | 4.60   | 3,450,000.00    |  |
|              | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD       | 107,000   | 49.35  | 5,280,450.00    |  |
|              | CLP HLDGS                            | 281,000   | 79.70  | 22,395,700.00   |  |
|              | POWER ASSETS HOLDINGS LTD            | 225,000   | 49.75  | 11,193,750.00   |  |
|              | HONG KONG & CHINA GAS                | 1,740,365 | 13.30  | 23,146,854.50   |  |
|              | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD   | 198,300   | 454.40 | 90,107,520.00   |  |
|              | CK ASSET HOLDINGS LTD                | 445,040   | 49.95  | 22,229,748.00   |  |
|              | ESR CAYMAN LTD                       | 260,000   | 24.80  | 6,448,000.00    |  |
|              | HANG LUNG PROPERTIES LTD             | 360,000   | 20.20  | 7,272,000.00    |  |
|              | HENDERSON LAND                       | 229,443   | 35.60  | 8,168,170.80    |  |
|              | NEW WORLD DEVELOPMENT                | 268,916   | 41.80  | 11,240,688.80   |  |
|              | SINO LAND CO.LTD                     | 480,000   | 11.64  | 5,587,200.00    |  |
|              | SUN HUNG KAI PROPERTIES              | 222,000   | 118.60 | 26,329,200.00   |  |
|              | SWIRE PACIFIC-A                      | 75,000    | 63.80  | 4,785,000.00    |  |
|              | SWIRE PROPERTIES LTD                 | 173,000   | 22.80  | 3,944,400.00    |  |
|              | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT         | 279,000   | 46.10  | 12,861,900.00   |  |
| 小計           | 銘柄数：32                               |           |        | 667,085,896.10  |  |
|              |                                      |           |        | (9,345,873,404) |  |
|              | 組入時価比率：1.0%                          |           |        | 1.0%            |  |
| シンガポールド<br>ル | SINGAPORE TECH ENGINEERING           | 249,000   | 3.77   | 938,730.00      |  |
|              | KEPPEL CORP.                         | 232,000   | 5.36   | 1,243,520.00    |  |
|              | SINGAPORE AIRLINES LTD               | 240,000   | 4.95   | 1,188,000.00    |  |
|              | GENTING SINGAPORE LTD                | 1,130,000 | 0.85   | 960,500.00      |  |
|              | WILMAR INTERNATIONAL LTD             | 340,000   | 4.97   | 1,689,800.00    |  |
|              | DBS GROUP HLDGS                      | 302,000   | 29.86  | 9,017,720.00    |  |
|              | OCBC-ORD                             | 559,000   | 12.56  | 7,021,040.00    |  |
|              | UNITED OVERSEAS BANK                 | 190,000   | 26.58  | 5,050,200.00    |  |
|              | VENTURE CORP LTD                     | 45,000    | 19.50  | 877,500.00      |  |
|              | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 1,400,000 | 2.45   | 3,430,000.00    |  |
|              | SINGAPORE EXCHANGE LTD               | 129,000   | 10.35  | 1,335,150.00    |  |

|  |      |                          |         |        |                   |      |
|--|------|--------------------------|---------|--------|-------------------|------|
|  | 小計   | CAPITALAND LIMITED       | 430,000 | 3.64   | 1,565,200.00      |      |
|  |      | CITY DEVELOPMENTS LTD    | 70,000  | 7.70   | 539,000.00        |      |
|  |      | UOL GROUP LIMITED        | 87,000  | 7.61   | 662,070.00        |      |
|  |      | 銘柄数：14                   |         |        | 35,518,430.00     |      |
|  |      | 組入時価比率：0.3%              |         |        | (2,915,352,734)   | 0.3% |
|  | 新シケル | ICL GROUP LTD            | 125,000 | 22.49  | 2,811,250.00      |      |
|  |      | ELBIT SYSTEMS LTD        | 5,000   | 442.20 | 2,211,000.00      |      |
|  |      | BANK HAPOALIM BM         | 183,000 | 26.69  | 4,884,270.00      |      |
|  |      | BANK LEUMI LE-ISRAEL     | 238,000 | 24.32  | 5,788,160.00      |      |
|  |      | ISRAEL DISCOUNT BANK-A   | 172,000 | 15.44  | 2,655,680.00      |      |
|  |      | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 23,000  | 93.72  | 2,155,560.00      |      |
|  |      | NICE LTD                 | 10,600  | 758.10 | 8,035,860.00      |      |
|  |      | AZRIELI GROUP            | 6,500   | 239.40 | 1,556,100.00      |      |
|  |      | 銘柄数：8                    |         |        | 30,097,880.00     |      |
|  |      | 組入時価比率：0.1%              |         |        | (1,007,330,896)   | 0.1% |
|  | 合計   |                          |         |        | 933,363,590,174   |      |
|  |      |                          |         |        | (933,363,590,174) |      |

(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5月10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  | 1,703,760.00  |    |
|      |     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 22,400  | 3,990,336.00  |    |
|      |     | AMERICAN TOWER CORP          | 73,700  | 18,240,013.00 |    |
|      |     | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT    | 238,000 | 2,184,840.00  |    |
|      |     | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 22,700  | 4,438,531.00  |    |
|      |     | BOSTON PROPERTIES            | 25,000  | 2,704,000.00  |    |
|      |     | CAMDEN PROPERTY TRUST        | 16,000  | 1,963,040.00  |    |
|      |     | CROWN CASTLE INTL CORP       | 72,100  | 13,217,372.00 |    |
|      |     | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 45,200  | 6,833,336.00  |    |

|       |                              |           |                  |  |
|-------|------------------------------|-----------|------------------|--|
|       | DUKE REALTY CORP             | 62,200    | 2,856,846.00     |  |
|       | EQUINIX INC                  | 14,810    | 10,566,194.50    |  |
|       | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 29,400    | 2,054,766.00     |  |
|       | EQUITY RESIDENTIAL           | 60,300    | 4,465,215.00     |  |
|       | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 10,700    | 3,091,016.00     |  |
|       | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 20,700    | 3,047,868.00     |  |
|       | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 88,000    | 2,949,760.00     |  |
|       | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 109,000   | 1,916,220.00     |  |
|       | INVITATION HOMES INC         | 92,000    | 3,222,760.00     |  |
|       | IRON MOUNTAIN INC            | 49,000    | 2,023,700.00     |  |
|       | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 99,000    | 2,126,520.00     |  |
|       | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 19,300    | 3,030,679.00     |  |
|       | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS   | 36,500    | 1,332,250.00     |  |
|       | PROLOGIS INC                 | 122,700   | 14,235,654.00    |  |
|       | PUBLIC STORAGE               | 26,500    | 7,347,655.00     |  |
|       | REALTY INCOME CORP           | 55,600    | 3,786,360.00     |  |
|       | REGENCY CENTERS CORP         | 26,200    | 1,712,432.00     |  |
|       | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 18,100    | 5,265,471.00     |  |
|       | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 54,800    | 6,846,712.00     |  |
|       | SUN COMMUNITIES INC          | 17,800    | 2,948,214.00     |  |
|       | UDR INC                      | 46,100    | 2,133,969.00     |  |
|       | VENTAS INC                   | 63,900    | 3,499,803.00     |  |
|       | VEREIT INC                   | 37,000    | 1,739,370.00     |  |
|       | VICI PROPERTIES INC          | 87,000    | 2,731,800.00     |  |
|       | VORNADO REALTY TRUST         | 27,000    | 1,242,270.00     |  |
|       | WELLTOWER INC                | 68,000    | 5,079,600.00     |  |
|       | WEYERHAEUSER CO              | 121,000   | 4,840,000.00     |  |
|       | WP CAREY INC                 | 27,400    | 2,058,836.00     |  |
| 小計    | 銘柄数：37                       | 2,098,110 | 163,427,168.50   |  |
|       |                              |           | (17,775,973,117) |  |
|       | 組入時価比率：1.8%                  |           | 83.6%            |  |
| カナダドル | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 14,900    | 851,684.00       |  |
|       | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 22,000    | 468,600.00       |  |
| 小計    | 銘柄数：2                        | 36,900    | 1,320,284.00     |  |
|       |                              |           | (118,469,083)    |  |

|          |                                        |           |                 |  |
|----------|----------------------------------------|-----------|-----------------|--|
|          | 組入時価比率：0.0%                            |           | 0.6%            |  |
| ユーロ      | COVIVIO                                | 8,500     | 647,530.00      |  |
|          | GECINA SA                              | 7,100     | 906,670.00      |  |
|          | KLEPIERRE                              | 32,300    | 719,644.00      |  |
|          | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 24,200    | 1,722,314.00    |  |
| 小計       | 銘柄数：4                                  | 72,100    | 3,996,158.00    |  |
|          |                                        |           | (528,771,626)   |  |
|          | 組入時価比率：0.1%                            |           | 2.5%            |  |
| 英ポンド     | BRITISH LAND                           | 128,000   | 685,824.00      |  |
|          | LAND SECURITIES GROUP PLC              | 111,000   | 823,842.00      |  |
|          | SEGRO PLC                              | 193,000   | 1,952,195.00    |  |
| 小計       | 銘柄数：3                                  | 432,000   | 3,461,861.00    |  |
|          |                                        |           | (528,453,081)   |  |
|          | 組入時価比率：0.1%                            |           | 2.5%            |  |
| 豪ドル      | DEXUS                                  | 171,000   | 1,754,460.00    |  |
|          | GOODMAN GROUP                          | 283,000   | 5,444,920.00    |  |
|          | GPT GROUP                              | 330,000   | 1,527,900.00    |  |
|          | LENDLEASE GROUP                        | 111,000   | 1,337,550.00    |  |
|          | MIRVAC GROUP                           | 660,000   | 1,834,800.00    |  |
|          | SCENTRE GROUP                          | 820,000   | 2,246,800.00    |  |
|          | STOCKLAND TRUST GROUP                  | 400,000   | 1,832,000.00    |  |
|          | VICINITY CENTRES                       | 670,000   | 1,031,800.00    |  |
| 小計       | 銘柄数：8                                  | 3,445,000 | 17,010,230.00   |  |
|          |                                        |           | (1,453,354,051) |  |
|          | 組入時価比率：0.1%                            |           | 6.8%            |  |
| 香港ドル     | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS            | 470,000   | 3,708,300.00    |  |
|          | LINK REIT                              | 353,000   | 26,157,300.00   |  |
| 小計       | 銘柄数：2                                  | 823,000   | 29,865,600.00   |  |
|          |                                        |           | (418,417,056)   |  |
|          | 組入時価比率：0.0%                            |           | 2.0%            |  |
| シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT           | 539,240   | 1,644,682.00    |  |
|          | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 706,779   | 1,505,439.27    |  |
|          | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST             | 370,000   | 780,700.00      |  |
|          | MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | 427,980   | 847,400.40      |  |
|          | SUNTEC REIT                            | 300,000   | 456,000.00      |  |

|    |    |             |           |                                    |  |
|----|----|-------------|-----------|------------------------------------|--|
|    | 小計 | 銘柄数：5       | 2,343,999 | 5,234,221.67<br>(429,624,914)      |  |
|    |    | 組入時価比率：0.0% |           | 2.0%                               |  |
| 合計 |    |             |           | 21,253,062,928<br>(21,253,062,928) |  |

(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 5月10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       | 16,076,759,228 | —     | 16,871,268,441 | 794,509,213 |
| 合計       | 16,076,759,228 | —     | 16,871,268,441 | 794,509,213 |

(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。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2021年 5月10日現在)

|         |                |
|---------|----------------|
| 資産の部    |                |
| 流動資産    |                |
| コール・ローン | 205,399,456    |
| 国債証券    | 28,240,164,800 |
| 未収利息    | 52,517,204     |
| 前払費用    | 736,068        |
| 流動資産合計  | 28,498,817,528 |
| 資産合計    | 28,498,817,528 |
| 負債の部    |                |
| 流動負債    |                |

(2021年 5月10日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 未払解約金           | 10,947,340     |
| 未払利息            | 102            |
| 流動負債合計          | 10,947,442     |
| 負債合計            | 10,947,442     |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 20,882,177,477 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 7,605,692,609  |
| 元本等合計           | 28,487,870,086 |
| 純資産合計           | 28,487,870,086 |
| 負債純資産合計         | 28,498,817,528 |

## 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<br>原則として時価で評価しております。<br>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<br>約定日基準で計上しております。<br>派生商品取引等損益<br>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。 |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

| 2021年 5月10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                  | 1.3642円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (13,642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 5月12日<br>至 2021年 5月10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 5月10日現在                                           |  |
|---------------------------------------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                      |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |  |
| 2. 時価の算定方法                                              |  |
| 国債証券                                                    |  |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。                          |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務                                     |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |  |

### （その他の注記）

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2021年 5月10日現在                      |                 |
|------------------------------------|-----------------|
| 期首                                 | 2020年 5月12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   | 23,138,175,064円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 6,667,576,378円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 8,923,573,965円  |
| 期末元本額                              | 20,882,177,477円 |
| 期末元本額の内訳＊                          |                 |
| バランスセレクト30                         | 567,540,450円    |
| バランスセレクト50                         | 615,442,950円    |
| バランスセレクト70                         | 288,094,501円    |
| ネクストコア                             | 337,680,237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）   | 1,538,587,690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） | 4,469,606,551円  |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け）               | 24,336,233円     |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け）               | 53,840,606円     |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け）               | 22,946,446円     |
| 野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）         | 5,263,043,944円  |



|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け） | 173,821,506円   |
| 野村DC運用戦略ファンド              | 6,602,425,241円 |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）        | 924,811,122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5月10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5月10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414回 | 200,000,000 | 200,546,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（2年）第417回 | 300,000,000 | 301,002,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（2年）第419回 | 100,000,000 | 100,374,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（2年）第420回 | 140,000,000 | 140,541,800 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（2年）第421回 | 50,000,000  | 50,203,500  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第133回 | 380,000,000 | 381,162,800 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第134回 | 470,000,000 | 471,743,700 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第135回 | 150,000,000 | 150,655,500 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第136回 | 200,000,000 | 200,994,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第137回 | 150,000,000 | 150,852,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第138回 | 100,000,000 | 100,642,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第139回 | 600,000,000 | 604,218,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第141回 | 140,000,000 | 141,110,200 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第142回 | 270,000,000 | 272,251,800 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第143回 | 350,000,000 | 353,118,500 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第144回 | 200,000,000 | 201,900,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第145回 | 410,000,000 | 414,042,600 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第146回 | 250,000,000 | 252,432,500 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第1回  | 30,000,000  | 43,496,100  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第2回  | 30,000,000  | 42,212,100  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第3回  | 60,000,000  | 84,867,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第4回  | 75,000,000  | 106,599,750 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第5回  | 60,000,000  | 82,515,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第6回  | 90,000,000  | 121,943,700 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第7回  | 40,000,000  | 52,219,600  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第8回  | 70,000,000  | 85,517,600  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第9回  | 110,000,000 | 100,894,200 |    |

|                   |             |             |  |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（４０年）第１０回  | 70,000,000  | 75,198,200  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１１回  | 80,000,000  | 83,444,000  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１２回  | 130,000,000 | 122,584,800 |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１３回  | 80,000,000  | 75,342,400  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３２４回 | 100,000,000 | 101,027,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３２５回 | 330,000,000 | 334,161,300 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３２６回 | 240,000,000 | 243,194,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３２７回 | 230,000,000 | 233,433,900 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３２８回 | 230,000,000 | 233,125,700 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３２９回 | 350,000,000 | 356,923,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３０回 | 220,000,000 | 224,899,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３１回 | 90,000,000  | 91,577,700  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３２回 | 350,000,000 | 356,786,500 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３３回 | 250,000,000 | 255,342,500 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３４回 | 340,000,000 | 347,857,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３５回 | 200,000,000 | 204,288,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３６回 | 120,000,000 | 122,742,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３７回 | 100,000,000 | 101,560,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３８回 | 300,000,000 | 306,162,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３９回 | 100,000,000 | 102,189,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４０回 | 330,000,000 | 337,596,600 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４１回 | 300,000,000 | 305,769,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４２回 | 390,000,000 | 393,806,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４３回 | 250,000,000 | 252,437,500 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４４回 | 300,000,000 | 302,988,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４５回 | 560,000,000 | 565,678,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４６回 | 170,000,000 | 171,749,300 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４７回 | 170,000,000 | 171,773,100 |  |
|                   |             |             |  |

|                   |             |             |  |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（１０年）第３４８回 | 290,000,000 | 293,056,600 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４９回 | 250,000,000 | 252,652,500 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５０回 | 470,000,000 | 475,010,200 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５１回 | 340,000,000 | 343,393,200 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５２回 | 460,000,000 | 464,411,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５３回 | 150,000,000 | 151,371,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５４回 | 200,000,000 | 201,730,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５５回 | 50,000,000  | 50,405,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５６回 | 60,000,000  | 60,450,600  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５７回 | 130,000,000 | 130,893,100 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５８回 | 70,000,000  | 70,432,600  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５９回 | 300,000,000 | 301,494,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６０回 | 20,000,000  | 20,083,800  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６１回 | 210,000,000 | 210,600,600 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３回   | 40,000,000  | 48,150,400  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５回   | 10,000,000  | 12,108,300  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第６回   | 10,000,000  | 12,396,300  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第７回   | 15,000,000  | 18,568,050  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第８回   | 20,000,000  | 23,782,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第９回   | 20,000,000  | 22,879,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１０回  | 30,000,000  | 33,300,900  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１１回  | 10,000,000  | 11,836,400  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１２回  | 10,000,000  | 12,351,600  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１３回  | 10,000,000  | 12,259,300  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１４回  | 30,000,000  | 38,393,400  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１５回  | 70,000,000  | 90,799,100  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１６回  | 10,000,000  | 13,010,100  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１７回  | 20,000,000  | 25,830,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１８回  | 120,000,000 | 153,771,600 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１９回  | 10,000,000  | 12,846,400  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２１回  | 60,000,000  | 77,502,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２２回  | 40,000,000  | 52,968,400  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２３回  | 40,000,000  | 53,103,600  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２４回  | 80,000,000  | 106,470,400 |  |
|                   |             |             |  |

|      |             |             |             |
|------|-------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 | 利付（３０年）第２６回 | 80,000,000  | 105,831,200 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第２７回 | 100,000,000 | 134,521,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第２８回 | 30,000,000  | 40,557,600  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第２９回 | 120,000,000 | 160,921,200 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３１回 | 40,000,000  | 52,676,000  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３２回 | 110,000,000 | 147,423,100 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３３回 | 80,000,000  | 103,186,400 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３４回 | 110,000,000 | 146,558,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３５回 | 122,000,000 | 158,602,440 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３６回 | 130,000,000 | 169,552,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３７回 | 130,000,000 | 167,550,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３８回 | 80,000,000  | 101,796,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第３９回 | 80,000,000  | 103,638,400 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４１回 | 100,000,000 | 125,653,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４２回 | 110,000,000 | 138,353,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４３回 | 90,000,000  | 113,311,800 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４４回 | 110,000,000 | 138,626,400 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４５回 | 90,000,000  | 109,584,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４６回 | 150,000,000 | 182,751,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４７回 | 110,000,000 | 136,621,100 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４８回 | 110,000,000 | 131,641,400 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４９回 | 120,000,000 | 143,666,400 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５０回 | 50,000,000  | 52,907,000  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５１回 | 130,000,000 | 122,289,700 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５２回 | 90,000,000  | 88,702,200  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５３回 | 100,000,000 | 100,783,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５５回 | 80,000,000  | 84,372,800  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５６回 | 80,000,000  | 84,312,800  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５７回 | 110,000,000 | 115,845,400 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５８回 | 120,000,000 | 126,280,800 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５９回 | 110,000,000 | 112,959,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６０回 | 100,000,000 | 107,556,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６１回 | 100,000,000 | 102,368,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６２回 | 80,000,000  | 77,719,200  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６３回 | 60,000,000  | 56,636,400  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６４回 | 60,000,000  | 56,542,800  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６５回 | 50,000,000  | 47,041,000  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６６回 | 50,000,000  | 46,962,500  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６７回 | 70,000,000  | 69,312,600  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６８回 | 60,000,000  | 59,333,400  |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６９回 | 60,000,000  | 60,895,800  |
| 国庫債券 | 利付（２０年）第５８回 | 10,000,000  | 10,276,200  |
| 国庫債券 | 利付（２０年）第５９回 | 30,000,000  | 30,883,500  |

|                   |            |            |  |
|-------------------|------------|------------|--|
| 国庫債券 利付（２０年）第６０回  | 10,000,000 | 10,246,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６１回  | 10,000,000 | 10,210,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６２回  | 80,000,000 | 81,573,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６３回  | 10,000,000 | 10,408,200 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６４回  | 10,000,000 | 10,482,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６５回  | 10,000,000 | 10,533,200 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６６回  | 20,000,000 | 21,014,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６７回  | 10,000,000 | 10,583,700 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６８回  | 10,000,000 | 10,669,800 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第６９回  | 30,000,000 | 31,923,300 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７０回  | 40,000,000 | 43,166,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７１回  | 10,000,000 | 10,729,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７２回  | 20,000,000 | 21,509,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７３回  | 10,000,000 | 10,772,700 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７４回  | 10,000,000 | 10,809,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７５回  | 40,000,000 | 43,449,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７６回  | 17,000,000 | 18,334,330 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７７回  | 15,000,000 | 16,235,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７８回  | 10,000,000 | 10,836,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７９回  | 10,000,000 | 10,877,700 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８０回  | 10,000,000 | 10,919,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８１回  | 10,000,000 | 10,929,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８２回  | 15,000,000 | 16,459,950 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８３回  | 15,000,000 | 16,536,300 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８４回  | 50,000,000 | 54,889,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８５回  | 13,000,000 | 14,392,430 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８６回  | 10,000,000 | 11,168,700 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８８回  | 20,000,000 | 22,453,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９０回  | 20,000,000 | 22,461,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９１回  | 10,000,000 | 11,284,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９２回  | 30,000,000 | 33,686,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９３回  | 70,000,000 | 78,545,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９４回  | 20,000,000 | 22,559,200 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９５回  | 10,000,000 | 11,454,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９６回  | 15,000,000 | 16,997,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９７回  | 50,000,000 | 57,234,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９９回  | 30,000,000 | 34,300,800 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１００回 | 20,000,000 | 23,104,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０１回 | 20,000,000 | 23,379,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０２回 | 20,000,000 | 23,479,200 |  |
|                   |            |            |  |

|                   |             |             |
|-------------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 利付（２０年）第１０３回 | 25,000,000  | 29,170,750  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０４回 | 10,000,000  | 11,525,700  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０５回 | 70,000,000  | 81,000,500  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０６回 | 100,000,000 | 116,452,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０７回 | 100,000,000 | 116,159,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０８回 | 80,000,000  | 91,708,000  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０９回 | 30,000,000  | 34,505,700  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１０回 | 90,000,000  | 104,932,800 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１１回 | 10,000,000  | 11,784,100  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１２回 | 85,000,000  | 99,475,500  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１３回 | 160,000,000 | 187,937,600 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１５回 | 50,000,000  | 59,369,500  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１６回 | 110,000,000 | 131,085,900 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１７回 | 60,000,000  | 70,971,600  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１８回 | 40,000,000  | 47,115,600  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１９回 | 50,000,000  | 57,987,000  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２０回 | 110,000,000 | 125,574,900 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２１回 | 70,000,000  | 82,066,600  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２２回 | 130,000,000 | 151,197,800 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２３回 | 100,000,000 | 119,436,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２４回 | 100,000,000 | 118,481,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２５回 | 100,000,000 | 120,793,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２６回 | 30,000,000  | 35,650,800  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２８回 | 100,000,000 | 118,192,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２９回 | 50,000,000  | 58,595,000  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３０回 | 90,000,000  | 105,744,600 |
|                   | 35,000,000  | 40,763,800  |

|                   |             |             |  |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（２０年）第１３１回 |             |             |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３２回 | 60,000,000  | 70,042,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３３回 | 120,000,000 | 141,344,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３４回 | 70,000,000  | 82,648,300  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３５回 | 60,000,000  | 70,197,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３６回 | 30,000,000  | 34,777,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３７回 | 40,000,000  | 46,902,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３８回 | 50,000,000  | 57,533,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３９回 | 60,000,000  | 69,697,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４０回 | 140,000,000 | 164,609,200 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４１回 | 100,000,000 | 117,823,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４２回 | 100,000,000 | 118,965,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４３回 | 130,000,000 | 151,959,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４４回 | 80,000,000  | 92,581,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４５回 | 190,000,000 | 224,891,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４６回 | 140,000,000 | 166,033,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４７回 | 150,000,000 | 176,373,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４８回 | 170,000,000 | 198,199,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４９回 | 100,000,000 | 116,756,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５０回 | 60,000,000  | 69,369,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５１回 | 170,000,000 | 192,270,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５２回 | 300,000,000 | 339,534,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５３回 | 120,000,000 | 137,546,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５４回 | 160,000,000 | 181,323,200 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５５回 | 160,000,000 | 176,915,200 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５６回 | 110,000,000 | 112,041,600 |  |
|                   | 120,000,000 | 118,521,600 |  |

|    |                   |                |                |  |
|----|-------------------|----------------|----------------|--|
| 小計 | 国庫債券 利付（２０年）第１５７回 |                |                |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１５８回 | 60,000,000     | 61,852,800     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１５９回 | 100,000,000    | 104,551,000    |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６０回 | 10,000,000     | 10,597,400     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６１回 | 100,000,000    | 104,369,000    |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６２回 | 40,000,000     | 41,708,800     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６３回 | 100,000,000    | 104,169,000    |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６４回 | 240,000,000    | 245,925,600    |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６５回 | 160,000,000    | 163,740,800    |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６６回 | 60,000,000     | 63,333,000     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６８回 | 70,000,000     | 70,175,000     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１６９回 | 100,000,000    | 98,311,000     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７０回 | 120,000,000    | 117,745,200    |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７２回 | 90,000,000     | 89,606,700     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７３回 | 70,000,000     | 69,567,400     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７４回 | 130,000,000    | 129,071,800    |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７５回 | 120,000,000    | 121,299,600    |  |
|    | 銘柄数：241           | 26,247,000,000 | 28,240,164,800 |  |
|    | 組入時価比率：99.1%      |                | 100.0%         |  |
|    | 合計                |                | 28,240,164,800 |  |

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

## 第２ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2021年 5月10日現在)

|      |               |
|------|---------------|
| 資産の部 |               |
| 流動資産 |               |
| 預金   | 1,823,463,782 |



|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| コール・ローン         | 1,545,039,277   |
| 国債証券            | 571,835,057,567 |
| 派生商品評価勘定        | 14,851,842      |
| 未収入金            | 15,082,757,755  |
| 未収利息            | 5,025,696,316   |
| 前払費用            | 197,043,726     |
| その他未収収益         | 16,169,413      |
| 流動資産合計          | 595,540,079,678 |
| 資産合計            | 595,540,079,678 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 28,888,627      |
| 未払金             | 6,783,561,753   |
| 未払解約金           | 11,376,973,565  |
| 未払利息            | 769             |
| その他未払費用         | 7,430,824       |
| 流動負債合計          | 18,196,855,538  |
| 負債合計            | 18,196,855,538  |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 229,270,699,136 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 348,072,525,004 |
| 元本等合計           | 577,343,224,140 |
| 純資産合計           | 577,343,224,140 |
| 負債純資産合計         | 595,540,079,678 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

## （貸借対照表に関する注記）

| 2021年 5月10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                        | 2.5182円          |
| (10,000口当たり純資産額)                 | (25,182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       |                  |
|                                  | 200,896,731,659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                             | 213,309,979,938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 5月12日<br>至 2021年 5月10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 5月10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 5月10日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2020年 5月12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 | 239,006,740,496円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 35,351,538,325円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 45,087,579,685円  |
| 期末元本額                            | 229,270,699,136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                       | 83,147,612円      |
| バランスセレクト７０                       | 77,285,302円      |
| 野村外国債券インデックスファンド                 | 278,297,835円     |
| 野村世界６資産分散投信（安定コース）               | 3,670,865,990円   |
| 野村世界６資産分散投信（分配コース）               | 23,740,455,752円  |
| 野村世界６資産分散投信（成長コース）               | 1,707,978,192円   |
| 野村資産設計ファンド２０１５                   | 20,274,883円      |
| 野村資産設計ファンド２０２０                   | 20,166,589円      |
| 野村資産設計ファンド２０２５                   | 37,769,319円      |
| 野村資産設計ファンド２０３０                   | 38,843,108円      |
| 野村資産設計ファンド２０３５                   | 28,572,800円      |
| 野村資産設計ファンド２０４０                   | 49,424,312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）    | 74,818,812,732円  |
| のむラップ・ファンド（保守型）                  | 5,645,802,658円   |
| のむラップ・ファンド（普通型）                  | 13,938,678,094円  |
| のむラップ・ファンド（積極型）                  | 3,147,958,870円   |
| 野村外国債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）            | 521,149,202円     |
| 野村資産設計ファンド２０４５                   | 6,762,765円       |
| 野村インデックスファンド・外国債券                | 848,053,397円     |
| マイ・ロード                           | 8,939,154,926円   |
| ネクストコア                           | 219,365,979円     |
| 野村インデックスファンド・海外５資産バランス           | 198,495,983円     |
| 野村外国債券インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）     | 8,623,483,999円   |
| 野村世界６資産分散投信（配分変更コース）             | 1,255,060,309円   |
| 野村資産設計ファンド２０５０                   | 7,775,081円       |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型 | 4,854,845円       |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型 | 2,051,455円       |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型 | 1,396,139円       |

|                                                     |                 |
|-----------------------------------------------------|-----------------|
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型                    | 1,031,054円      |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                                   | 573,888,162円    |
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                                   | 486,962,000円    |
| インデックス・ブレンド（タイプⅠ）                                   | 1,931,676円      |
| インデックス・ブレンド（タイプⅡ）                                   | 1,401,384円      |
| インデックス・ブレンド（タイプⅢ）                                   | 5,749,920円      |
| インデックス・ブレンド（タイプⅣ）                                   | 1,341,811円      |
| インデックス・ブレンド（タイプⅤ）                                   | 3,492,360円      |
| 野村6資産均等バランス                                         | 1,541,574,583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）                | 6,088,822,869円  |
| 世界6資産分散ファンド                                         | 63,024,121円     |
| 野村資産設計ファンド2060                                      | 2,854,794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 | 5,667,170,120円  |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券                              | 2,461,786,806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）                       | 6,372,815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）                    | 1,218,245,982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）                    | 190,957,541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）                    | 1,425,155,305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）                    | 1,146,434,164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）                    | 2,704,530円      |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）                  | 8,948,189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）                    | 279,596円        |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）                        | 3,284,276,560円  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）                   | 11,670,049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）                   | 59,766,492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）                      | 13,818,490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）                  | 178,098,999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）                  | 164,472,969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）                  | 1,934,128,760円  |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）                             | 94,875,236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）                      | 1,378,405,093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）                  | 1,042,220,964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）      | 5,659,288円      |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け）                                | 3,592,551円      |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け）                                | 7,290,687円      |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け）                                | 6,214,458円      |
| 野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）                            | 588,329,497円    |
| マイバランス30（確定拠出年金向け）                                  | 5,323,230,922円  |
| マイバランス50（確定拠出年金向け）                                  | 6,293,193,627円  |
| マイバランス70（確定拠出年金向け）                                  | 4,770,974,663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）                          | 18,011,444,164円 |
| マイバランスDC30                                          | 1,883,999,929円  |
| マイバランスDC50                                          | 1,391,309,022円  |
| マイバランスDC70                                          | 921,800,996円    |
| 野村DC外国債券インデックスファンド                                  | 7,108,981,810円  |
| 野村DC運用戦略ファンド                                        | 4,296,569,976円  |

|                               |              |
|-------------------------------|--------------|
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）            | 527,656,307円 |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け）         | 216,375,190円 |
| マイターゲット2030（確定拠出年金向け）         | 341,008,805円 |
| マイターゲット2040（確定拠出年金向け）         | 170,058,001円 |
| 野村世界6資産分散投信（DC）安定コース          | 14,191,473円  |
| 野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース        | 34,607,691円  |
| 野村世界6資産分散投信（DC）成長コース          | 15,062,740円  |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030   | 7,039,590円   |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040   | 4,902,707円   |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050   | 2,635,355円   |
| マイターゲット2035（確定拠出年金向け）         | 96,385,078円  |
| マイターゲット2045（確定拠出年金向け）         | 65,416,645円  |
| マイターゲット2055（確定拠出年金向け）         | 35,130,230円  |
| マイターゲット2060（確定拠出年金向け）         | 44,502,358円  |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060   | 1,142,063円   |
| マイターゲット2065（確定拠出年金向け）         | 5,310,864円   |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け） | 20,027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5月10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5月10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 | 44,136,513.20 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 45,100,000.00 | 48,061,446.40 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 62,100,000.00 | 77,547,375.00 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 14,800,000.00 | 19,486,280.88 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 48,600,000.00 | 63,016,733.16 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 48,000,000.00 | 61,687,497.60 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 28,200,000.00 | 36,417,654.84 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 100,000.00    | 134,625.00    |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 500,000.00    | 560,156.25    |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 4,100,000.00  | 5,246,878.65  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 16,300,000.00 | 16,564,875.00 |    |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 20,000,000.00 | 20,352,734.00 |  |
| US TREASURY N/B | 8,300,000.00  | 8,441,683.49  |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 204,171.86    |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 203,820.30    |  |
| US TREASURY N/B | 900,000.00    | 916,013.61    |  |
| US TREASURY N/B | 33,400,000.00 | 34,014,506.56 |  |
| US TREASURY N/B | 17,700,000.00 | 18,113,806.53 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 101,908.20    |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 203,976.56    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 102,375.00    |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 1,022,226.50  |  |
| US TREASURY N/B | 900,000.00    | 917,964.81    |  |
| US TREASURY N/B | 400,000.00    | 407,250.00    |  |
| US TREASURY N/B | 32,400,000.00 | 33,161,905.44 |  |
| US TREASURY N/B | 8,200,000.00  | 8,365,921.26  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 101,910.15    |  |
| US TREASURY N/B | 900,000.00    | 920,707.02    |  |
| US TREASURY N/B | 1,600,000.00  | 1,639,874.88  |  |
| US TREASURY N/B | 600,000.00    | 610,992.18    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 102,625.00    |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00  | 1,542,187.50  |  |
| US TREASURY N/B | 7,100,000.00  | 7,265,296.52  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 102,960.93    |  |
| US TREASURY N/B | 20,000,000.00 | 20,660,156.00 |  |
| US TREASURY N/B | 1,600,000.00  | 1,637,249.92  |  |
| US TREASURY N/B | 50,900,000.00 | 52,335,537.79 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 103,898.43    |  |
| US TREASURY N/B | 400,000.00    | 413,328.12    |  |
| US TREASURY N/B | 64,800,000.00 | 66,417,466.32 |  |
| US TREASURY N/B | 17,900,000.00 | 18,707,596.09 |  |
| US TREASURY N/B | 400,000.00    | 410,375.00    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 104,488.28    |  |
| US TREASURY N/B | 15,000,000.00 | 15,437,694.00 |  |
| US TREASURY N/B | 400,000.00    | 420,531.24    |  |
| US TREASURY N/B | 40,500,000.00 | 41,806,756.80 |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 9,200,000.00  | 9,476,000.00  |  |
| US TREASURY N/B | 9,100,000.00  | 9,585,214.73  |  |
| US TREASURY N/B | 800,000.00    | 820,437.44    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 105,257.81    |  |
| US TREASURY N/B | 4,300,000.00  | 4,401,621.04  |  |
| US TREASURY N/B | 37,100,000.00 | 39,212,960.01 |  |
| US TREASURY N/B | 6,500,000.00  | 6,841,503.50  |  |
| US TREASURY N/B | 10,900,000.00 | 11,198,046.33 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 1,059,101.50  |  |
| US TREASURY N/B | 35,200,000.00 | 36,190,000.00 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 1,063,828.10  |  |
| US TREASURY N/B | 10,600,000.00 | 10,971,000.00 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 1,065,859.30  |  |
| US TREASURY N/B | 42,600,000.00 | 45,305,764.56 |  |
| US TREASURY N/B | 9,200,000.00  | 9,645,265.28  |  |
| US TREASURY N/B | 29,300,000.00 | 31,280,038.33 |  |
| US TREASURY N/B | 43,000,000.00 | 45,275,972.80 |  |
| US TREASURY N/B | 800,000.00    | 850,312.48    |  |
| US TREASURY N/B | 4,300,000.00  | 4,533,476.24  |  |
| US TREASURY N/B | 1,300,000.00  | 1,379,878.89  |  |
| US TREASURY N/B | 800,000.00    | 855,312.48    |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 526,210.90    |  |
| US TREASURY N/B | 400,000.00    | 423,656.24    |  |
| US TREASURY N/B | 1,700,000.00  | 1,789,914.02  |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 525,078.10    |  |
| US TREASURY N/B | 700,000.00    | 740,441.38    |  |
| US TREASURY N/B | 20,900,000.00 | 22,286,257.29 |  |
| US TREASURY N/B | 2,200,000.00  | 2,313,179.66  |  |
| US TREASURY N/B | 17,700,000.00 | 18,629,940.30 |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 522,050.75    |  |
| US TREASURY N/B | 3,800,000.00  | 4,018,202.84  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 314,812.50    |  |
| US TREASURY N/B | 42,700,000.00 | 45,211,959.87 |  |
| US TREASURY N/B | 2,400,000.00  | 2,552,156.16  |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 518,496.05    |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 34,200,000.00 | 36,378,912.78 |  |
| US TREASURY N/B | 2,300,000.00  | 2,437,011.69  |  |
| US TREASURY N/B | 1,900,000.00  | 2,024,613.21  |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 1,074,687.50  |  |
| US TREASURY N/B | 18,100,000.00 | 19,120,952.22 |  |
| US TREASURY N/B | 1,900,000.00  | 2,062,242.14  |  |
| US TREASURY N/B | 17,300,000.00 | 17,707,494.58 |  |
| US TREASURY N/B | 32,700,000.00 | 35,363,261.31 |  |
| US TREASURY N/B | 34,500,000.00 | 37,703,376.75 |  |
| US TREASURY N/B | 8,050,000.00  | 8,559,098.90  |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 1,093,398.40  |  |
| US TREASURY N/B | 4,100,000.00  | 4,465,156.25  |  |
| US TREASURY N/B | 5,200,000.00  | 5,697,656.12  |  |
| US TREASURY N/B | 27,000,000.00 | 28,597,849.20 |  |
| US TREASURY N/B | 700,000.00    | 763,519.47    |  |
| US TREASURY N/B | 29,200,000.00 | 32,210,108.28 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 110,359.37    |  |
| US TREASURY N/B | 50,600,000.00 | 54,193,389.36 |  |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,992,968.00 |  |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,883,984.00 |  |
| US TREASURY N/B | 17,200,000.00 | 18,728,514.12 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00  | 2,083,750.00  |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 1,083,398.40  |  |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00  | 5,360,937.50  |  |
| US TREASURY N/B | 8,600,000.00  | 9,277,921.66  |  |
| US TREASURY N/B | 1,800,000.00  | 1,874,953.08  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 319,968.75    |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00  | 3,161,132.70  |  |
| US TREASURY N/B | 21,100,000.00 | 21,804,706.24 |  |
| US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 12,320,624.40 |  |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 10,394,921.00 |  |
| US TREASURY N/B | 5,600,000.00  | 5,814,812.08  |  |
| US TREASURY N/B | 13,000,000.00 | 13,765,780.60 |  |
| US TREASURY N/B | 30,000,000.00 | 31,142,577.00 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 104,492.18    |  |



|                 |               |                |  |
|-----------------|---------------|----------------|--|
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 206,031.24     |  |
| US TREASURY N/B | 11,300,000.00 | 12,116,159.45  |  |
| US TREASURY N/B | 1,400,000.00  | 1,411,484.34   |  |
| US TREASURY N/B | 17,000,000.00 | 16,476,717.90  |  |
| US TREASURY N/B | 38,000,000.00 | 41,013,278.40  |  |
| US TREASURY N/B | 8,700,000.00  | 9,321,574.11   |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 1,070,703.10   |  |
| US TREASURY N/B | 25,500,000.00 | 28,102,792.65  |  |
| US TREASURY N/B | 40,600,000.00 | 45,107,233.36  |  |
| US TREASURY N/B | 9,900,000.00  | 11,007,562.50  |  |
| US TREASURY N/B | 1,200,000.00  | 1,356,609.36   |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 547,265.60     |  |
| US TREASURY N/B | 1,100,000.00  | 1,183,359.32   |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 305,085.93     |  |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00  | 2,153,976.51   |  |
| US TREASURY N/B | 600,000.00    | 563,835.90     |  |
| US TREASURY N/B | 1,700,000.00  | 1,702,789.02   |  |
| US TREASURY N/B | 13,000,000.00 | 18,305,625.00  |  |
| US TREASURY N/B | 16,600,000.00 | 15,351,108.96  |  |
| US TREASURY N/B | 75,400,000.00 | 101,925,478.72 |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 959,218.70     |  |
| US TREASURY N/B | 16,300,000.00 | 21,900,577.31  |  |
| US TREASURY N/B | 6,200,000.00  | 8,849,530.94   |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 136,628.90     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 122,265.62     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 133,828.12     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 138,015.62     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 136,195.31     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 140,562.50     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 136,718.75     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 128,664.06     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 134,968.75     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 430,804.68     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 137,531.25     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 127,109.37     |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 116,453.12    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 116,656.25    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 114,367.18    |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 219,875.00    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 109,820.31    |  |
| US TREASURY N/B | 290,000.00    | 337,850.00    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 125,593.75    |  |
| US TREASURY N/B | 4,300,000.00  | 5,410,441.03  |  |
| US TREASURY N/B | 15,200,000.00 | 18,422,279.92 |  |
| US TREASURY N/B | 25,000,000.00 | 29,142,577.50 |  |
| US TREASURY N/B | 35,100,000.00 | 40,092,150.15 |  |
| US TREASURY N/B | 39,900,000.00 | 41,821,743.60 |  |
| US TREASURY N/B | 23,400,000.00 | 26,746,382.52 |  |
| US TREASURY N/B | 17,500,000.00 | 19,591,796.00 |  |
| US TREASURY N/B | 3,700,000.00  | 4,236,933.27  |  |
| US TREASURY N/B | 51,500,000.00 | 53,916,071.00 |  |
| US TREASURY N/B | 28,200,000.00 | 29,524,077.42 |  |
| US TREASURY N/B | 34,500,000.00 | 34,423,182.30 |  |
| US TREASURY N/B | 14,200,000.00 | 15,926,741.30 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00  | 2,295,468.60  |  |
| US TREASURY N/B | 1,700,000.00  | 1,951,878.80  |  |
| US TREASURY N/B | 11,400,000.00 | 12,514,616.76 |  |
| US TREASURY N/B | 9,300,000.00  | 10,216,557.78 |  |
| US TREASURY N/B | 9,500,000.00  | 10,930,194.60 |  |
| US TREASURY N/B | 5,100,000.00  | 6,004,452.87  |  |
| US TREASURY N/B | 10,500,000.00 | 12,098,378.25 |  |
| US TREASURY N/B | 6,100,000.00  | 7,520,632.66  |  |
| US TREASURY N/B | 2,470,000.00  | 2,850,630.70  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 112,769.53    |  |
| US TREASURY N/B | 11,250,000.00 | 11,199,022.87 |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 306,984.36    |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 942,304.60    |  |
| US TREASURY N/B | 2,200,000.00  | 1,716,257.62  |  |
| US TREASURY N/B | 9,100,000.00  | 7,330,120.98  |  |
| US TREASURY N/B | 6,900,000.00  | 5,929,956.60  |  |

|        |                         |                  |                                       |  |
|--------|-------------------------|------------------|---------------------------------------|--|
| 小計     | US TREASURY N/B         | 12,900,000.00    | 11,785,358.73                         |  |
|        | 銘柄数：187                 | 2,114,460,000.00 | 2,319,241,537.57<br>(252,263,902,041) |  |
|        | 組入時価比率：43.7%            |                  | 44.0%                                 |  |
| カナダドル  | CANADA GOVERNMENT       | 14,350,000.00    | 14,740,807.90                         |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 200,000.00       | 202,563.80                            |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 300,000.00       | 300,173.10                            |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 12,000,000.00    | 12,124,908.00                         |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 1,300,000.00     | 1,334,932.30                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 4,460,000.00     | 4,571,004.94                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 1,100,000.00     | 1,141,958.40                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 500,000.00       | 525,554.50                            |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 6,800,000.00     | 7,217,764.80                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 17,000,000.00    | 17,406,096.00                         |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 3,700,000.00     | 3,935,627.10                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 300,000.00       | 309,002.40                            |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 1,400,000.00     | 1,401,719.20                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 6,700,000.00     | 9,425,821.30                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 200,000.00       | 199,471.40                            |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 800,000.00       | 844,685.60                            |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 11,380,000.00    | 15,252,978.16                         |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 1,000,000.00     | 1,074,189.00                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 10,200,000.00    | 14,695,976.40                         |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 2,600,000.00     | 3,763,362.20                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 3,400,000.00     | 4,586,838.00                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 9,950,000.00     | 12,837,689.00                         |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 1,300,000.00     | 1,493,428.30                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 1,900,000.00     | 1,867,354.20                          |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 100,000.00       | 118,029.50                            |  |
| 小計     | 銘柄数：25                  | 112,940,000.00   | 131,371,935.50<br>(11,788,003,772)    |  |
|        | 組入時価比率：2.0%             |                  | 2.1%                                  |  |
|        |                         |                  |                                       |  |
| メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT | 44,400,000.00    | 45,246,601.44                         |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 17,300,000.00    | 17,876,060.59                         |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 87,300,000.00    | 94,049,660.61                         |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 65,000,000.00    | 74,475,050.00                         |  |

|     |                          |                |                 |      |
|-----|--------------------------|----------------|-----------------|------|
| 小計  | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 66,300,000.00  | 65,985,075.00   |      |
|     | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 112,300,000.00 | 120,144,649.12  |      |
|     | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 45,300,000.00  | 51,061,774.95   |      |
|     | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 68,100,000.00  | 73,203,788.55   |      |
|     | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 400,000.00     | 425,196.80      |      |
|     | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 41,300,000.00  | 52,028,463.83   |      |
|     | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 25,800,000.00  | 28,405,100.82   |      |
|     | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 52,200,000.00  | 52,875,812.52   |      |
|     | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 43,000,000.00  | 44,398,790.00   |      |
|     | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 107,700,000.00 | 115,361,778.00  |      |
|     | 銘柄数：14                   | 776,400,000.00 | 835,537,802.23  |      |
|     | 組入時価比率：0.8%              |                | (4,564,125,244) | 0.8% |
| ユーロ | BELGIUM KINGDOM          | 600,000.00     | 641,100.00      |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 3,800,000.00   | 4,035,977.34    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 1,900,000.00   | 1,939,805.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 4,000,000.00   | 4,403,200.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 1,000,000.00   | 1,037,754.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 1,700,000.00   | 1,794,392.50    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 6,700,000.00   | 8,348,461.30    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 3,300,000.00   | 3,544,827.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 2,000,000.00   | 2,139,564.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 1,000,000.00   | 1,074,096.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 6,500,000.00   | 7,038,115.50    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 5,200,000.00   | 5,688,384.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 1,700,000.00   | 2,413,920.10    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00     | 112,320.00      |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 500,000.00     | 572,729.95      |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00     | 121,961.60      |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 4,600,000.00   | 7,677,183.80    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 4,000,000.00   | 6,587,268.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 5,200,000.00   | 6,077,182.80    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 2,700,000.00   | 3,229,566.12    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 1,200,000.00   | 1,653,900.00    |      |
|     | BELGIUM KINGDOM          | 1,000,000.00   | 1,377,164.00    |      |
|     |                          |                |                 |      |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BELGIUM KINGDOM GOVT     | 11,500,000.00 | 16,137,254.25 |  |
| BELGIUM KINGDOM GOVT     | 10,500,000.00 | 17,128,945.05 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,400,000.00  | 5,464,800.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 14,800,000.00 | 16,323,033.96 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,200,000.00  | 4,281,382.14  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,300,000.00  | 8,194,457.32  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 15,600,000.00 | 17,861,095.20 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 6,900,000.00  | 7,780,095.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 450,000.00    | 499,539.87    |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 900,000.00    | 969,588.00    |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 12,900,000.00 | 15,624,041.40 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,000,000.00  | 5,547,625.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,000,000.00  | 4,431,736.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 22,400,000.00 | 29,545,411.84 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,600,000.00  | 8,314,400.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2,000,000.00  | 2,183,421.80  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,000,000.00  | 5,460,500.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 11,500,000.00 | 15,799,850.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2,000,000.00  | 2,286,716.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,400,000.00  | 6,439,500.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,000,000.00  | 1,135,687.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,900,000.00  | 3,161,696.90  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,700,000.00  | 7,718,725.40  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 10,000,000.00 | 17,925,570.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,200,000.00  | 4,281,212.16  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 10,500,000.00 | 13,636,045.50 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,700,000.00  | 5,632,661.70  |  |
| BUNDESobligation         | 250,000.00    | 252,455.00    |  |
| BUNDESobligation         | 500,000.00    | 506,925.00    |  |
| BUNDESobligation         | 2,000,000.00  | 2,047,260.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 400,000.00    | 411,260.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 300,000.00    | 308,763.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 390,000.00    | 405,369.90    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,400,000.00  | 5,643,432.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,580,000.00  | 2,740,863.00  |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 25,600,000.00 | 30,402,560.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,700,000.00  | 1,817,079.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 10,800,000.00 | 11,525,760.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,700,000.00  | 8,132,971.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,700,000.00  | 2,821,635.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,100,000.00  | 9,751,560.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 23,200,000.00 | 24,462,544.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,000,000.00  | 1,031,390.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 700,000.00    | 733,005.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 20,200,000.00 | 29,130,420.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 200,000.00    | 213,008.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 18,200,000.00 | 25,783,758.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 600,000.00    | 640,398.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 8,200,000.00  | 11,326,988.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 18,600,000.00 | 29,486,952.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 8,400,000.00  | 13,190,688.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,400,000.00  | 15,484,949.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 10,700,000.00 | 17,401,035.50 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,800,000.00  | 6,676,106.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,000,000.00  | 7,552,372.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,130,000.00  | 1,863,029.87  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,800,000.00  | 8,833,411.60  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 11,600,000.00 | 17,995,544.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 13,600,000.00 | 16,962,192.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 900,000.00    | 914,850.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 400,000.00    | 406,236.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,200,000.00  | 1,291,680.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,500,000.00  | 1,536,202.50  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 23,160,000.00 | 25,146,433.20 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,800,000.00  | 2,817,640.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,700,000.00  | 4,806,690.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 102,262.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,800,000.00  | 1,970,870.40  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00    | 556,000.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,000,000.00  | 1,063,700.00  |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 18,700,000.00 | 22,965,470.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 16,200,000.00 | 18,318,960.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 300,000.00    | 317,730.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 600,000.00    | 634,620.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,800,000.00  | 6,533,120.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,700,000.00  | 4,942,050.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,000,000.00  | 1,089,600.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 16,800,000.00 | 19,989,889.92 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 800,000.00    | 844,720.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,000,000.00  | 3,175,191.60  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,000,000.00  | 7,749,700.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,000,000.00  | 3,255,000.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 11,900,000.00 | 14,362,110.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,000,000.00  | 2,190,000.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 18,100,000.00 | 24,938,180.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 219,900.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 22,500,000.00 | 31,171,500.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,000,000.00  | 10,371,200.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 29,900,000.00 | 41,019,810.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,000,000.00  | 1,070,919.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 16,000,000.00 | 23,790,400.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00    | 532,750.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,900,000.00 | 16,480,800.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,400,000.00  | 1,607,620.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 20,400,000.00 | 29,688,120.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 13,200,000.00 | 16,639,920.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,700,000.00  | 3,669,300.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00    | 612,000.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,000,000.00  | 7,763,500.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 248,980.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 11,200,000.00 | 17,508,960.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,800,000.00  | 13,826,560.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,500,000.00  | 7,073,000.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,800,000.00  | 3,747,520.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,000,000.00  | 9,999,500.00  |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 9,100,000.00  | 10,139,220.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,000,000.00  | 3,462,150.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 100,000.00    | 103,125.20    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 100,000.00    | 104,230.00    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 400,000.00    | 406,275.88    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 700,000.00    | 754,915.00    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 3,600,000.00  | 4,288,860.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 100,000.00    | 106,202.50    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 2,000,000.00  | 2,098,464.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 3,300,000.00  | 4,026,029.70  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 2,400,000.00  | 2,527,752.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 800,000.00    | 858,743.20    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 200,000.00    | 223,533.30    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 4,000,000.00  | 3,884,720.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 400,000.00    | 576,205.60    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 300,000.00    | 361,678.50    |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 4,200,000.00  | 4,248,636.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 2,600,000.00  | 2,631,278.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 1,570,000.00  | 1,647,178.06  |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 100,000.00    | 101,720.00    |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 10,100,000.00 | 10,981,315.90 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 1,800,000.00  | 1,836,000.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 13,000,000.00 | 13,538,174.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 1,800,000.00  | 1,883,739.60  |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 13,300,000.00 | 13,753,410.30 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 8,000,000.00  | 8,640,064.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 4,900,000.00  | 5,231,975.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 11,600,000.00 | 12,393,718.40 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 2,000,000.00  | 2,095,180.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 9,400,000.00  | 11,534,270.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 10,100,000.00 | 11,276,407.60 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 100,000.00    | 111,640.00    |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 100,000.00    | 120,588.90    |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 10,400,000.00 | 13,264,316.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 2,000,000.00  | 2,301,320.00  |  |



|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| FRANCE (GOVT OF)        | 500,000.00    | 471,597.00    |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 200,000.00    | 201,346.88    |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 16,000,000.00 | 16,683,600.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 11,100,000.00 | 13,111,320.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 25,600,000.00 | 28,696,320.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3,000,000.00  | 3,248,055.00  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,500,000.00  | 12,283,500.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6,000,000.00  | 6,402,600.00  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 33,800,000.00 | 40,487,330.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3,700,000.00  | 4,434,080.00  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 27,000,000.00 | 39,188,691.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 13,000,000.00 | 14,827,437.30 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 20,400,000.00 | 33,351,021.60 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 18,300,000.00 | 29,321,760.60 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 300,000.00    | 474,450.30    |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,800,000.00  | 10,026,170.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 25,550,000.00 | 39,508,046.76 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,650,000.00  | 10,617,660.80 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 9,700,000.00  | 19,042,778.10 |  |
| IRISH GOVERNMENT        | 4,630,000.00  | 5,686,996.59  |  |
| IRISH GOVERNMENT        | 6,500,000.00  | 6,993,376.00  |  |
| IRISH TSY 1.10% 2029    | 600,000.00    | 655,442.40    |  |
| IRISH TSY 1.3% 2033     | 3,200,000.00  | 3,581,779.20  |  |
| IRISH TSY 1.35% 2031    | 2,000,000.00  | 2,244,312.00  |  |
| IRISH TSY 1.5% 2050     | 2,600,000.00  | 2,985,816.60  |  |
| IRISH TSY 1.7% 2037     | 2,900,000.00  | 3,432,727.10  |  |
| IRISH TSY 1% 2026       | 4,600,000.00  | 4,923,032.24  |  |
| IRISH TSY 2.4% 2030     | 6,000,000.00  | 7,284,618.00  |  |
| IRISH TSY 2% 2045       | 1,600,000.00  | 2,031,488.00  |  |
| IRISH TSY 2022          | 2,200,000.00  | 2,219,483.20  |  |
| IRISH TSY 3.4% 2024     | 6,100,000.00  | 6,793,612.70  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 100,000.00    | 103,473.80    |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 200,000.00    | 215,080.00    |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 3,500,000.00  | 4,041,800.00  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 400,000.00    | 421,800.00    |  |

|                        |               |               |  |
|------------------------|---------------|---------------|--|
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00    | 101,920.00    |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 7,700,000.00  | 8,360,744.70  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 1,500,000.00  | 1,553,223.00  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 1,900,000.00  | 1,999,655.00  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2,500,000.00  | 2,681,086.50  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 12,300,000.00 | 17,192,940.00 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 1,000,000.00  | 1,077,900.00  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2,400,000.00  | 2,503,440.00  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 8,900,000.00  | 11,524,102.70 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 3,700,000.00  | 5,926,970.80  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 500,000.00    | 523,002.00    |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,100,000.00  | 6,993,722.60  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 6,900,000.00  | 11,015,698.20 |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 800,000.00    | 1,302,558.40  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 100,000.00    | 100,912.90    |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 200,000.00    | 212,560.40    |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 900,000.00    | 912,510.00    |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 150,000.00    | 158,862.75    |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1,300,000.00  | 1,324,960.00  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 700,000.00    | 755,246.10    |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 1,300,000.00  | 1,400,896.90  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 5,400,000.00  | 6,824,520.00  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 2,000,000.00  | 2,130,878.00  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 7,600,000.00  | 10,758,202.80 |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 9,600,000.00  | 10,115,520.00 |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 7,600,000.00  | 9,771,434.00  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 400,000.00    | 639,742.00    |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3,200,000.00  | 5,067,486.40  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 5,600,000.00  | 6,806,240.00  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 2,000,000.00  | 2,045,390.00  |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA    | 950,000.00    | 1,959,963.05  |  |
| REPUBLIC OF IRELAND    | 9,850,000.00  | 10,678,950.39 |  |
| SPANISH GOVERNMENT     | 16,000,000.00 | 23,155,782.40 |  |
| SPANISH GOVERNMENT     | 27,800,000.00 | 43,523,680.00 |  |
| SPANISH GOVERNMENT     | 4,200,000.00  | 6,235,580.40  |  |

|     |              |                  |                                       |  |
|-----|--------------|------------------|---------------------------------------|--|
| 小計  | 銘柄数：232      | 1,374,510,000.00 | 1,774,612,635.19<br>(234,816,743,888) |  |
|     | 組入時価比率：40.7% |                  | 41.1%                                 |  |
| 英債券 | UK TREASURY  | 500,000.00       | 511,566.50                            |  |
|     | UK TREASURY  | 3,000,000.00     | 3,005,391.00                          |  |
|     | UK TREASURY  | 16,700,000.00    | 16,970,453.16                         |  |
|     | UK TREASURY  | 2,300,000.00     | 2,419,193.36                          |  |
|     | UK TREASURY  | 1,600,000.00     | 1,642,999.52                          |  |
|     | UK TREASURY  | 7,450,000.00     | 8,102,593.92                          |  |
|     | UK TREASURY  | 14,750,000.00    | 17,470,768.77                         |  |
|     | UK TREASURY  | 200,000.00       | 203,554.20                            |  |
|     | UK TREASURY  | 200,000.00       | 215,510.80                            |  |
|     | UK TREASURY  | 510,000.00       | 540,667.01                            |  |
|     | UK TREASURY  | 400,000.00       | 419,556.80                            |  |
|     | UK TREASURY  | 12,730,000.00    | 15,846,662.98                         |  |
|     | UK TREASURY  | 200,000.00       | 215,470.80                            |  |
|     | UK TREASURY  | 4,800,000.00     | 6,717,608.64                          |  |
|     | UK TREASURY  | 7,700,000.00     | 10,527,948.20                         |  |
|     | UK TREASURY  | 7,500,000.00     | 10,146,310.50                         |  |
|     | UK TREASURY  | 12,300,000.00    | 17,623,563.00                         |  |
|     | UK TREASURY  | 750,000.00       | 1,073,962.50                          |  |
|     | UK TREASURY  | 100,000.00       | 157,278.00                            |  |
|     | UK TREASURY  | 600,000.00       | 903,306.00                            |  |
|     | UK TREASURY  | 500,000.00       | 763,870.00                            |  |
|     | UK TREASURY  | 570,000.00       | 919,387.20                            |  |
|     | UK TREASURY  | 18,440,000.00    | 26,794,057.60                         |  |
|     | UK TREASURY  | 5,900,000.00     | 9,691,045.00                          |  |
|     | UK TREASURY  | 8,200,000.00     | 8,555,742.24                          |  |
|     | UK TREASURY  | 16,100,000.00    | 17,788,246.00                         |  |
|     | UK TREASURY  | 5,350,000.00     | 9,137,907.00                          |  |
|     | UK TREASURY  | 6,750,000.00     | 11,029,230.00                         |  |
|     | UK TREASURY  | 1,000,000.00     | 1,092,280.40                          |  |
|     | UK TREASURY  | 700,000.00       | 803,111.96                            |  |
|     | UK TREASURY  | 1,200,000.00     | 2,233,087.20                          |  |
|     | UK TREASURY  | 100,000.00       | 145,037.00                            |  |
|     |              |                  |                                       |  |

|               |                           |                |                                    |  |
|---------------|---------------------------|----------------|------------------------------------|--|
| 小計            | UK TREASURY               | 200,000.00     | 369,460.00                         |  |
|               | UK TSY 3 1/4% 2044        | 21,800,000.00  | 30,249,462.00                      |  |
|               | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT | 6,200,000.00   | 11,404,714.00                      |  |
|               | 銘柄数：35                    | 187,300,000.00 | 245,691,003.26<br>(37,504,731,647) |  |
|               | 組入時価比率：6.5%               |                | 6.6%                               |  |
| スウェーデン<br>ローナ | SWEDISH GOVERNMENT        | 32,050,000.00  | 33,350,589.00                      |  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT        | 7,900,000.00   | 8,255,353.06                       |  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT        | 33,950,000.00  | 37,548,700.00                      |  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT        | 12,000,000.00  | 12,667,500.00                      |  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT        | 16,800,000.00  | 17,504,376.96                      |  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT        | 18,900,000.00  | 19,670,175.00                      |  |
|               | SWEDISH GOVERNMENT        | 21,300,000.00  | 31,297,874.94                      |  |
|               | 銘柄数：7                     | 142,900,000.00 | 160,294,568.96<br>(2,099,858,853)  |  |
|               | 組入時価比率：0.4%               |                | 0.4%                               |  |
| ノルウェー<br>クロネ  | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 5,300,000.00   | 5,465,227.50                       |  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 37,800,000.00  | 40,312,490.40                      |  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 12,500,000.00  | 12,940,562.50                      |  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 5,700,000.00   | 5,849,340.00                       |  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 9,600,000.00   | 9,945,600.00                       |  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 9,400,000.00   | 9,903,840.00                       |  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 22,000,000.00  | 22,792,550.00                      |  |
|               | NORWEGIAN GOVERNMENT      | 6,500,000.00   | 6,516,932.50                       |  |
|               | 銘柄数：8                     | 108,800,000.00 | 113,726,542.90<br>(1,508,013,958)  |  |
| デンマーク<br>クロネ  | KINGDOM OF DENMARK        | 400,000.00     | 404,320.00                         |  |
|               | KINGDOM OF DENMARK        | 24,270,000.00  | 25,495,635.00                      |  |
|               | KINGDOM OF DENMARK        | 29,300,000.00  | 32,212,420.00                      |  |
|               | KINGDOM OF DENMARK        | 15,700,000.00  | 16,488,140.00                      |  |
|               | KINGDOM OF DENMARK        | 26,300,000.00  | 27,659,710.00                      |  |
|               | KINGDOM OF DENMARK        | 35,800,000.00  | 63,165,520.00                      |  |
|               | 銘柄数：6                     | 131,770,000.00 | 165,425,745.00<br>(2,942,924,003)  |  |
|               | 組入時価比率：0.5%               |                | 0.5%                               |  |

|          |                        |                |                  |      |
|----------|------------------------|----------------|------------------|------|
| ズロチ      | POLAND GOVERNMENT BOND | 49,800,000.00  | 51,856,740.00    |      |
|          | POLAND GOVERNMENT BOND | 33,000,000.00  | 35,032,347.90    |      |
|          | POLAND GOVERNMENT BOND | 34,800,000.00  | 37,932,000.00    |      |
|          | 銘柄数：3                  | 117,600,000.00 | 124,821,087.90   |      |
|          | 組入時価比率：0.6%            |                | (3,626,776,565)  | 0.6% |
| 豪ドル      | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 7,520,000.00   | 8,023,088.00     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 80,000.00      | 82,643.20        |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3,900,000.00   | 4,310,498.01     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 5,100,000.00   | 5,496,525.00     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 9,400,000.00   | 10,434,409.84    |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 12,780,000.00  | 15,014,441.14    |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 12,400,000.00  | 15,176,764.24    |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2,200,000.00   | 2,440,593.76     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,100,000.00   | 1,221,805.86     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 10,100,000.00  | 11,597,319.95    |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 13,300,000.00  | 14,745,710.00    |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 22,200,000.00  | 24,135,891.06    |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 5,700,000.00   | 5,407,790.64     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 800,000.00     | 790,978.24       |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 7,700,000.00   | 9,993,680.62     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,300,000.00   | 1,422,538.13     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 8,250,000.00   | 10,065,054.45    |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 700,000.00     | 798,770.00       |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,500,000.00   | 1,584,436.05     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 4,900,000.00   | 5,298,860.00     |      |
|          | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3,000,000.00   | 2,453,400.00     |      |
|          | 銘柄数：21                 | 133,930,000.00 | 150,495,198.19   |      |
|          | 組入時価比率：2.2%            |                | (12,858,309,733) | 2.2% |
| シンガポールドル | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2,700,000.00   | 2,796,930.00     |      |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 500,000.00     | 511,620.00       |      |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 4,100,000.00   | 4,298,850.00     |      |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1,450,000.00   | 1,506,695.00     |      |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2,300,000.00   | 2,478,940.00     |      |
|          | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1,100,000.00   | 1,174,030.00     |      |

|     |                      |               |                 |  |
|-----|----------------------|---------------|-----------------|--|
| 小計  | SINGAPORE GOVERNMENT | 700,000.00    | 741,440.00      |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 3,900,000.00  | 4,426,500.00    |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 500,000.00    | 545,250.00      |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 300,000.00    | 334,050.00      |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,850,000.00  | 3,191,914.50    |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,200,000.00  | 1,419,000.00    |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,920,000.00  | 2,025,427.20    |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 2,750,000.00  | 3,150,125.00    |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,000,000.00  | 1,161,500.00    |  |
|     | SINGAPORE GOVERNMENT | 1,000,000.00  | 1,002,220.00    |  |
|     | 銘柄数：16               | 28,270,000.00 | 30,764,491.70   |  |
|     |                      |               | (2,525,149,478) |  |
|     | 組入時価比率：0.4%          |               | 0.4%            |  |
| リング | MALAYSIA GOVERNMENT  | 400,000.00    | 422,091.40      |  |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT  | 2,600,000.00  | 2,815,741.24    |  |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT  | 2,700,000.00  | 2,693,796.48    |  |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT  | 400,000.00    | 431,167.60      |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 500,000.00    | 509,434.00      |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 500,000.00    | 512,633.35      |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 13,500,000.00 | 13,842,597.60   |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3,900,000.00  | 4,023,098.04    |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,200,000.00  | 2,280,027.42    |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5,800,000.00  | 6,121,540.40    |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 600,000.00    | 634,975.62      |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 15,600,000.00 | 16,862,660.88   |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,600,000.00  | 4,888,323.40    |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 7,000,000.00  | 7,256,039.00    |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,200,000.00  | 2,310,999.68    |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 280,000.00    | 294,916.52      |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 12,700,000.00 | 13,919,565.76   |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,400,000.00  | 4,689,274.48    |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 800,000.00    | 804,862.32      |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,300,000.00  | 2,397,549.90    |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 9,700,000.00  | 10,581,521.45   |  |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,100,000.00  | 4,325,852.60    |  |
|     |                      |               |                 |  |

|       |                      |               |                   |  |
|-------|----------------------|---------------|-------------------|--|
| 小計    | MALAYSIAN GOVERNMENT | 300,000.00    | 325,170.78        |  |
|       | 銘柄数：23               | 97,080,000.00 | 102,943,839.92    |  |
|       |                      |               | (2,730,575,059)   |  |
|       | 組入時価比率：0.5%          |               | 0.5%              |  |
| 新シェケル | ISRAEL FIXED BOND    | 9,800,000.00  | 9,884,132.02      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,000,000.00  | 5,088,181.50      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,000,000.00  | 5,386,712.50      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,000,000.00  | 5,164,168.00      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,900,000.00  | 6,492,598.36      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,000,000.00  | 5,274,839.00      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 6,500,000.00  | 8,478,101.45      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,000,000.00  | 5,382,041.00      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,000,000.00  | 5,477,325.50      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,500,000.00  | 5,430,172.55      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 6,000,000.00  | 9,452,593.20      |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND    | 5,000,000.00  | 6,351,702.00      |  |
|       | 銘柄数：12               | 68,700,000.00 | 77,862,567.08     |  |
|       |                      |               | (2,605,943,326)   |  |
|       | 組入時価比率：0.5%          |               | 0.5%              |  |
| 合計    |                      |               | 571,835,057,567   |  |
|       |                      |               | (571,835,057,567) |  |

(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 5月10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  | 540,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 5,865,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 8,075,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,190,000  |    |
|      |     | 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  | 30,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 3,775,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 15,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 14,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 425,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 12,000,000 |    |

|                  |            |  |
|------------------|------------|--|
| US TREASURY N/B  | 7,586,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 19,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 29,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 21,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 12,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 565,000    |  |
| US TREASURY BOND | 5,000,000  |  |
| US TREASURY BOND | 18,000,000 |  |
| US TREASURY BOND | 40,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 18,600,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 15,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 12,000,000 |  |
| US TREASURY BOND | 40,000,000 |  |
| US TREASURY BOND | 50,000,000 |  |
| US TREASURY BOND | 12,000,000 |  |
| US TREASURY BOND | 32,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 9,945,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 9,980,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 304,000    |  |
| US TREASURY N/B  | 29,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 10,200,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 8,400,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 10,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 45,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 340,000    |  |
| US TREASURY N/B  | 1,300,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 230,000    |  |
| US TREASURY N/B  | 6,035,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 250,000    |  |
| US TREASURY N/B  | 75,000     |  |
| US TREASURY N/B  | 25,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 28,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 34,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 1,785,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 40,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 5,000,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 27,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 255,000    |  |
| US TREASURY N/B  | 950,000    |  |
| US TREASURY N/B  | 22,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 340,000    |  |
| US TREASURY N/B  | 15,000,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 11,050,000 |  |
| US TREASURY N/B  | 7,000,000  |  |
| US TREASURY N/B  | 85,000     |  |
| US TREASURY N/B  | 1,870,000  |  |
| 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          | 29,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 3,341,000  |  |
|       | US TREASURY N/B          | 39,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 35,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 1,550,000  |  |
|       | US TREASURY BOND         | 335,000    |  |
|       | US TREASURY BOND         | 30,618,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 30,000,000 |  |
|       | 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          | 155,000    |  |
|       | US TREASURY N/B          | 2,000,000  |  |
|       | US TREASURY N/B          | 12,750,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 27,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 680,000    |  |
|       | US TREASURY N/B          | 20,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 210,000    |  |
|       | US TREASURY N/B          | 36,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 30,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 3,784,000  |  |
|       | US TREASURY N/B          | 1,300,000  |  |
|       | US TREASURY N/B          | 10,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 23,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 2,000,000  |  |
|       | US TREASURY N/B          | 27,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 24,000,000 |  |
|       | US TREASURY N/B          | 850,000    |  |
|       | US TREASURY N/B          | 16,000,000 |  |
| 豪ドル   | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 10,500,000 |  |
| 新シェケル | ISRAEL FIXED BOND        | 200,000    |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 4,200,000  |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 2,000,000  |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 2,250,000  |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 300,000    |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 300,000    |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 900,000    |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 808,000    |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 4,250,000  |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 5,000,000  |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND        | 1,300,000  |  |
| ユーロ   | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,295,000  |  |
|       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 17,100,000 |  |

|  |                          |            |  |
|--|--------------------------|------------|--|
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,218,708  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 850,000    |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,700,000  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 10,400,000 |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,075,000  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,900,000  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,000,000  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 860,000    |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 960,000    |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,900,000  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,020,000  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,900,000  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,100,000  |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 15,000,000 |  |
|  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 15,300,000 |  |
|  | FRANCE (GOVT OF)         | 6,800,000  |  |
|  | FRANCE (GOVT OF)         | 8,585,000  |  |
|  | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 11,000,000 |  |
|  | FRANCE (GOVT OF)         | 8,500,000  |  |
|  | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 4,300,000  |  |
|  | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 14,700,000 |  |
|  | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 8,000,000  |  |
|  | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,000,000  |  |
|  | SPANISH GOVERNMENT       | 18,000,000 |  |
|  | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 1,700,000  |  |
|  | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 6,400,000  |  |
|  | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,802,000  |  |

## 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 5月10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        | 9,895,332,945 | —     | 9,909,369,730 | △14,036,785 |
| 米ドル       | 4,354,661,322 | —     | 4,339,881,480 | 14,779,842  |
| カナダドル     | 269,259,000   | —     | 269,187,000   | 72,000      |
| メキシコペソ    | 151,961,600   | —     | 152,930,400   | △968,800    |
| ユーロ       | 3,988,619,083 | —     | 4,009,327,290 | △20,708,207 |
| 英ポンド      | 652,185,300   | —     | 656,388,120   | △4,202,820  |
| デンマーククローネ | 70,890,400    | —     | 71,162,400    | △272,000    |
| ズロチ       | 86,337,000    | —     | 87,167,100    | △830,100    |
| 豪ドル       | 288,660,000   | —     | 290,494,980   | △1,834,980  |

|          |               |   |               |             |
|----------|---------------|---|---------------|-------------|
| シンガポールドル | 32,759,240    | — | 32,830,960    | △71,720     |
| 合計       | 9,895,332,945 | — | 9,909,369,730 | △14,036,785 |

（注）時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

#### バランスセレクト70（確定拠出年金向け）

2021年5月31日現在

|                     |              |
|---------------------|--------------|
| I 資産総額              | 158,086,483円 |
| II 負債総額             | 5,133,338円   |
| III 純資産総額（I－II）     | 152,953,145円 |
| IV 発行済口数            | 62,725,271口  |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 2.4385円      |

#### （参考）国内株式マザーファンド

2021年5月31日現在

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| I 資産総額              | 405,687,031,544円 |
| II 負債総額             | 20,935,689,723円  |
| III 純資産総額（I－II）     | 384,751,341,821円 |
| IV 発行済口数            | 191,363,067,863口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 2.0106円          |

#### （参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

2021年5月31日現在

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| I 資産総額              | 1,014,440,356,540円 |
| II 負債総額             | 4,850,710,938円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 1,009,589,645,602円 |
| IV 発行済口数            | 251,502,350,226口   |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 4.0142円            |

#### （参考）国内債券マザーファンド

2021年5月31日現在

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| I 資産総額              | 29,705,969,280円 |
| II 負債総額             | 939,418,030円    |
| III 純資産総額（I－II）     | 28,766,551,250円 |
| IV 発行済口数            | 21,094,736,861口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.3637円         |

## （参考）外国債券マザーファンド

2021年5月31日現在

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| I 資産総額              | 589,307,105,161円 |
| II 負債総額             | 961,003,753円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 588,346,101,408円 |
| IV 発行済口数            | 231,233,781,285口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 2.5444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、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、受益権の再分割を行ないません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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6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。

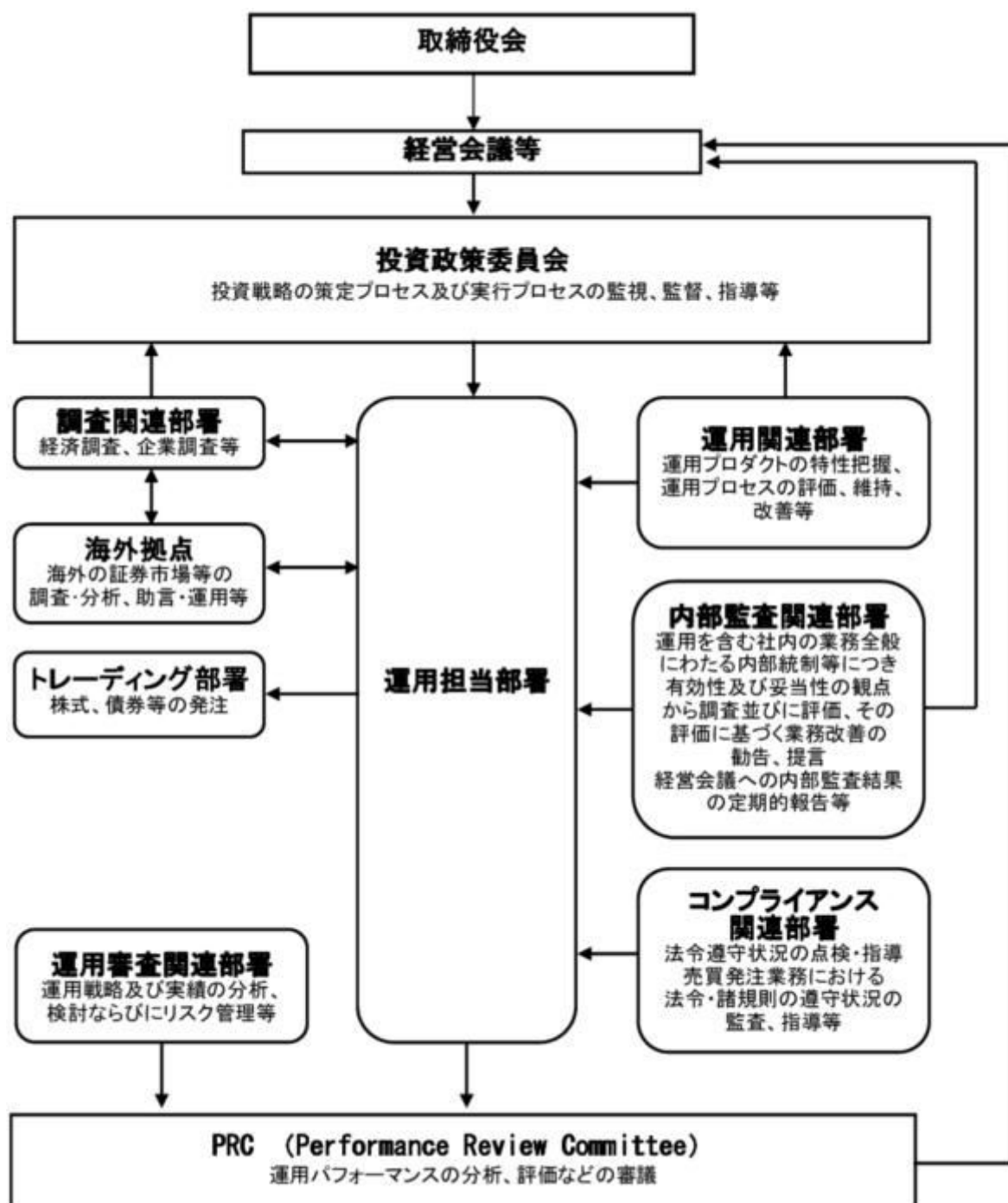
###### 代表取締役・業務執行取締役

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5月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。 )。

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



|            |       |            |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託  | 995   | 37,855,738 |
| 単位型株式投資信託  | 190   | 802,250    |
| 追加型公社債投資信託 | 14    | 6,366,572  |
| 単位型公社債投資信託 | 498   | 1,612,797  |
| 合計         | 1,697 | 46,637,357 |

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

|          |          | 前事業年度<br>(2020年3月31日) | 当事業年度<br>(2021年3月31日) |
|----------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 区分       | 注記<br>番号 | 金額(百万円)               | 金額(百万円)               |
| (資産の部)   |          |                       |                       |
| 流動資産     |          |                       |                       |
| 現金・預金    |          | 2,626                 | 4,281                 |
| 金銭の信託    |          | 41,524                | 35,912                |
| 有価証券     |          | 24,399                | 30,400                |
| 前払費用     |          | 106                   | 167                   |
| 未収入金     |          | 522                   | 632                   |
| 未収委託者報酬  |          | 23,936                | 24,499                |
| 未収運用受託報酬 |          | 4,336                 | 4,347                 |
| その他      |          | 71                    | 268                   |
| 貸倒引当金    |          | △14                   | △14                   |
| 流動資産計    |          | 97,509                | 100,496               |
| 固定資産     |          |                       |                       |
| 有形固定資産   |          | 645                   | 2,666                 |
| 建物       | ※ 2      | 295                   | 1,935                 |
| 器具備品     | ※ 2      | 349                   | 731                   |
| 無形固定資産   |          | 5,894                 | 5,429                 |
| ソフトウェア   |          | 5,893                 | 5,428                 |
| その他      |          | 0                     | 0                     |
| 投資その他の資産 |          | 16,486                | 16,487                |

|          |  |        |         |       |         |
|----------|--|--------|---------|-------|---------|
| 投資有価証券   |  | 1,437  |         | 1,767 |         |
| 関係会社株式   |  | 10,171 |         | 9,942 |         |
| 従業員長期貸付金 |  | 16     |         | -     |         |
| 長期差入保証金  |  | 329    |         | 330   |         |
| 長期前払費用   |  | 19     |         | 15    |         |
| 前払年金費用   |  | 1,545  |         | 1,301 |         |
| 繰延税金資産   |  | 2,738  |         | 3,008 |         |
| その他      |  | 229    |         | 122   |         |
| 貸倒引当金    |  | △0     |         | -     |         |
| 固定資産計    |  |        | 23,026  |       | 24,583  |
| 資産合計     |  |        | 120,536 |       | 125,080 |

|              |          | 前事業年度<br>(2020年3月31日) |        | 当事業年度<br>(2021年3月31日) |        |
|--------------|----------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
| 区分           | 注記<br>番号 | 金額(百万円)               |        | 金額(百万円)               |        |
| (負債の部)       |          |                       |        |                       |        |
| 流動負債         |          |                       |        |                       |        |
| 預り金          |          |                       | 157    |                       | 123    |
| 未払金          |          |                       | 15,279 |                       | 16,948 |
| 未払収益分配金      |          | 0                     |        | 0                     |        |
| 未払償還金        |          | 3                     |        | 8                     |        |
| 未払手数料        |          | 6,948                 |        | 7,256                 |        |
| 関係会社未払金      |          | 7,262                 |        | 8,671                 |        |
| その他未払金       |          | 1,063                 |        | 1,011                 |        |
| 未払費用         | ※ 1      |                       | 10,290 |                       | 9,171  |
| 未払法人税等       |          |                       | 1,564  |                       | 2,113  |
| 前受収益         |          |                       | 26     |                       | 22     |
| 賞与引当金        |          |                       | 3,985  |                       | 3,795  |
| その他          |          |                       | 67     |                       | -      |
| 流動負債計        |          |                       | 31,371 |                       | 32,175 |
| 固定負債         |          |                       |        |                       |        |
| 退職給付引当金      |          |                       | 3,311  |                       | 3,299  |
| 時効後支払損引当金    |          |                       | 572    |                       | 580    |
| 資産除去債務       |          |                       | -      |                       | 1,371  |
| 固定負債計        |          |                       | 3,883  |                       | 5,250  |
| 負債合計         |          |                       | 35,254 |                       | 37,425 |
| (純資産の部)      |          |                       |        |                       |        |
| 株主資本         |          |                       | 85,270 |                       | 87,596 |
| 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        |          |                       | 54,360 |                       | 56,686 |
| 利益準備金        |          | 685                   |        | 685                   |        |
| その他利益剰余金     |          | 53,675                |        | 56,001                |        |
| 別途積立金        |          | 24,606                |        | 24,606                |        |
| 繰越利益剰余金      |          | 29,069                |        | 31,395                |        |
| 評価・換算差額等     |          |                       | 10     |                       | 57     |
| その他有価証券評価差額金 |          |                       | 10     |                       | 57     |
| 純資産合計        |          |                       | 85,281 |                       | 87,654 |

|          |  |  |         |  |         |
|----------|--|--|---------|--|---------|
| 負債・純資産合計 |  |  | 120,536 |  | 125,080 |
|----------|--|--|---------|--|---------|

## (2) 【損益計算書】

|           |          | 前事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |
|-----------|----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 区分        | 注記<br>番号 | 金額(百万円)                                | 金額(百万円)                                |
| 営業収益      |          |                                        |                                        |
| 委託者報酬     |          | 115,736                                | 106,355                                |
| 運用受託報酬    |          | 17,170                                 | 16,583                                 |
| その他営業収益   |          | 340                                    | 428                                    |
| 営業収益計     |          | 133,247                                | 123,367                                |
| 営業費用      |          |                                        |                                        |
| 支払手数料     |          | 39,435                                 | 34,739                                 |
| 広告宣伝費     |          | 1,006                                  | 1,005                                  |
| 公告費       |          | -                                      | 0                                      |
| 調査費       |          | 26,833                                 | 24,506                                 |
| 調査費       |          | 5,696                                  | 5,532                                  |
| 委託調査費     |          | 21,136                                 | 18,974                                 |
| 委託計算費     |          | 1,342                                  | 1,358                                  |
| 営業雑経費     |          | 5,823                                  | 4,149                                  |
| 通信費       |          | 75                                     | 73                                     |
| 印刷費       |          | 958                                    | 976                                    |
| 協会費       |          | 92                                     | 88                                     |
| 諸経費       |          | 4,696                                  | 3,011                                  |
| 営業費用計     |          | 74,440                                 | 65,760                                 |
| 一般管理費     |          |                                        |                                        |
| 給料        |          | 11,418                                 | 10,985                                 |
| 役員報酬      |          | 109                                    | 147                                    |
| 給料・手当     |          | 7,173                                  | 7,156                                  |
| 賞与        |          | 4,134                                  | 3,682                                  |
| 交際費       |          | 86                                     | 35                                     |
| 旅費交通費     |          | 391                                    | 64                                     |
| 租税公課      |          | 1,029                                  | 1,121                                  |
| 不動産賃借料    |          | 1,227                                  | 1,147                                  |
| 退職給付費用    |          | 1,486                                  | 1,267                                  |
| 固定資産減価償却費 |          | 2,348                                  | 2,700                                  |
| 諸経費       |          | 10,067                                 | 10,739                                 |
| 一般管理費計    |          | 28,055                                 | 28,063                                 |
| 営業利益      |          | 30,751                                 | 29,542                                 |

|    |          | 前事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |
|----|----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 区分 | 注記<br>番号 | 金額(百万円)                                | 金額(百万円)                                |

|              |     |       |        |       |        |
|--------------|-----|-------|--------|-------|--------|
| 営業外収益        |     |       |        |       |        |
| 受取配当金        | ※ 1 | 4,936 |        | 4,540 |        |
| 受取利息         |     | 0     |        | 0     |        |
| 金銭の信託運用益     |     | -     |        | 1,698 |        |
| その他          |     | 309   |        | 447   |        |
| 営業外収益計       |     |       | 5,246  |       | 6,687  |
| 営業外費用        |     |       |        |       |        |
| 金銭の信託運用損     |     | 230   |        | -     |        |
| 投資事業組合等評価損   |     | 146   |        | -     |        |
| 時効後支払損引当金繰入額 |     | 18    |        | 13    |        |
| 為替差損         |     | 23    |        | 26    |        |
| その他          |     | 23    |        | 32    |        |
| 営業外費用計       |     |       | 443    |       | 72     |
| 経常利益         |     |       | 35,555 |       | 36,157 |
| 特別利益         |     |       |        |       |        |
| 投資有価証券等売却益   |     | 21    |        | 71    |        |
| 株式報酬受入益      |     | 59    |        | 48    |        |
| 移転補償金        |     | -     |        | 2,077 |        |
| 特別利益計        |     |       | 81     |       | 2,197  |
| 特別損失         |     |       |        |       |        |
| 投資有価証券等評価損   |     | 119   |        | 36    |        |
| 関係会社株式評価損    |     | 1,591 |        | 582   |        |
| 固定資産除却損      | ※ 2 | 67    |        | 105   |        |
| 事務所移転費用      |     | -     |        | 406   |        |
| 特別損失計        |     |       | 1,778  |       | 1,129  |
| 税引前当期純利益     |     |       | 33,858 |       | 37,225 |
| 法人税、住民税及び事業税 |     |       | 9,896  |       | 11,239 |
| 法人税等調整額      |     |       | △34    |       | △290   |
| 当期純利益        |     |       | 23,996 |       | 26,276 |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

|        | 株主資本   |        |          |         |       |          |         |         |         |
|--------|--------|--------|----------|---------|-------|----------|---------|---------|---------|
|        | 資本金    | 資本剰余金  |          |         | 利益剰余金 |          |         | 株主資本合計  |         |
|        |        | 資本準備金  | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 |         |         | 利益剰余金合計 |
|        |        |        |          |         |       | 別途積立金    | 繰越利益剰余金 |         |         |
| 当期首残高  | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 30,723  | 56,014  | 86,924  |
| 当期変動額  |        |        |          |         |       |          |         |         |         |
| 剰余金の配当 |        |        |          |         |       |          | △25,650 | △25,650 | △25,650 |
| 当期純利益  |        |        |          |         |       |          | 23,996  | 23,996  | 23,996  |

|                                 |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
|---------------------------------|--------|--------|-------|--------|-----|--------|--------|--------|--------|
| 株主資本以外の<br>項目の当期<br>変動額（純<br>額） |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
| 当期変動額合計                         | —      | —      | —     | —      | —   | —      | △1,653 | △1,653 | △1,653 |
| 当期末残高                           | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 29,069 | 54,360 | 85,270 |

(単位：百万円)

|                             | 評価・換算差額等         |                | 純資産合計   |
|-----------------------------|------------------|----------------|---------|
|                             | その他有価証<br>券評価差額金 | 評価・換算<br>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<br>の当期変動額（純<br>額） | △23              | △23            | △23     |
| 当期変動額合計                     | △23              | △23            | △1,676  |
| 当期末残高                       | 10               | 10             | 85,281  |

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

|                     | 株主資本   |        |          |         |       |          |         |         |         |
|---------------------|--------|--------|----------|---------|-------|----------|---------|---------|---------|
|                     | 資本金    | 資本剰余金  |          |         | 利益剰余金 |          |         |         | 株主資本合計  |
|                     |        | 資本準備金  | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 |         | 利益剰余金合計 |         |
|                     |        |        |          |         |       | 別途積立金    | 繰越利益剰余金 |         |         |
| 当期首残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 29,069  | 54,360  | 85,270  |
| 当期変動額               |        |        |          |         |       |          |         |         |         |
| 剰余金の配当              |        |        |          |         |       |          | △23,950 | △23,950 | △23,950 |
| 当期純利益               |        |        |          |         |       |          | 26,276  | 26,276  | 26,276  |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） |        |        |          |         |       |          |         |         |         |
| 当期変動額合計             | —      | —      | —        | —       | —     | —        | 2,326   | 2,326   | 2,326   |
| 当期末残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 31,395  | 56,686  | 87,596  |

(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  |
| 当期変動額                   |              |            |         |
| 剰余金の配当                  |              |            | △23,950 |
| 当期純利益                   |              |            | 26,276  |
| 株主資本以外の項目<br>の当期変動額（純額） | 46           | 46         | 46      |
| 当期変動額合計                 | 46           | 46         | 2,372   |
| 当期末残高                   | 57           | 57         | 87,654  |

## [重要な会計方針]

|                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法  | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券<br/>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<br/>(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。)<br/>時価のないもの … 移動平均法による原価法</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法 | 時価法                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 3. 固定資産の減価償却の方法     | <p>(1) 有形固定資産<br/>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。<br/>主な耐用年数は以下の通りであります。<br/> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div>建物</div> <div>6年</div> </div> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div>附属設備</div> <div>6～15年</div> </div> <div style="display: flex; justify-content: space-between;"> <div>器具備品</div> <div>4～15年</div> </div> </p> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産<br/>定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> |
| 4. 引当金の計上基準         | <p>(1) 貸倒引当金<br/>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金<br/>賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>5. 消費税等の会計処理方法</p> <p>6. 連結納税制度の適用</p> | <p>(3) 退職給付引当金<br/>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。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法<br/>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。</p> <p>② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br/>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。</p> <p>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。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金<br/>時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p> <p>なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p> |
|-------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## [会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

## [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。

## [注記事項]

## ◇ 貸借対照表関係

| 前事業年度末<br>(2020年3月31日)                                                            | 当事業年度末<br>(2021年3月31日)                                                            |
|-----------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|
| ※ 1. 関係会社に対する資産及び負債<br>区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている<br>ものは、次のとおりであります。<br>未払費用 1,296百万円 | ※ 1. 関係会社に対する資産及び負債<br>区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている<br>ものは、次のとおりであります。<br>未払費用 1,256百万円 |
| ※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額<br>建物 761百万円<br>器具備品 2,347<br>合計 3,109                   | ※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額<br>建物 346百万円<br>器具備品 643<br>合計 990                       |

## ◇ 損益計算書関係

| 前事業年度<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日) | 当事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
|----------------------------------------|----------------------------------------|



|                                                                                     |                                                                                     |
|-------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>※ 1. 関係会社に係る注記<br/>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。</p> <p>受取配当金 4,931百万円</p> | <p>※ 1. 関係会社に係る注記<br/>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。</p> <p>受取配当金 4,334百万円</p> |
| <p>※ 2. 固定資産除却損<br/>器具備品 7百万円<br/>ソ フ ト ウ エ 59<br/>ア<br/>合計 67</p>                  | <p>※ 2. 固定資産除却損<br/>器具備品 2百万円<br/>ソ フ ト ウ エ 102<br/>ア<br/>合計 105</p>                |

## ◇ 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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 |

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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

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 |

## （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

2021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   | 26,268百万円  |
| 配当の原資    | 利益剰余金      |
| 1株当たり配当額 | 5,100円     |
| 基準日      | 2021年3月31日 |
| 効力発生日    | 2021年6月30日 |

## ◇ 金融商品関係

前事業年度（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<br>5年以内 | 5年超<br>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 | -           | -            | -    |

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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

2021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        | 4,281    | 4,281  | -  |
| (2)金銭の信託        | 35,912   | 35,912 | -  |
| (3)未収委託者報酬      | 24,499   | 24,499 | -  |
| (4)未収運用受託報酬     | 4,347    | 4,347  | -  |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | 30,400   | 30,400 | -  |
| その他有価証券         | 30,400   | 30,400 | -  |
| 資産計             | 99,441   | 99,441 | -  |
| (6)未払金          | 16,948   | 16,948 | -  |
| 未払収益分配金         | 0        | 0      | -  |

|           |        |        |   |
|-----------|--------|--------|---|
| 未払償還金     | 8      | 8      | - |
| 未払手数料     | 7,256  | 7,256  | - |
| 関係会社未払金   | 8,671  | 8,671  | - |
| その他未払金    | 1,011  | 1,011  | - |
| (7)未払費用   | 9,171  | 9,171  | - |
| (8)未払法人税等 | 2,113  | 2,113  | - |
| 負債計       | 28,233 | 28,233 | - |

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1,767百万円、関係会社株式9,942百万円）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618百万円（投資有価証券35百万円、関係会社株式582百万円）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<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|--------------|--------|-------------|--------------|------|
| 預金           | 4,281  | -           | -            | -    |
| 金銭の信託        | 35,912 | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬      | 24,499 | -           | -            | -    |
| 未収運用受託報酬     | 4,347  | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券 |        |             |              |      |
| その他有価証券      | 30,400 | -           | -            | -    |
| 合計           | 99,441 | -           | -            | -    |

## ◇ 有価証券関係

前事業年度（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<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2021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(2021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(2021年3月31日)

該当事項はありません。

4. その他有価証券(2021年3月31日)

| 区分                   | 貸借対照表<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(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                | 30,400                | 30,400        | -           |
| 小計                   | 30,400                | 30,400        | -           |
| 合計                   | 30,400                | 30,400        | -           |

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2020年4月1日 至 2021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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)                                                                                       |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>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。</p> <p>2. 確定給付制度</p> |



## (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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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  | 23,761 百万円 |
| 勤務費用         | 1,016      |
| 利息費用         | 139        |
| 数理計算上の差異の発生額 | △893       |
| 退職給付の支払額     | △781       |
| その他          | 28         |
| 退職給付債務の期末残高  | 23,270     |

## (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    | 17,413 百万円 |
| 期待運用収益       | 409        |
| 数理計算上の差異の発生額 | 1,328      |
| 事業主からの拠出額    | 824        |
| 退職給付の支払額     | △626       |
| 年金資産の期末残高    | 19,349     |

## (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         | 19,959 百万円 |
| 年金資産                 | △19,349    |
|                      | 610        |
| 非積立型制度の退職給付債務        | 3,311      |
| 未積立退職給付債務            | 3,921      |
| 未認識数理計算上の差異          | △2,074     |
| 未認識過去勤務費用            | 151        |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 1,998      |

|                      |        |
|----------------------|--------|
| 退職給付引当金              | 3,299  |
| 前払年金費用               | △1,301 |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 1,998  |

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| 勤務費用            | 1,016 百万円 |
| 利息費用            | 139       |
| 期待運用収益          | △409      |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 469       |
| 過去勤務費用の費用処理額    | △34       |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 1,182     |

## (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     | 52%  |
| 株式     | 30%  |
| 生保一般勘定 | 11%  |
| 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 | 0.8% |
| 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、206百万円でした。

## ◇ 税効果会計関係

| 前事業年度末<br>(2020年3月31日)                         |        | 当事業年度末<br>(2021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                                          | 1,235  | 賞与引当金                                          | 1,176  |
| 退職給付引当金                                        | 1,026  | 退職給付引当金                                        | 1,022  |
| 関係会社株式評価減                                      | 762    | 関係会社株式評価減                                      | 784    |
| 未払事業税                                          | 285    | 未払事業税                                          | 430    |
| 投資有価証券評価減                                      | 462    | 投資有価証券評価減                                      | 428    |
| 減価償却超過額                                        | 171    | 減価償却超過額                                        | 223    |
| 時効後支払損引当金                                      | 177    | 時効後支払損引当金                                      | 179    |
| 関係会社株式売却損                                      | 148    | 関係会社株式売却損                                      | 148    |
| ゴルフ会員権評価減                                      | 167    | ゴルフ会員権評価減                                      | 135    |
| 未払社会保険料                                        | 97     | 未払社会保険料                                        | 95     |
| その他                                            | 219    | その他                                            | 341    |
| 繰延税金資産小計                                       | 4,754  | 繰延税金資産小計                                       | 4,968  |
| 評価性引当額                                         | △1,532 | 評価性引当額                                         | △1,530 |
| 繰延税金資産合計                                       | 3,222  | 繰延税金資産合計                                       | 3,437  |
| 繰延税金負債                                         |        | 繰延税金負債                                         |        |
| その他有価証券評価差額金                                   | 4      | その他有価証券評価差額金                                   | 25     |
| 前払年金費用                                         | 478    | 前払年金費用                                         | 403    |
| 繰延税金負債合計                                       | 483    | 繰延税金負債合計                                       | 429    |
| 繰延税金資産の純額                                      | 2,738  | 繰延税金資産の純額                                      | 3,008  |
| 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 |        | 2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 |        |
| 法定実効税率                                         | 31.0%  | 法定実効税率                                         | 31.0%  |
| (調整)                                           |        | (調整)                                           |        |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目                             | 0.0%   | 交際費等永久に損金に算入されない項目                             | 0.0%   |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                           | △4.4%  | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                           | △3.5%  |
| タックスヘイブン税制                                     | 2.6%   | タックスヘイブン税制                                     | 1.9%   |
| 外国税額控除                                         | △0.7%  | 外国税額控除                                         | △0.5%  |
| 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税                           | 0.2%   | 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税                           | 0.2%   |
| その他                                            | 0.4%   | その他                                            | 0.3%   |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率                              | 29.1%  | 税効果会計適用後の法人税等の負担率                              | 29.4%  |

## ◇ 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

## 1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

## 2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を当該不動産賃貸借契約期間とし、割引率は0.0%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

## 3. 当該資産除去債務の総額の増減

|                |                            | (単位：百万円) |                            |
|----------------|----------------------------|----------|----------------------------|
| 前事業年度          |                            | 当事業年度    |                            |
| 自              | 2019年4月 1日<br>至 2020年3月31日 | 自        | 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31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     | -                          |          | -                          |
| 期末残高           | -                          |          | 1,371                      |

## ◇ セグメント情報等

前事業年度(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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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 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

(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<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                                   | 取引の内容                 | 取引金額<br>(百万円) | 科目       | 期末残高<br>(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<br>(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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                                       | 取引の内容                  | 取引金額<br>(百万円) | 科目       | 期末残高<br>(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<br>(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<br>役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払 (*1) | 26,722        | 未払手数料    | 5,690         |
|         |          |        |                 |       |                    |                                                 | コマーシャル・ペーパーの償還 (*2)    | 20,000        | 有価証券     | -             |
|         |          |        |                 |       |                    |                                                 | 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<br>(自 2019年4月1日<br>至 2020年3月31日)        |            | 当事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日)        |            |
|-----------------------------------------------|------------|-----------------------------------------------|------------|
| 1株当たり純資産額                                     | 16,557円31銭 | 1株当たり純資産額                                     | 17,018円01銭 |
| 1株当たり当期純利益                                    | 4,658円88銭  | 1株当たり当期純利益                                    | 5,101円61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                                  | 23,996百万円  | 損益計算書上の当期純利益                                  | 26,276百万円  |
| 普通株式に係る当期純利益                                  | 23,996百万円  | 普通株式に係る当期純利益                                  | 26,276百万円  |
| 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳                            |            | 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳                            |            |
| 該当事項はありません。                                   |            | 該当事項はありません。                                   |            |
| 普通株式の期中平均株式数                                  | 5,150,693株 | 普通株式の期中平均株式数                                  | 5,150,693株 |

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)又は子

法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

④委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

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

## 5【その他】

### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2)訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

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

\* 2021年5月末現在

#### (2) 販売会社

| (a)名称                    | (b)資本金の額 <sup>*</sup>  | (c)事業の内容                        |
|--------------------------|------------------------|---------------------------------|
| 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。 |
| 株式会社中国銀行<br>株式会社西日本シティ銀行 | 15,149百万円<br>85,745百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。              |

\* 2021年5月末現在

### 2【関係業務の概要】

#### (1) 受託者

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

#### (2) 販売会社

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・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

### 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

#### (1) 受託者

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

該当事項はありません。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

| 提出年月日       | 提出書類          |
|-------------|---------------|
| 2020年 7月30日 | 有価証券届出書       |
| 2020年 7月30日 | 有価証券報告書       |
| 2021年 1月28日 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 2021年 1月28日 | 半期報告書         |

## 独立監査人の監査報告書

2021年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

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

|                    |       |         |
|--------------------|-------|---------|
| 指定有限責任社員<br>業務執行社員 | 公認会計士 | 水 永 真太郎 |
|--------------------|-------|---------|

### 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2021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。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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6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

伊藤 志保

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスセレクト70（確定拠出年金向け）の2020年5月12日から2021年5月10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、バランスセレクト70（確定拠出年金向け）の2021年5月10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。