【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】	2022年3月18日提出
【計算期間】	第6期(自 2020年12月29日至 2021年12月27日)
【ファンド名】	野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型 野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型 野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型 野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	ＣＥＯ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】

◆国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国（新興国を含む）の各債券を投資対象とする別に定める親投資信託証券※（マザーファンド）を主要投資対象とし、信託財産の成長を目的に運用を行なうことを基本とします。

※投資対象とする別に定める親投資信託証券とは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」とします。なお、別に定める親投資信託証券については後述の《マザーファンドの概要》をご覧ください。

■信託金の限度額■

信託金限度額は、各ファンドにつき5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

＜商品分類＞

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

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

（野村ターゲットデートファンド2016　2026-2028年目標型）
（野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型）
（野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型）
（野村ターゲットデートファンド2016　2035-2037年目標型）

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （株式、債券） 資産配分 変更型）） 資産複合 （　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル （日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東 （中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ ファンズ	あり （部分ヘッジ） なし	日経225 ＴＯＰＩＸ その他 （合成指数）

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

＜商品分類表定義＞

［単位型投信・追加型投信の区分］

(1)単位型投信…当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。

(2)追加型投信…一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

［投資対象地域による区分］

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

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

(3)内外…目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［投資対象資産による区分］

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

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

(3)不動産投信(リート)…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資

信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

(4)その他資産…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

［独立した区分］

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

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF…投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

［補足分類］

(1)インデックス型…目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

＜属性区分表定義＞

［投資対象資産による属性区分］

株式

(1)一般…次の大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのものをいう。

(2)大型株…目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(3)中小型株…目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

債券

(1)一般…次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのものをいう。

(2)公債…目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

(3)社債…目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

(4)その他債券…目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

(5)格付等クレジットによる属性…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

(1)資産配分固定型…目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

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

［決算頻度による属性区分］

(1)年１回…目論見書又は投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいう。

(2)年２回…目論見書又は投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいう。

(3)年４回…目論見書又は投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいう。

(4)年６回(隔月)…目論見書又は投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいう。

(5)年12回(毎月)…目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

(6)日々…目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

(7)その他…上記属性にあてはまらないすべてのものをいう。

［投資対象地域による属性区分(重複使用可能)］

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

(2)日本…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

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

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

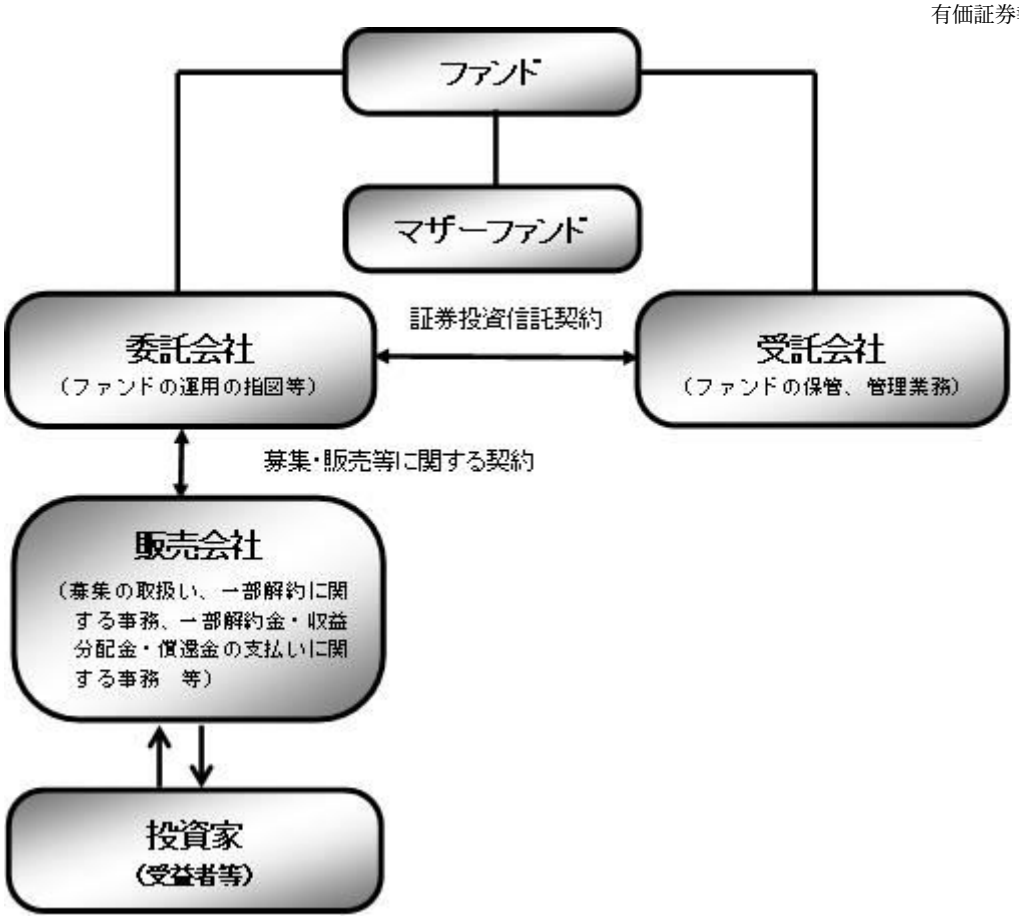
［インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分］
(1)日経225
(2)TOPIX
(3)その他の指数…上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

［特殊型］
(1)ブル・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】

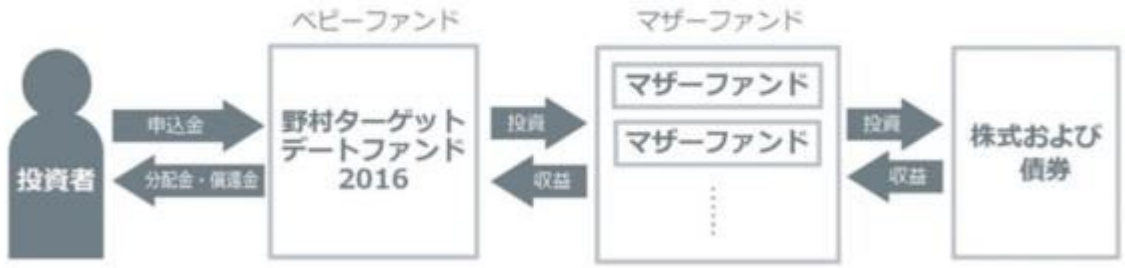
2016年4月1日　　信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



ファンド	野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド			
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド			
	新興国株式マザーファンド			
	国内債券NOMURA-BPI総合　マザーファンド			
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド			
	外国債券マザーファンド			
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド			
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(2022年1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】

●「野村ターゲットデートファンド2016」は、ターゲット時期の異なる4本のファンド（「2026-2028年目標型」、「2029-2031年目標型」、「2032-2034年目標型」、「2035-2037年目標型」）で構成されています。

◆「2026-2028年目標型」は2026年から2028年、「2029-2031年目標型」は2029年から2031年、「2032-2034年目標型」は2032年から2034年、「2035-2037年目標型」は2035年から2037年をターゲット時期とします。

●各ファンドは、「投資基礎期」、「資産形成期」、ターゲット時期を含む「目標前準備期」を定め、各期間毎に株式および債券の配分比率（「株式・債券配分」といいます。）を変化させます。また、各期間において、株式・債券配分を変化させる※ことに合わせて、各マザーファンドへの基本投資割合を定期的※に変更します。

※株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合の変更は、当面、原則毎月行なうことを基本としま

す。

当面の株式・債券配分は「株式・債券配分のイメージ図」をご覧ください。

●各期間における株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上で行ないます。

●各ファンドの「投資基礎期」、「資産形成期」、「目標前準備期」の期間はそれぞれ以下のとおりとします。

ファンド名	投資基礎期	資産形成期	目標前準備期
2026-2028年目標型	当初設定日から 2017年12月	2018年1月から 2022年12月	2023年1月以降
2029-2031年目標型	当初設定日から 2018年12月	2019年1月から 2025年12月	2026年1月以降
2032-2034年目標型	当初設定日から 2019年12月	2020年1月から 2028年12月	2029年1月以降
2035-2037年目標型	当初設定日から 2020年12月	2021年1月から 2031年12月	2032年1月以降

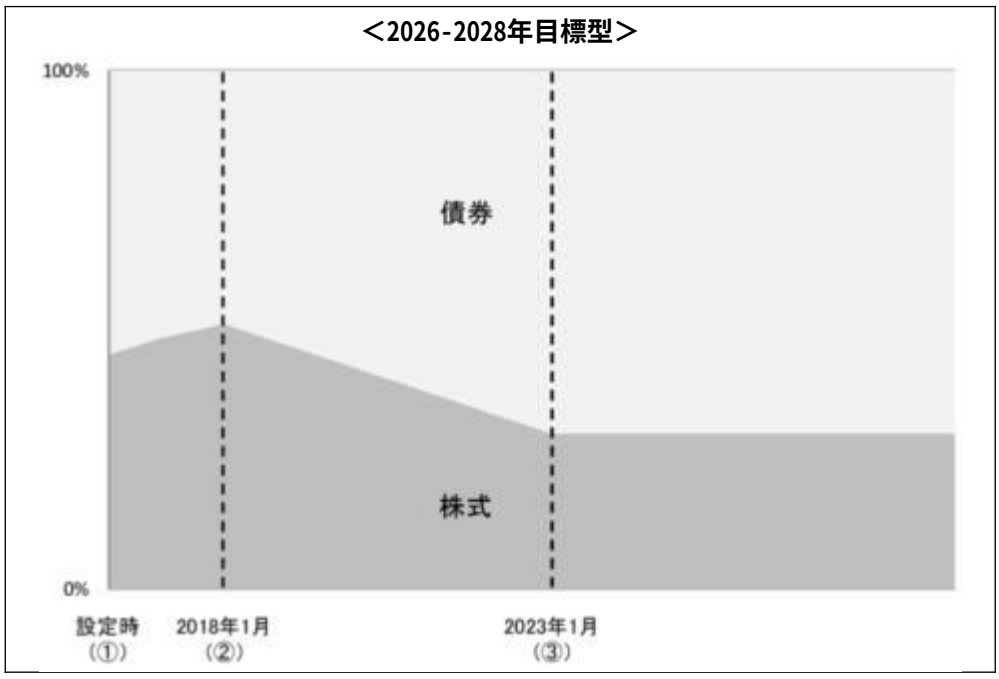
●「投資基礎期」は、株式への実質投資割合を徐々に増やし、債券への実質投資割合を徐々に減らすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

●「資産形成期」は、株式への実質投資割合を徐々に減らし、債券への実質投資割合を徐々に増やすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

●「目標前準備期」は、株式・債券配分を一定とすることを基本とします。

・期間中は、安定運用を行なう場合があります。

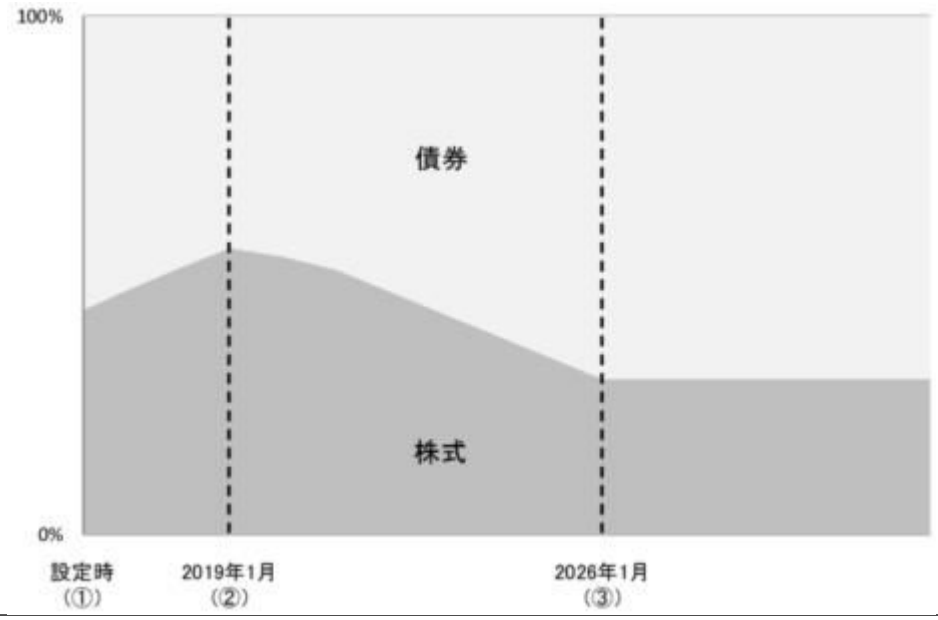
■株式・債券配分のイメージ図■



①投資基礎期開始日	②資産形成期開始日	③目標前準備期開始日
株式45.2%	株式51.1%	株式30.0%

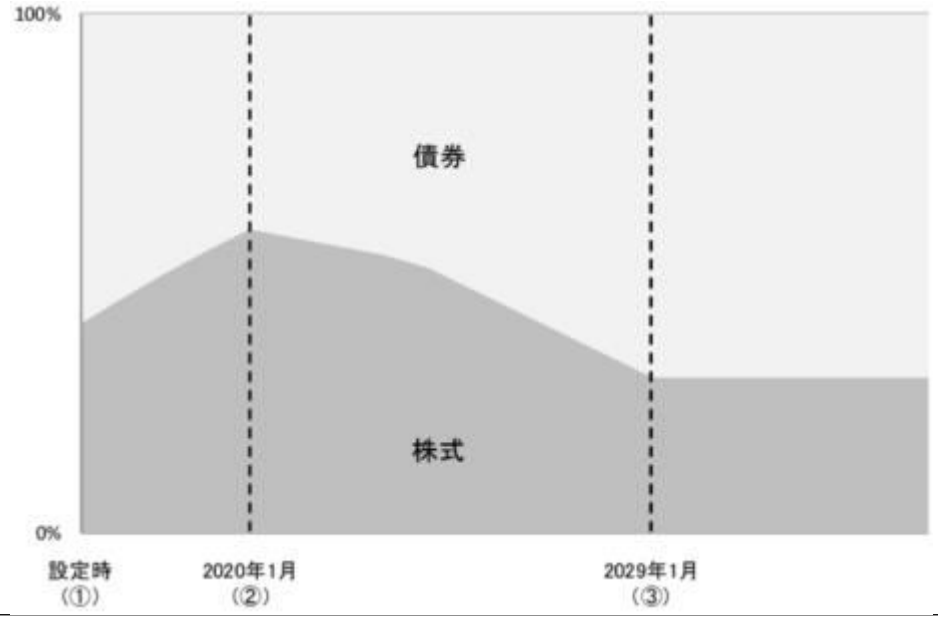
債券54.8%	債券48.9%	債券70.0%

＜2029-2031年目標型＞

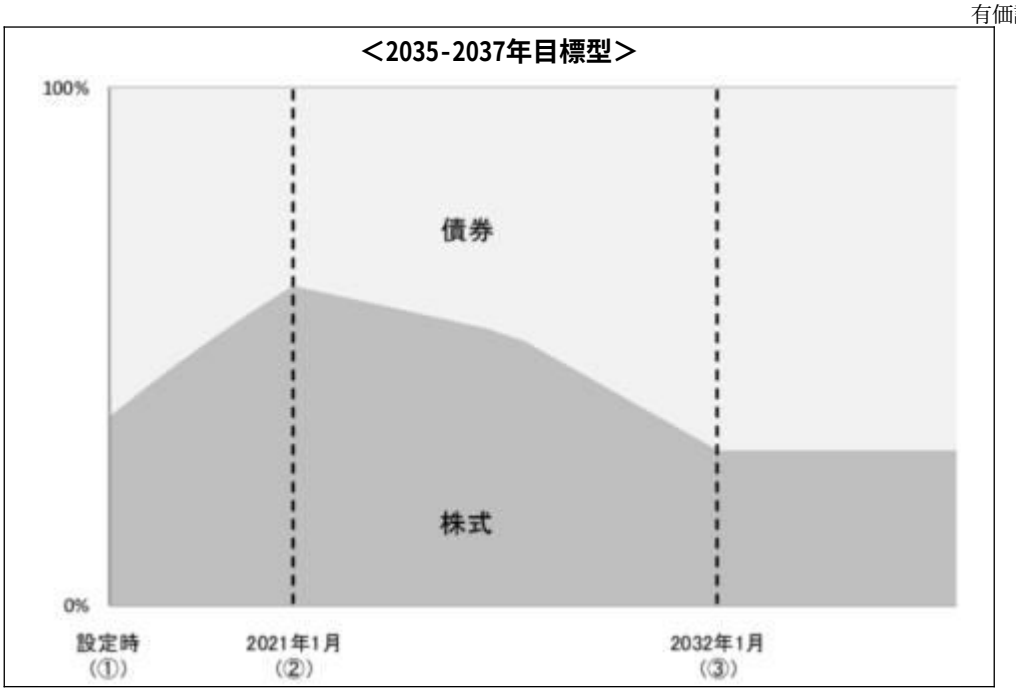


①投資基礎期開始日	②資産形成期開始日	③目標前準備期開始日
株式43.2%	株式55.2%	株式30.0%
債券56.8%	債券44.8%	債券70.0%

＜2032-2034年目標型＞



①投資基礎期開始日	②資産形成期開始日	③目標前準備期開始日
株式40.5%	株式58.5%	株式30.0%
債券59.5%	債券41.5%	債券70.0%



①投資基礎期開始日	②資産形成期開始日	③目標前準備期開始日
株式36.5%	株式61.8%	株式30.0%
債券63.5%	債券38.2%	債券70.0%

■各マザーファンドへの基本投資割合■

		2026-2028年目標型		2029-2031年目標型		2032-2034年目標型		2035-2037年目標型		各ファンド共通
		2022年3月	資産形成期開始日	2022年3月	資産形成期開始日	2022年3月	資産形成期開始日	2022年3月	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式	国内株式マザーファンド	16.8%	25.5%	23.1%	27.6%	27.5%	29.2%	29.9%	30.9%	15.0%
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	9.6%	15.4%	13.3%	16.6%	15.8%	17.6%	17.2%	18.6%	9.0%
	新興国株式マザーファンド	7.1%	10.2%	9.8%	11.0%	11.7%	11.7%	12.7%	12.3%	6.0%
債券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	27.4%	17.0%	19.4%	14.9%	15.0%	13.2%	12.6%	11.6%	30.0%
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	27.4%	17.0%	19.4%	14.9%	15.0%	13.2%	12.6%	11.6%	30.0%
	外国債券マザーファンド	7.5%	12.2%	9.7%	12.3%	9.7%	12.3%	9.7%	12.3%	8.2%
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	4.2%	2.7%	5.3%	2.7%	5.3%	2.8%	5.3%	2.7%	1.8%

※上記の株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合は、2022年3月現在のものであり、家計や市場の構造変化等により変更する場合があります。

●「目標前準備期」の各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する株式および債券の実質的なエクスポージャーを引き下げ※、短期有価証券等へ投資する安定運用を行ないます。なお、安定運用を行なうにあたっては、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の売建てを行なう場合があります。

※株式および債券の実質的なエクスポージャーをゼロに近づけることを基本とします。

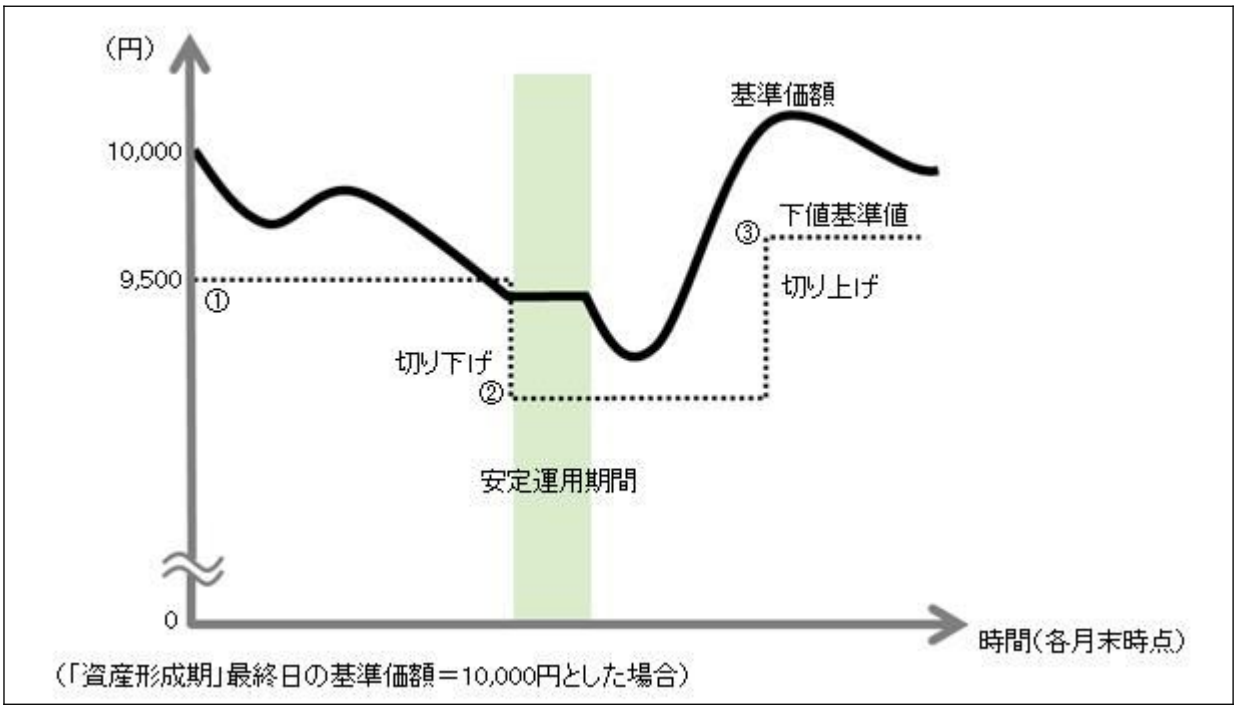
＊各ファンドにおいては、上記のような運用を「下値保全に配慮した運用」という場合があります。

・委託会社の定める下値基準値は、当初、各ファンドの「資産形成期」最終日の基準価額の95%程度とします。毎月末の基準価額を勘案して下値基準値を見直すことを基本とし、原則として、月末の基準価額が下値基準値を下回った場合には切り下げを行ない、月末の基準価額が直近の下値基準値改定時（一度も改定されていない場合は各ファンドの「資産形成期」最終日）の基準価額を一定水準上回った場合には切り上げを行ないます。

・安定運用に切り替えた場合の、安定運用を行なう一定期間は、3ヵ月程度を基本とします。なお、当該期間は、市況動向等により見直される場合があります。

・安定運用期間終了後は、「目標前準備期」における株式・債券配分となるよう、株式および債券の実質的なエクスポージャーを引き上げます。

■基準価額と下値保全に配慮した運用（イメージ図）■



＜ご参考例＞

①「資産形成期」最終日の基準価額が10,000円の場合、当初の下値基準値は当該基準価額の95%程度の9,500円程度となります。

②「目標前準備期」の月末における基準価額が①で定めた下値基準値（9,500円程度）を下回った場合、安定運用を行ない、下値基準値（9,500円程度）を見直します。
例えば、月末の基準価額が9,400円の場合、当該基準価額の95%程度の8,930円程度が新たな下値基準値となります。

③安定運用期間終了後の月末における基準価額が②で下値基準値の見直しを行なった時点の基準価額（9,400円）を一定水準上回った場合、下値基準値（8,930円程度）を見直します。
例えば、月末の基準価額が10,200円の場合、当該基準価額の95%程度の9,690円程度が新たな下値基準値となります。

●別に定めるマザーファンドの中から、市場構造等を勘案し、各期間の株式・債券配分の範囲内で各マザーファンドへの投資比率を決定します。投資を行なうマザーファンドは、原則として、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すものとします。

◆一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。また、基本投資割合の変更に際し、新たにマザーファンドを投資対象に追加する場合があります。

◆各マザーファンドは、各々以下の対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

《マザーファンドの概要》

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）*2
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証書）*1を含みます）	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）*3
国内債券NOMURA-BPI総合　マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債	JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）*4

*1　Depositary Receipt（預託証書）の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。
*2　MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。
*3　MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。
*4　JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified（USドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

●各ファンドは、投資対象とする各マザーファンドが連動を目指す対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数をベンチマークとします。

●実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行なうマザーファンドを通じて投資する部分を除き、原則として為替ヘッジを行ないません。
ただし、「目標前準備期」で安定運用を行なう場合においては為替ヘッジを行なう場合があります。

■各マザーファンドの投資方針等について■

[国内株式マザーファンド]

・主として東京証券取引所第一部上場株式*に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。
＊2022年4月4日の東京証券取引所の市場区分の見直しに伴い、同日に「東京証券取引所第一部上場株式」を「わが国の株式」とする約款変更を予定しております。
※東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした指数です。新規上場銘柄や有償増資などに対しては、修正を加えることで指数の連続性を維持しています。

※東証株価指数（TOPIX）は、2022年4月4日に予定されている東京証券取引所の市場区分の見直しに伴い、構成銘柄の選定を含む指数算出要領の見直しが行われます。詳しくは、日本取引所グループのホームページ等をご覧ください。

[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]

・主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
※MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。MSCI-KOKUSAI指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された浮動株数ベース

の時価総額株価指数です。

[新興国株式マザーファンド]

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

・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

※MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。
MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[国内債券NOMURA-BPI総合　マザーファンド]

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

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

[外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

・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す。

※「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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。

[外国債券マザーファンド]

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

・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

※「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

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

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

・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

※JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets(GBI-EM)Global Diversified（USドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets(GBI-EM)Global Diversified）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数です（ただし、国別の組入比率には上限が設定されています）。

■各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について■

■東証株価指数（TOPIX）■

①TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有します。

②㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

③㈱東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

④㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また㈱東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

⑤本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

⑥本ファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

⑦㈱東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

⑧㈱東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑨以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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

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

本ファンドは、MSCI Inc.、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、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。

■NOMURA-BPI総合■

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

■「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・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)」■

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

■JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド■

本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含みますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイサー又は貸主となっている可能性があります。
ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。
本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。
JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。
当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。
当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（2）【投資対象】

別に定めるマザーファンドを主要投資対象とし、実質的に国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国（新興国を含む）の各債券を投資対象とします。なお、株式、公社債および短期有価証券等に直接投資する場合があります。また、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等を取引対象とします。

◆別に定めるマザーファンドと、主要投資対象は以下の通りです。

マザーファンド名	主要投資対象
国内株式マザーファンド	わが国の株式
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証書）を含みます）
国内債券NOMURA-BPI総合　マザーファンド	わが国の公社債
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債
外国債券マザーファンド	外国の公社債
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債

①投資の対象とする資産の種類（信託約款）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
   - イ．有価証券
   - ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（5）投資制限④、⑤、⑧及び⑩」に定めるものに限ります。）に係る権利
   - ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
   - ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
   - イ．為替手形
   - ロ．次に掲げるものをすべてみたす資産
     - ・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するもの
     - ・流動性に考慮し、時価の取得が可能なもの
     - ・前号または本号イに掲げるものに該当しないもの

②有価証券の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された別に定める親投資信託証券（以下「各マザーファンド」といいます。）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書

2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）
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. 新株引受権証券および新株予約権証券
12. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
13. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第11号の証券または証書の性質を有するもの
14. 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。）
15. 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。）
16. 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。）
17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
18. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
19. 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。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第18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
22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証書ならびに第12号、第13号、第18号および第19号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券ならびに第12号、第13号、第18号および第19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以下「公社債」といい、第14号および第15号の証券ならびに第18号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

③金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

とを指図することができます。

1. **預金**
2. **指定金銭信託（上記②に掲げるものを除く。）**
3. **コール・ローン**
4. **手形割引市場において売買される手形**
5. **貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの**
6. **外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの**
7. **日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記②に定める証券または証書を除きます。）**
8. **流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記②第12号に定める証券または証書を除きます。なお、上記②第12号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）**
9. **リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記②各号以外のもの**
10. **流動性のある外国の者に対する貸付債権**

④その他の投資対象

1. **先物取引等**
2. **スワップ取引**
3. **金利先渡取引※**

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

4. **為替先渡取引※**

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

5. **直物為替先渡取引※**

   ※「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額につい

て決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

(参考)各マザーファンドの概要

「国内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。

「新興国株式マザーファンド」

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

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デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

⑤外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

⑥同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑦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。

⑧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。

⑨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。

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NOMURA-BPI総合　マザーファンド」

運　用　の　基　本　方　針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

(3)投資制限

①株式への投資は行ないません。

②外貨建資産への投資は行ないません。

③有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

④スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」

運　用　の　基　本　方　針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2.運用方法

(1)投資対象

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、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

②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す。

③効率的な運用を行なうため、債券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

④資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

①株式への投資は行ないません。

②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

④外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

「外国債券マザーファンド」

運　用　の　基　本　方　針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

②外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

①外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

②有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

③スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

④一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」

運　用　の　基　本　方　針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

①現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

②外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

③資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

①外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

②デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

③外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

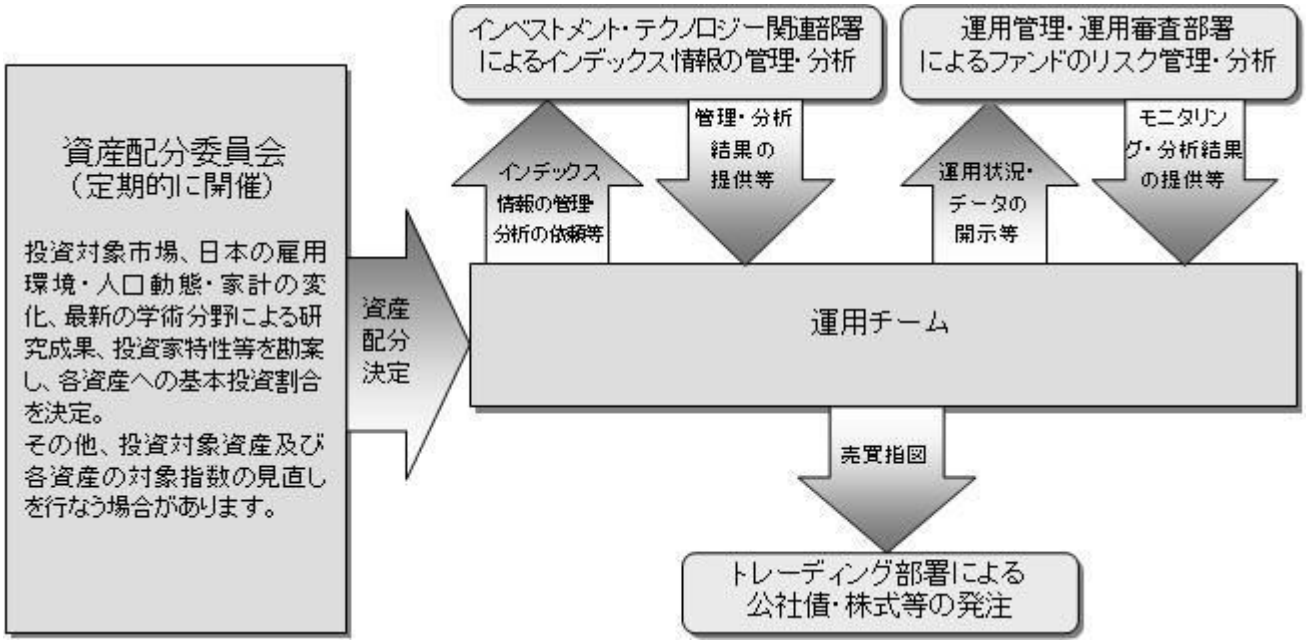
④一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資

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】

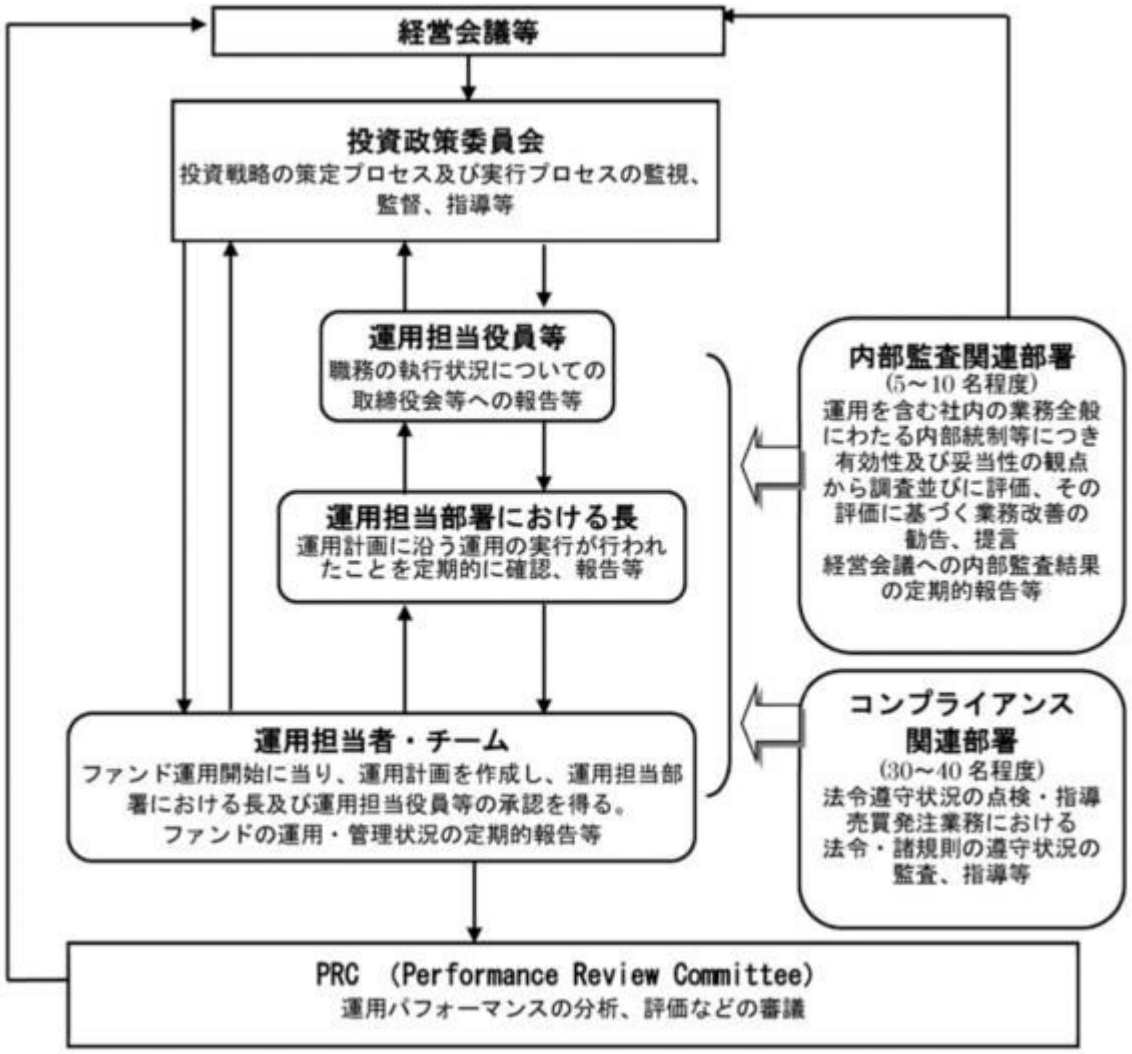
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※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】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

②収益分配金額は、上記①の範囲内で、基準価額水準等を勘案し、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。

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

◆ファンドの決算日

原則として**毎年12月26日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

（５）【投資制限】

①運用の基本方針 2. 運用方法 （3）投資制限（信託約款）

・株式への実質投資割合には制限を設けません。
・外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
・デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
・外国為替予約取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。
・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
・一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

②投資する株式等の範囲(信託約款)

(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、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)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

③信用取引の指図範囲(信託約款)

(ⅰ)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。

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券

4. 売り出しにより取得する株券

5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債※の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

※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。

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

④先物取引等の運用指図(信託約款)

(ⅰ)委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引および株式にかかる有価証券店頭オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第4号ハおよびニに掲げるものをいいます。以下同じ。）を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

(ⅱ)委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

(ⅲ)委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

(ⅳ)上記(ⅰ)の店頭オプション取引の評価は、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。

(ⅴ)委託者は、上記(ⅰ)の店頭オプション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。

⑤スワップ取引の運用指図(信託約款)

(ⅰ)委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引および有価証券店頭指数等スワップ取引（金融商品取引法第28条第8項第4号ホに掲げるものをいいます。以下同じ。）（これらを総称して以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

(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、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ⅲ)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。

(ⅳ)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有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

(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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

(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。

⑦公社債の借入れ(信託約款)

(ⅰ)委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

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

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

(ⅳ)上記(ⅰ)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

⑧金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

(ⅰ)委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

(ⅱ)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ⅲ)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

(ⅳ)委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑨特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

⑩直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

(ⅰ)委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

(ⅱ)直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

(ⅲ)直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

(ⅳ)委託者は、直物為替先渡取引を行なうにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑪資金の借入れ(信託約款)

(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。

⑫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。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の株価変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、為替ヘッジを行なうマザーファンドを通じて投資する部分を除き、原則として為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの

実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

≪その他の留意点≫

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

◆ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止等となる可能性、換金代金の支払いが遅延する可能性等があります。

◆資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。

◆ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。

◆有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。

◆ファンドの基準価額とファンドのベンチマークである合成指数は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が合成指数に連動または上回ることを保証するものではありません。なお、安定運用期間中は、ファンドの基準価額は合成指数には連動しません。

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

◆目標前準備期開始日以降の運用においては、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、安定運用への切り替えを行なうことで、基準価額の大幅な下落を回避することを目指しますが、必ずしもある一定水準の基準価額が保全されることを示唆するものではありません。

◆ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

≪委託会社におけるリスクマネジメント体制≫

リスク管理関連の委員会

◆パフォーマンスの考査

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

審議を行ないます。

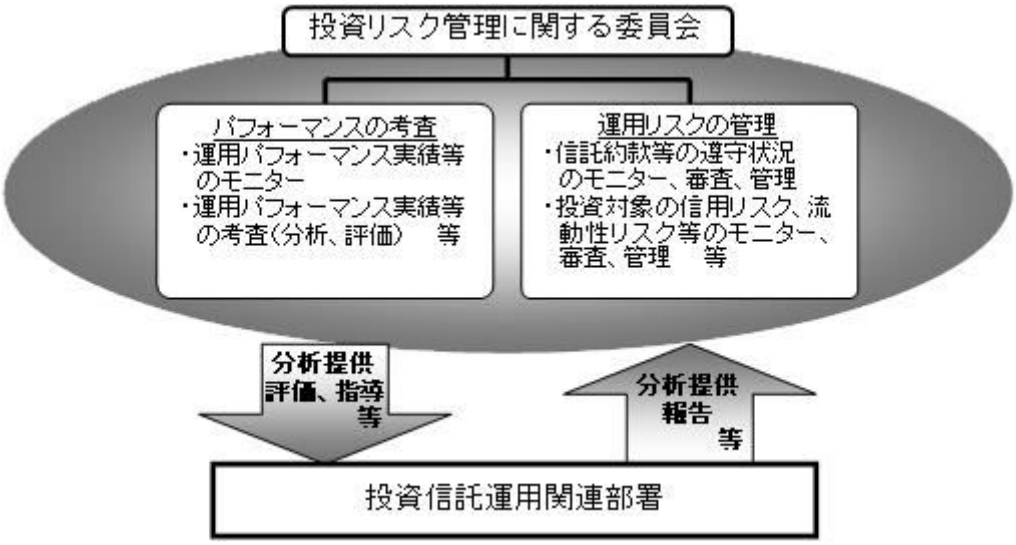
◆運用リスクの管理

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

※流動性リスク管理について

流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。リスク管理関連の委員会が、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について監督します。

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。

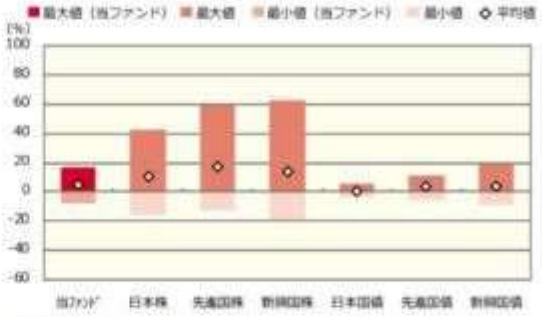
投資リスク

リスクの定量的比較（2017年2月末～2022年1月末：月次）

2026-2028年目標型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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（%）	**17.1**	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値（%）	△ **8.3**	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 5.4	△ 9.4
平均値（%）	**5.2**	10.6	17.1	13.7	0.1	3.5	4.0

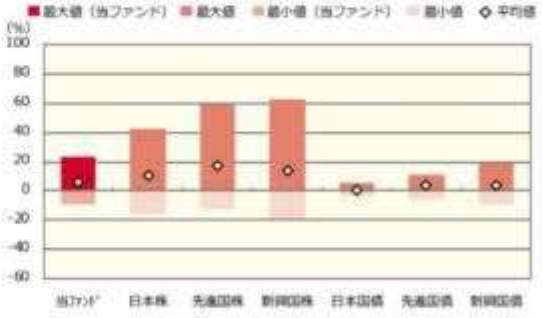
＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2017年2月末を10,000として指数化しております。
＊年間騰落率は、2017年4月から2022年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2017年2月から2022年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2022年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
＊当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

2029-2031年目標型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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（%）	**23.5**	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値（%）	△ **9.4**	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 5.4	△ 9.4
平均値（%）	**6.0**	10.6	17.1	13.7	0.1	3.5	4.0

＊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。2017年2月末を10,000として指数化しております。
＊年間騰落率は、2017年4月から2022年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

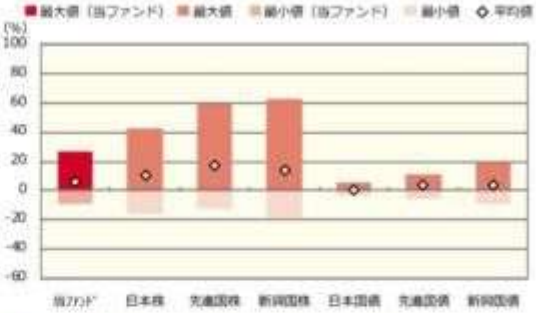
＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2017年2月から2022年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2022年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
＊当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

投資リスク

2032-2034年目標型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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（%）	**26.5**	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値（%）	△ **9.3**	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 5.4	△ 9.4
平均値（%）	**6.3**	10.6	17.1	13.7	0.1	3.5	4.0

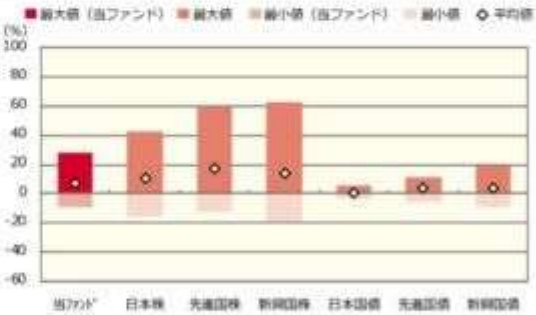
＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2017年2月末を10,000として指数化しております。
＊年間騰落率は、2017年4月から2022年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2017年2月から2022年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2022年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
＊当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

2035-2037年目標型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

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（%）	**28.1**	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値（%）	△ **9.1**	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 5.4	△ 9.4
平均値（%）	**6.6**	10.6	17.1	13.7	0.1	3.5	4.0

＊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。2017年2月末を10,000として指数化しております。
＊年間騰落率は、2017年4月から2022年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

＊全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
＊2017年2月から2022年1月の5年間（当ファンドは2017年4月から2022年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
＊当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

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

投資リスク

<代表的な資産クラスの指数>
○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
○先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）
○新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
○日本国債：NOMURA-BPI 国債
○先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
○新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・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、㈱東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、㈱東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
○MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的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。
○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総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
○JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・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・マーケッツ・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を法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメークを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
JPMSLLC は NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

①取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜2.0%）以内※で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

②収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に下記の信託報酬率を乗じて得た額とします。ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

信託報酬率の配分については次の通り(税抜)とします。

計算期間	信託報酬率	＜委託会社＞	＜販売会社＞	＜受託会社＞
Ⅰ	年1.045% (税抜年0.95%)	年0.45%	年0.45%	年0.05%
Ⅱ	年0.979% (税抜年0.89%)	年0.42%	年0.42%	年0.05%

ファンド名	Ⅰ	Ⅱ
2026-2028年目標型	（1～7期） 設定日～2022年決算日	（8期以降） 2022年決算日翌日以降
2029-2031年目標型	（1～10期） 設定日～2025年決算日	（11期以降） 2025年決算日翌日以降
2032-2034年目標型	（1～13期） 設定日～2028年決算日	（14期以降） 2028年決算日翌日以降
2035-2037年目標型	（1～16期） 設定日～2031年決算日	（17期以降） 2031年決算日翌日以降

≪支払先の役務の内容≫

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

（４）【その他の手数料等】

①ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息はファンドから支払われます。

②ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。

③ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。

④監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときにファンドから支払われます。

⑤ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額※をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口当たりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

＜収益分配金に対する課税＞

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

なお、配当控除は適用されません。

＜換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税＞

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

≪損益通算について≫

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

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

（注1）「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行され

た公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

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

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

◆法人の投資家に対する課税

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■換金（解約）時および償還時の課税について■

［個人の投資家の場合］

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

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

［法人の投資家の場合］

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

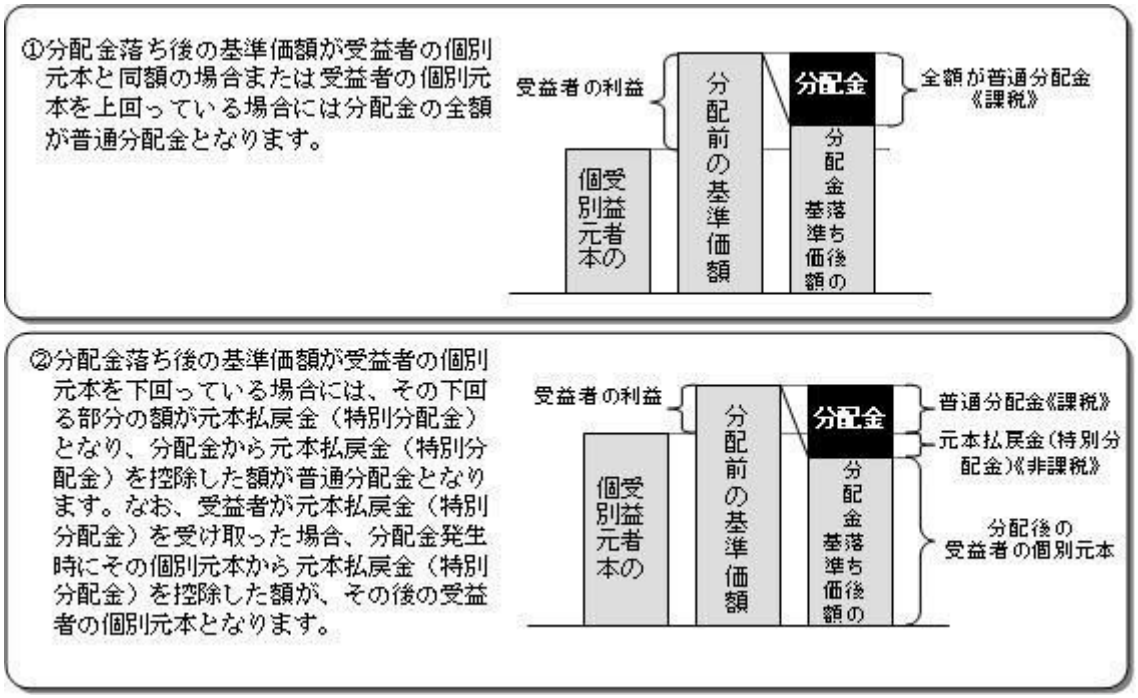
■個別元本について■

◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

■分配金の課税について■

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



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

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

＊税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2022年1月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2022年1月31日現在の運用状況であります。
また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（1）【投資状況】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	147,695,286	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	135,788	0.09
合計（純資産総額）		147,831,074	100.00

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	58,168,563	99.89

現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	59,069	0.10
合計（純資産総額）		58,227,632	100.00

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	38,588,966	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	35,060	0.09
合計（純資産総額）		38,624,026	100.00

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	29,634,799	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	30,146	0.10
合計（純資産総額）		29,664,945	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	400,793,924,440	97.56
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	10,015,136,030	2.43
合計（純資産総額）		410,809,060,470	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	10,005,095,000	2.43

（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	820,197,715,107	70.50
	カナダ	41,607,112,671	3.57
	ドイツ	30,653,715,831	2.63
	イタリア	8,520,528,441	0.73
	フランス	39,196,074,012	3.36

	オランダ	15,993,815,240	1.37
	スペイン	8,025,610,666	0.68
	ベルギー	2,820,278,663	0.24
	オーストリア	841,887,482	0.07
	ルクセンブルグ	416,643,280	0.03
	フィンランド	3,454,401,089	0.29
	アイルランド	2,328,983,635	0.20
	ポルトガル	681,522,699	0.05
	イギリス	53,190,919,528	4.57
	スイス	34,967,245,832	3.00
	スウェーデン	12,688,961,378	1.09
	ノルウェー	2,392,712,922	0.20
	デンマーク	8,507,012,832	0.73
	オーストラリア	21,482,312,261	1.84
	ニュージーランド	645,025,484	0.05
	香港	9,245,502,733	0.79
	シンガポール	3,472,654,568	0.29
	イスラエル	1,494,612,400	0.12
	小計	1,122,825,248,754	96.51
投資証券	アメリカ	23,249,187,786	1.99
	カナダ	129,377,387	0.01
	フランス	529,473,340	0.04
	イギリス	729,936,159	0.06
	オーストラリア	1,570,777,601	0.13
	香港	441,463,885	0.03
	シンガポール	436,296,402	0.03
	小計	27,086,512,560	2.32
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	13,418,338,132	1.15
合計（純資産総額）		1,163,330,099,446	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	9,650,717,622	0.82
	買建	カナダ	476,922,390	0.04
	買建	ドイツ	1,300,900,551	0.11
	買建	イギリス	596,207,324	0.05
	買建	スイス	401,358,240	0.03
	買建	オーストラリア	279,175,680	0.02

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	4,792,451,374	6.83
	メキシコ	1,295,249,025	1.84
	ブラジル	3,110,431,533	4.43
	チリ	100,620,571	0.14
	コロンビア	51,939,182	0.07
	ギリシャ	151,678,336	0.21
	イギリス	45,098,249	0.06
	トルコ	155,602,801	0.22
	チェコ	98,187,111	0.14
	ハンガリー	168,479,518	0.24
	ポーランド	507,057,878	0.72
	香港	15,957,173,723	22.77
	マレーシア	936,632,467	1.33
	タイ	1,176,214,557	1.67
	フィリピン	507,333,523	0.72
	インドネシア	1,036,856,954	1.47
	韓国	8,037,116,305	11.46
	台湾	11,027,721,215	15.73
	インド	8,367,429,307	11.94
	カタール	579,923,770	0.82
	エジプト	52,969,034	0.07
	南アフリカ	2,252,176,227	3.21
	アラブ首長国連邦	825,711,805	1.17
	クウェート	435,273,879	0.62
	サウジアラビア	2,553,105,839	3.64
	小計	64,222,434,183	91.64
投資信託受益証券	アメリカ	2,909,801,534	4.15
投資証券	メキシコ	26,720,478	0.03
	南アフリカ	31,857,000	0.04
	小計	58,577,478	0.08
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,884,913,960	4.11
合計（純資産総額）		70,075,727,155	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	2,273,503,052	3.24
	買建	香港	516,772,932	0.73

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	671,098,668,750	79.94
地方債証券	日本	56,808,960,703	6.76
特殊債券	日本	63,494,882,823	7.56
社債券	日本	39,615,703,850	4.71
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	8,468,733,633	1.00
合計（純資産総額）		839,486,949,759	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

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	41,962,053,543	46.99
	カナダ	1,715,552,812	1.92
	メキシコ	634,068,899	0.71
	ドイツ	5,941,960,098	6.65
	イタリア	8,097,513,229	9.06
	フランス	8,549,008,041	9.57
	オランダ	1,599,422,169	1.79
	スペイン	5,248,422,550	5.87
	ベルギー	1,930,316,638	2.16
	オーストリア	1,151,669,764	1.28
	フィンランド	485,705,352	0.54
	アイルランド	732,244,120	0.82
	イギリス	5,151,755,096	5.76
	スウェーデン	247,188,845	0.27
	ノルウェー	211,371,834	0.23
	デンマーク	415,082,885	0.46
	ポーランド	439,124,560	0.49
	オーストラリア	1,350,850,340	1.51
	シンガポール	802,372,622	0.89
	中国	812,835,799	0.91
	イスラエル	410,403,423	0.45
	小計	87,888,922,619	98.42
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	1,409,020,420	1.57
合計（純資産総額）		89,297,943,039	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	297,847,415,203	47.29
	カナダ	12,466,228,377	1.97
	メキシコ	4,453,867,756	0.70
	ドイツ	39,828,074,462	6.32
	イタリア	59,056,167,108	9.37
	フランス	54,902,025,115	8.71
	オランダ	9,610,030,559	1.52
	スペイン	40,274,989,728	6.39
	ベルギー	14,068,144,527	2.23
	オーストリア	8,526,940,958	1.35
	フィンランド	2,545,003,132	0.40
	アイルランド	8,548,694,868	1.35
	イギリス	36,623,734,033	5.81
	スウェーデン	1,723,910,823	0.27
	ノルウェー	1,503,233,155	0.23
	デンマーク	2,710,073,891	0.43
	ポーランド	3,077,048,568	0.48
	オーストラリア	9,833,732,838	1.56
	シンガポール	2,765,865,350	0.43
	マレーシア	3,081,819,575	0.48
	中国	5,665,259,578	0.89
	イスラエル	2,710,378,079	0.43
	小計	621,822,637,683	98.74
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	7,931,617,413	1.25
合計（純資産総額）		629,754,255,096	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	メキシコ	802,537,564	9.15
	ブラジル	760,480,957	8.67
	チリ	178,788,790	2.04
	コロンビア	334,602,353	3.81
	ペルー	195,901,080	2.23
	ウルグアイ	10,405,845	0.11
	ドミニカ共和国	17,599,196	0.20
	セルビア	34,882,429	0.39
	トルコ	97,692,368	1.11
	チェコ	396,829,214	4.52
	ハンガリー	304,151,123	3.47

	ポーランド	602,798,445	6.88
	ロシア	558,036,705	6.36
	ルーマニア	245,622,261	2.80
	マレーシア	747,180,989	8.52
	タイ	776,507,143	8.86
	インドネシア	847,542,604	9.67
	中国	871,956,374	9.95
	南アフリカ	742,930,867	8.47
	小計	8,526,446,307	97.31
現金・預金・その他資産（負債控除後）	―	234,959,910	2.68
合計（純資産総額）		8,761,406,217	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
1	日本	親投資信託受益証券	国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	30,492,110	1.3301	40,560,453	1.3192	40,225,191	27.21
2	日本	親投資信託受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	33,358,526	1.2192	40,670,715	1.1994	40,010,216	27.06
3	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	12,270,695	2.0892	25,635,936	2.0052	24,605,197	16.64
4	日本	親投資信託受益証券	外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	3,187,387	4.5660	14,553,610	4.3234	13,780,348	9.32
5	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	4,565,808	2.5740	11,752,390	2.5385	11,590,303	7.84
6	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	6,972,750	1.5993	11,151,800	1.5761	10,989,751	7.43
7	日本	親投資信託受益証券	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	4,651,397	1.3947	6,487,304	1.3962	6,494,280	4.39

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	99.90
合　　計	99.90

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
1	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	6,646,692	2.0890	13,884,940	2.0052	13,327,946	22.88

2	日本	親投資信託受益証券	国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	8,602,673	1.3301	11,442,416	1.3192	11,348,646	19.49
3	日本	親投資信託受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	9,410,690	1.2192	11,473,514	1.1994	11,287,181	19.38
4	日本	親投資信託受益証券	外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	1,737,772	4.5657	7,934,146	4.3234	7,513,083	12.90
5	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	3,729,368	1.5994	5,964,974	1.5761	5,877,856	10.09
6	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	2,223,927	2.5739	5,724,166	2.5385	5,645,438	9.69
7	日本	親投資信託受益証券	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2,269,312	1.3947	3,165,010	1.3962	3,168,413	5.44

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

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
1	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	5,217,456	2.0891	10,899,788	2.0052	10,462,042	27.08
2	日本	親投資信託受益証券	国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	4,466,227	1.3301	5,940,905	1.3192	5,891,846	15.25
3	日本	親投資信託受益証券	外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	1,362,272	4.5658	6,219,862	4.3234	5,889,646	15.24
4	日本	親投資信託受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	4,887,374	1.2192	5,958,687	1.1994	5,861,916	15.17
5	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	2,903,954	1.5994	4,644,585	1.5761	4,576,921	11.84
6	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,496,071	2.5740	3,850,887	2.5385	3,797,776	9.83
7	日本	親投資信託受益証券	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1,510,399	1.3947	2,106,554	1.3962	2,108,819	5.45

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	99.90
合　　計	99.90

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
1	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	4,378,754	2.0889	9,146,780	2.0052	8,780,277	29.59

2	日本	親投資信託受益証券	外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	1,140,511	4.5655	5,207,003	4.3234	4,930,885	16.62
3	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	2,445,027	1.5996	3,911,190	1.5761	3,853,607	12.99
4	日本	親投資信託受益証券	国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	2,860,083	1.3301	3,804,351	1.3192	3,773,021	12.71
5	日本	親投資信託受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	3,128,989	1.2191	3,814,551	1.1994	3,752,909	12.65
6	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,150,841	2.5739	2,962,150	2.5385	2,921,409	9.84
7	日本	親投資信託受益証券	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1,162,220	1.3947	1,620,949	1.3962	1,622,691	5.47

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／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	7,835,100	1,731.12	13,563,560,858	2,245.50	17,593,717,050	4.28
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	969,000	10,951.66	10,612,167,241	12,720.00	12,325,680,000	3.00
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	140,200	54,587.38	7,653,151,104	58,230.00	8,163,846,000	1.98
4	日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	9,567,800	609.00	5,826,815,885	691.10	6,612,306,580	1.60
5	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,140,200	5,534.45	6,310,383,570	5,595.00	6,379,419,000	1.55
6	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	98,100	50,428.53	4,947,038,933	54,730.00	5,369,013,000	1.30
7	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,587,900	2,872.54	4,561,319,580	3,267.00	5,187,669,300	1.26
8	日本	株式	信越化学工業	化学	260,100	18,615.79	4,841,969,119	19,040.00	4,952,304,000	1.20
9	日本	株式	任天堂	その他製品	87,300	61,615.92	5,379,070,610	56,160.00	4,902,768,000	1.19
10	日本	株式	ダイキン工業	機械	197,100	23,163.32	4,565,491,076	23,825.00	4,695,907,500	1.14
11	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	910,200	9,797.80	8,917,962,703	5,011.00	4,561,012,200	1.11
12	日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	301,800	13,514.10	4,078,558,153	14,755.00	4,453,059,000	1.08
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,141,600	3,142.03	3,586,945,221	3,877.00	4,425,983,200	1.07
14	日本	株式	日立製作所	電気機器	744,000	5,497.76	4,090,339,875	5,939.00	4,418,616,000	1.07
15	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,056,000	3,955.25	4,176,753,101	4,113.00	4,343,328,000	1.05
16	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,217,900	3,423.12	4,169,020,070	3,354.00	4,084,836,600	0.99
17	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,215,800	3,695.02	4,492,416,628	3,328.00	4,046,182,400	0.98
18	日本	株式	日本電産	電気機器	400,900	12,501.30	5,011,772,006	10,090.00	4,045,081,000	0.98
19	日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	1,106,600	3,445.96	3,813,302,555	3,645.00	4,033,557,000	0.98
20	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,065,600	3,533.59	3,765,398,996	3,667.00	3,907,555,200	0.95
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	454,400	8,684.54	3,946,258,260	8,539.00	3,880,121,600	0.94

22	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	174,700	15,704.21	2,743,527,108	19,880.00	3,473,036,000	0.84
23	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	502,400	5,491.31	2,758,838,945	6,830.00	3,431,392,000	0.83
24	日本	株式	三井物産	卸売業	1,183,100	2,539.11	3,004,027,920	2,853.50	3,375,975,850	0.82
25	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	596,000	4,721.37	2,813,942,326	5,593.00	3,333,428,000	0.81
26	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,299,000	1,491.55	3,429,084,404	1,434.00	3,296,766,000	0.80
27	日本	株式	第一三共	医薬品	1,215,600	2,895.55	3,519,841,391	2,565.00	3,118,014,000	0.75
28	日本	株式	ファナック	電気機器	135,800	26,323.37	3,574,714,503	22,460.00	3,050,068,000	0.74
29	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,951,100	1,614.12	3,149,324,298	1,550.00	3,024,205,000	0.73
30	日本	株式	デンソー	輸送用機器	340,600	7,347.86	2,502,683,750	8,494.00	2,893,056,400	0.70

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	0.26
		建設業	2.21
		食料品	3.30
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	6.55
		医薬品	4.65
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.69
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.59
		機械	5.26
		電気機器	17.85
		輸送用機器	8.50
		精密機器	2.63
		その他製品	2.24
		電気・ガス業	1.09
		陸運業	2.92
		海運業	0.54
		空運業	0.39
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	7.66
		卸売業	5.43
		小売業	4.12
		銀行業	5.20

		証券、商品先物取引業	0.74
		保険業	2.20
		その他金融業	1.16
		不動産業	1.90
		サービス業	5.69
合　　計			97.56

（参考）外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	3,029,200	14,132.49	42,810,142,327	19,662.89	59,562,842,140	5.12
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	1,308,300	27,374.96	35,814,666,365	35,585.53	46,556,554,656	4.00
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	83,530	357,857.22	29,891,814,121	332,416.40	27,766,742,427	2.38
4	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	55,170	242,722.57	13,391,004,605	307,880.78	16,985,783,118	1.46
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	52,800	243,637.00	12,864,033,601	307,738.79	16,248,608,513	1.39
6	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC	インタラクティブ・メディアおよびサービス	436,800	33,729.37	14,732,990,336	34,829.40	15,213,482,968	1.30
7	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	154,210	77,125.04	11,893,452,553	97,702.64	15,066,724,731	1.29
8	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	458,140	15,877.19	7,273,978,933	26,366.49	12,079,546,477	1.03
9	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	482,400	19,081.19	9,204,767,290	19,831.43	9,566,685,498	0.82
10	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	172,800	43,756.25	7,561,080,481	53,801.96	9,296,979,794	0.79
11	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	547,600	17,863.20	9,781,890,165	16,924.65	9,267,942,940	0.79
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	242,900	30,165.91	7,327,301,657	36,121.17	8,773,833,650	0.75
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	445,000	15,739.21	7,003,951,725	18,528.12	8,245,013,400	0.70
14	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	193,400	35,616.05	6,888,144,260	42,313.37	8,183,407,228	0.70
15	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	309,300	24,614.92	7,613,395,453	26,320.32	8,140,874,976	0.69
16	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	516,500	13,243.74	6,840,396,280	14,639.44	7,561,270,760	0.64
17	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,388,000	4,537.65	6,298,260,635	5,295.23	7,349,783,126	0.63
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	161,400	41,394.77	6,681,117,484	44,156.95	7,126,932,440	0.61

19	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	775,800	6,612.26	5,129,797,022	8,690.32	6,741,952,739	0.57
20	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	1,027,400	4,283.48	4,400,855,161	6,271.85	6,443,704,032	0.55
21	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	129,000	38,166.91	4,923,531,812	44,075.80	5,685,778,200	0.48
22	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	75,750	67,599.92	5,120,694,659	72,834.42	5,517,207,770	0.47
23	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	354,400	12,286.42	4,354,309,145	15,077.61	5,343,507,961	0.45
24	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	333,000	21,214.90	7,064,563,527	16,003.44	5,329,147,918	0.45
25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	752,100	6,171.84	4,641,846,872	7,023.36	5,282,276,276	0.45
26	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	87,300	54,776.25	4,781,966,935	59,816.39	5,221,970,882	0.44
27	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	323,800	12,469.23	4,037,537,889	15,921.48	5,155,376,778	0.44
28	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	253,300	16,618.54	4,209,477,106	19,933.02	5,049,035,182	0.43
29	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	772,300	6,019.94	4,649,205,496	6,419.61	4,957,871,290	0.42
30	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	75,180	53,254.37	4,003,664,008	64,657.94	4,860,984,230	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	4.44
		メディア	0.96
		娯楽	1.17
		不動産管理・開発	0.39
		エネルギー設備・サービス	0.20
		石油・ガス・消耗燃料	3.82
		化学	2.06
		建設資材	0.25
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.44
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	1.39
		建設関連製品	0.57
		建設・土木	0.21
		電気設備	0.79
		コングロマリット	1.03
		機械	1.69
		商社・流通業	0.34
		商業サービス・用品	0.42
		航空貨物・物流サービス	0.61
		旅客航空輸送業	0.05
		海運業	0.08

陸運・鉄道	1.07
運送インフラ	0.12
自動車部品	0.23
自動車	2.02
家庭用耐久財	0.31
レジャー用品	0.03
繊維・アパレル・贅沢品	1.46
ホテル・レストラン・レジャー	1.78
販売	0.09
インターネット販売・通信販売	2.82
複合小売り	0.47
専門小売り	1.74
食品・生活必需品小売り	1.42
飲料	1.66
食品	1.57
タバコ	0.69
家庭用品	1.17
パーソナル用品	0.57
ヘルスケア機器・用品	2.38
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.09
バイオテクノロジー	1.65
医薬品	4.81
銀行	6.35
各種金融サービス	0.97
保険	3.05
情報技術サービス	4.05
ソフトウェア	7.50
通信機器	0.70
コンピュータ・周辺機器	5.39
電子装置・機器・部品	0.56
半導体・半導体製造装置	4.69
各種電気通信サービス	1.28
無線通信サービス	0.25
電力	1.70
ガス	0.14
総合公益事業	0.85
水道	0.10
消費者金融	0.48
資本市場	3.30
各種消費者サービス	0.00
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.08
ヘルスケア・テクノロジー	0.12

		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.45
		専門サービス	0.75
投資証券	—	—	2.32
合　計			98.84

（参考）新興国株式マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
1	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	1,899,000	2,487.85	4,724,436,112	2,637.30	5,008,234,979	7.14
2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	444,100	8,526.35	3,786,555,921	6,812.60	3,025,475,660	4.31
3	アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	4,261,400	718.03	3,059,842,019	682.82	2,909,801,534	4.15
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	368,210	7,816.98	2,878,290,546	7,014.80	2,582,923,190	3.68
5	香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	1,170,480	3,169.29	3,709,592,768	1,629.10	1,906,828,968	2.72
6	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インターネット販売・通信販売	315,200	4,104.07	1,293,602,926	3,080.48	970,967,296	1.38
7	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	219,900	3,045.01	669,598,599	3,620.56	796,162,793	1.13
8	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	262,700	2,134.63	560,767,484	2,613.61	686,595,347	0.97
9	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	7,414,000	91.97	681,935,594	88.26	654,415,986	0.93
10	香港	株式	JD.COM, INC.	インターネット販売・通信販売	155,167	4,491.30	696,902,041	3,939.46	611,274,190	0.87
11	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	316,552	2,431.72	769,768,565	1,794.59	568,081,263	0.81

12	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	132,300	3,890.30	514,687,946	3,900.57	516,046,073	0.73
13	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	115,538	4,316.76	498,750,214	4,457.70	515,034,031	0.73
14	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	42,100	12,365.90	520,604,533	11,531.85	485,490,885	0.69
15	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	395,400	957.60	378,638,084	1,210.78	478,743,400	0.68
16	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	456,300	768.98	350,889,364	968.77	442,050,883	0.63
17	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	488,000	1,192.31	581,848,285	896.74	437,611,804	0.62
18	サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	92,700	3,071.90	284,765,900	4,561.36	422,838,072	0.60
19	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	71,300	4,906.24	349,815,427	5,719.57	407,805,876	0.58
20	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	961,649	484.57	465,992,900	422.96	406,742,331	0.58
21	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	63,400	7,134.58	452,332,641	6,344.91	402,267,294	0.57
22	サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	172,100	1,691.93	291,182,357	2,249.86	387,200,906	0.55
23	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラクティブ・メディアおよびサービス	21,440	21,760.85	466,552,773	16,915.42	362,666,673	0.51
24	香港	株式	NETEASE, INC.	娯楽	155,250	2,532.50	393,171,276	2,200.76	341,668,921	0.48
25	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	32,050	9,576.69	306,933,189	10,045.58	321,961,121	0.45
26	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	811,000	495.83	402,122,344	381.56	309,449,204	0.44
27	香港	株式	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	ライフサイエンス・ツール/サービス	278,000	1,540.42	428,239,253	1,100.38	305,906,474	0.43
28	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,350,000	74.26	323,055,388	69.31	301,501,980	0.43

29	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	16,790	24,285.06	407,746,176	17,372.68	291,687,364	0.41
30	香港	株式	CHINA MERCHANTS BANK-H	銀行	301,192	980.17	295,222,198	963.39	290,165,511	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	5.96
		メディア	0.17
		娯楽	0.99
		不動産管理・開発	1.82
		エネルギー設備・サービス	0.05
		石油・ガス・消耗燃料	5.47
		化学	2.85
		建設資材	0.93
		容器・包装	0.07
		金属・鉱業	3.90
		紙製品・林産品	0.18
		航空宇宙・防衛	0.09
		建設関連製品	0.02
		建設・土木	0.50
		電気設備	0.35
		コングロマリット	0.94
		機械	0.31
		商社・流通業	0.09
		商業サービス・用品	0.08
		航空貨物・物流サービス	0.24
		旅客航空輸送業	0.11
		海運業	0.43
		陸運・鉄道	0.18
		運送インフラ	0.57
		自動車部品	0.44
		自動車	2.66
		家庭用耐久財	0.32

レジャー用品	0.06
繊維・アパレル・贅沢品	1.08
ホテル・レストラン・レジャー	0.82
インターネット販売・通信販売	5.95
複合小売り	0.25
専門小売り	0.48
食品・生活必需品小売り	1.16
飲料	0.88
食品	1.54
タバコ	0.34
家庭用品	0.38
パーソナル用品	0.42
ヘルスケア機器・用品	0.16
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.61
バイオテクノロジー	0.54
医薬品	1.00
銀行	14.00
各種金融サービス	0.76
保険	2.54
情報技術サービス	2.34
ソフトウェア	0.19
通信機器	0.11
コンピュータ・周辺機器	5.45
電子装置・機器・部品	2.45
半導体・半導体製造装置	9.98
各種電気通信サービス	1.40
無線通信サービス	1.65
電力	0.83
ガス	0.51
総合公益事業	0.02
水道	0.10
貯蓄・抵当・不動産金融	0.73
消費者金融	0.52
資本市場	0.76
各種消費者サービス	0.05
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.70

		ヘルスケア・テクノロジー	0.03
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.80
		専門サービス	0.01
		その他の業種	0.00
投資信託受益証券	—	—	4.15
投資証券	—	—	0.08
合　　計			95.88

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
1	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３６０回	10,900,000,000	100.14	10,916,112,000	100.04	10,904,578,000	0.1	2030/9/20	1.29
2	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３５９回	10,600,000,000	100.25	10,626,820,000	100.16	10,617,596,000	0.1	2030/6/20	1.26
3	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３６３回	10,450,000,000	100.28	10,480,165,500	99.62	10,411,230,500	0.1	2031/6/20	1.24
4	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３６２回	9,800,000,000	100.28	9,827,670,000	99.77	9,777,852,000	0.1	2031/3/20	1.16
5	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１４１回	9,600,000,000	100.65	9,662,589,000	100.39	9,637,920,000	0.1	2024/9/20	1.14
6	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４３回	9,500,000,000	100.97	9,592,534,000	100.59	9,556,240,000	0.1	2026/6/20	1.13
7	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３６４回	8,650,000,000	100.32	8,677,841,500	99.47	8,604,760,500	0.1	2031/9/20	1.02
8	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１３５回	8,500,000,000	100.46	8,539,355,000	100.19	8,516,745,000	0.1	2023/3/20	1.01
9	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４１回	7,300,000,000	101.89	7,438,481,000	101.34	7,397,893,000	0.3	2025/12/20	0.88
10	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３６１回	7,400,000,000	100.07	7,405,180,000	99.91	7,393,488,000	0.1	2030/12/20	0.88
11	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１４８回	7,300,000,000	100.48	7,335,407,000	100.17	7,312,775,000	0.005	2026/6/20	0.87
12	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３５０回	7,150,000,000	100.97	7,219,860,000	100.61	7,193,758,000	0.1	2028/3/20	0.85
13	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１３８回	7,100,000,000	100.62	7,144,134,000	100.31	7,122,010,000	0.1	2023/12/20	0.84
14	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１４９回	7,100,000,000	100.46	7,133,096,000	100.13	7,109,869,000	0.005	2026/9/20	0.84
15	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４５回	7,000,000,000	100.97	7,068,095,000	100.58	7,041,020,000	0.1	2026/12/20	0.83

16	日本	国債証券	国庫債券　利付（２年）第４２７回	6,800,000,000	100.26	6,817,956,000	100.11	6,807,616,000	0.005	2023/8/1	0.81
17	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１３９回	6,700,000,000	100.61	6,741,485,000	100.34	6,722,847,000	0.1	2024/3/20	0.80
18	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	102.37	6,756,816,000	101.56	6,703,026,000	0.6	2024/6/20	0.79
19	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１３７回	6,600,000,000	100.54	6,635,949,000	100.27	6,618,282,000	0.1	2023/9/20	0.78
20	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４２回	6,550,000,000	100.93	6,610,915,000	100.57	6,587,859,000	0.1	2026/3/20	0.78
21	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４４回	6,400,000,000	100.99	6,463,360,000	100.57	6,437,056,000	0.1	2026/9/20	0.76
22	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３５２回	6,400,000,000	100.97	6,462,200,000	100.56	6,436,032,000	0.1	2028/9/20	0.76
23	日本	国債証券	国庫債券　利付（４０年）第１３回	7,020,000,000	93.56	6,568,409,500	90.57	6,358,224,600	0.5	2060/3/20	0.75
24	日本	国債証券	国庫債券　利付（５年）第１４３回	6,070,000,000	100.87	6,123,123,200	100.48	6,099,439,500	0.1	2025/3/20	0.72
25	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	102.08	6,124,860,000	101.19	6,071,700,000	0.8	2023/6/20	0.72
26	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３５１回	6,000,000,000	100.90	6,054,000,000	100.60	6,036,300,000	0.1	2028/6/20	0.71
27	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	102.02	6,019,180,000	101.24	5,973,337,000	0.6	2023/12/20	0.71
28	日本	国債証券	国庫債券　利付（２０年）第１７６回	6,020,000,000	101.04	6,082,701,300	99.22	5,973,044,000	0.5	2041/3/20	0.71
29	日本	国債証券	国庫債券　利付（１０年）第３４８回	5,800,000,000	100.94	5,854,520,000	100.61	5,835,902,000	0.1	2027/9/20	0.69
30	日本	国債証券	国庫債券　利付（２０年）第１５５回	5,350,000,000	110.10	5,890,403,500	108.82	5,821,923,500	1	2035/12/20	0.69

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.94
地方債証券	6.76
特殊債券	7.56
社債券	4.71
合　　計	98.99

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（%）	償還期限	投資比率（%）
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,400,000	12,782.27	690,242,800	12,220.40	659,901,906	2.625	2029/2/15	0.73

2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	13,164.21	658,210,885	12,569.43	628,471,579	3.125	2028/11/15	0.70
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,815.46	590,773,204	11,603.97	580,198,727	1.375	2023/9/30	0.64
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	10,922.15	600,718,637	10,513.15	578,223,612	0.625	2030/8/15	0.64
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	11,400.03	570,001,848	11,162.50	558,125,329	0.875	2026/9/30	0.62
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	11,380.75	512,134,189	10,931.17	491,902,885	1.125	2031/2/15	0.55
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	12,017.48	504,734,332	11,565.64	485,757,090	1.625	2026/5/15	0.54
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,480.14	499,205,827	12,036.42	481,456,927	2.75	2025/6/30	0.53
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,030,000	12,279.02	494,844,798	11,763.15	474,055,136	2.25	2046/8/15	0.53
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,025.70	481,028,192	11,829.44	473,177,709	2.25	2024/11/15	0.52
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,133.82	485,353,027	11,826.73	473,069,472	2.375	2024/2/29	0.52
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,065.73	482,629,382	11,740.15	469,606,272	2	2024/6/30	0.52
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,016.58	480,663,300	11,554.82	462,192,900	1.625	2026/9/30	0.51
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,873.63	474,945,372	11,433.97	457,358,827	1.375	2026/8/31	0.51
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,290,000	20,885.58	478,279,866	19,968.44	457,277,361	4.75	2035/4/25	0.51
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,520,000	13,487.08	474,745,551	12,956.33	456,063,015	2.75	2047/8/15	0.51
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,521.00	460,840,082	11,373.99	454,959,845	0.125	2023/9/15	0.50
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	12,496.83	474,879,548	11,969.68	454,848,030	2.375	2027/5/15	0.50
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,516.49	460,659,672	11,357.31	454,292,463	0.125	2023/10/15	0.50
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,697.31	467,892,727	11,218.42	448,736,890	1.25	2028/4/30	0.50
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,352.35	454,094,045	11,013.69	440,547,900	0.25	2025/10/31	0.49
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	16,265.31	455,428,813	15,434.68	432,171,269	4.25	2040/11/15	0.48
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	12,824.59	448,860,930	12,341.25	431,944,013	2.875	2028/5/15	0.48
24	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,720,000	15,926.62	433,204,293	15,401.06	418,908,973	2.5	2030/5/25	0.46
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	12,459.40	436,079,079	11,968.78	418,907,379	2.5	2026/2/28	0.46
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	12,859.83	437,234,382	12,302.47	418,284,204	2.5	2046/5/15	0.46
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	12,209.13	427,319,613	11,911.51	416,902,977	2.875	2023/11/30	0.46
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	12,122.10	424,273,555	11,851.08	414,788,070	2.75	2023/8/31	0.46
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	12,283.98	429,939,570	11,810.05	413,351,829	2.125	2026/5/31	0.46
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	11,775.78	412,152,356	11,588.19	405,586,706	1.25	2023/7/31	0.45

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.42
合　　計	98.42

（参考）外国債券マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	143,750,000	15,635.68	22,476,295,089	15,087.46	21,688,233,219	5.375	2031/2/15	3.44
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	126,400,000	14,640.64	18,505,772,612	14,157.63	17,895,248,331	5.25	2028/11/15	2.84
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	81,000,000	11,894.43	9,634,496,326	11,557.52	9,361,597,080	1.625	2026/11/30	1.48

4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	66,600,000	14,391.49	9,584,733,381	13,567.80	9,036,159,795	6	2026/2/15	1.43
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	67,400,000	11,828.28	7,972,265,327	11,631.03	7,839,314,365	1.5	2023/2/28	1.24
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	65,400,000	12,263.40	8,020,265,685	11,872.73	7,764,767,196	2.5	2024/5/15	1.23
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	57,850,000	12,189.23	7,051,469,622	11,829.44	6,843,332,611	2.25	2024/11/15	1.08
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,600,000	12,831.62	6,877,750,761	12,341.25	6,614,914,020	2.875	2028/5/15	1.05
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	16,041.87	6,593,210,070	15,569.06	6,398,886,644	6.25	2030/5/15	1.01
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	12,085.57	6,224,071,236	12,294.36	6,331,595,400	2.5	2046/2/15	1.00
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,700,000	12,360.65	6,143,247,645	11,851.08	5,889,990,595	2.25	2025/11/15	0.93
12	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,600,000	20,634.40	5,901,440,901	19,968.44	5,710,974,901	4.75	2035/4/25	0.90
13	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000	16,859.64	5,841,865,752	16,303.65	5,649,215,997	5.9	2026/7/30	0.89
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	33,000,000	17,620.73	5,814,841,322	17,079.61	5,636,272,950	5.25	2029/11/1	0.89
15	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	32,800,000	17,816.14	5,843,694,820	17,118.21	5,614,773,864	6.5	2027/11/1	0.89
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,700,000	12,297.35	5,742,866,857	11,854.69	5,536,142,665	2.375	2024/8/15	0.87
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,950,000	13,651.88	5,453,929,042	13,540.75	5,409,529,892	3.125	2044/8/15	0.85
18	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,700,000	18,643.20	5,537,031,574	18,025.26	5,353,504,002	5.5	2029/4/25	0.85
19	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	27,300,000	20,136.79	5,497,344,080	19,470.11	5,315,342,159	5.75	2032/7/30	0.84
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,400,000	12,151.00	5,395,046,480	11,785.25	5,232,651,502	2.25	2023/12/31	0.83
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,550,000	12,649.42	5,382,332,047	12,295.26	5,231,633,805	2.375	2051/5/15	0.83
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,600,000	12,221.53	5,328,591,136	11,786.60	5,138,959,382	2.125	2024/9/30	0.81
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	12,277.22	5,230,097,461	11,877.24	5,059,705,008	2.75	2023/11/15	0.80
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	12,422.45	5,254,696,718	11,921.88	5,042,957,253	2.375	2026/4/30	0.80
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	15,410.89	5,101,006,178	14,916.84	4,937,474,172	3.5	2026/4/25	0.78
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,900,000	12,100.00	4,827,902,081	12,242.05	4,884,578,218	2.5	2045/2/15	0.77
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,700,000	13,220.86	4,852,057,938	13,289.12	4,877,109,705	3	2044/11/15	0.77
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,900,000	11,918.30	4,993,768,509	11,486.28	4,812,751,320	1.5	2026/8/15	0.76
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,150,000	19,912.48	4,808,866,280	19,547.05	4,720,614,140	3.25	2045/5/25	0.74
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,600,000	15,255.42	4,820,713,282	14,801.04	4,677,130,662	5	2025/3/1	0.74

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.74
合　　計	98.74

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	15,200,000	1,813.78	275,695,229	1,837.92	279,364,266	2.69	2026/8/12	3.18
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	13,500,000	1,810.82	244,460,799	1,827.24	246,678,354	2.47	2024/9/2	2.81
3	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	8,600,000	3,042.31	261,638,754	2,625.92	225,829,876	2.75	2028/4/25	2.57
4	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	11,900,000	1,791.13	213,144,772	1,631.54	194,154,331	—	2024/1/1	2.21
5	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000	1,819.09	163,718,226	1,844.54	166,008,660	2.91	2028/10/14	1.89
6	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	7,100,000	1,836.36	130,382,201	1,757.96	124,815,199	—	2023/7/1	1.42
7	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,800,000	2,794.43	134,133,005	2,565.14	123,126,981	0.75	2025/4/25	1.40
8	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000	861.51	128,365,938	820.68	122,282,023	10.5	2026/12/21	1.39
9	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	1,836.63	110,197,806	1,856.20	111,372,354	3.02	2031/5/27	1.27
10	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,100,000	705.36	113,564,248	682.66	109,908,949	8	2030/1/31	1.25
11	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	480,000	2,350.81	112,839,124	2,120.27	101,773,312	10	2023/1/1	1.16
12	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	490,000	2,275.28	111,489,324	2,070.07	101,433,859	10	2027/1/1	1.15
13	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000	2,423.96	116,602,050	2,095.73	100,804,844	10	2025/1/1	1.15
14	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	2,857.54	100,014,045	2,837.82	99,324,001	4	2023/10/25	1.13
15	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,650,000	615.58	96,338,912	552.33	86,440,242	7.5	2027/6/3	0.98
16	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000	616.24	85,658,163	619.43	86,101,586	8.75	2048/2/28	0.98
17	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000	661.96	93,337,730	589.32	83,095,454	10	2024/12/5	0.94
18	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,700,000	613.76	90,223,419	560.56	82,403,567	8	2024/9/5	0.94
19	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	16,600,000	519.45	86,229,897	474.59	78,782,058	1	2026/6/26	0.89
20	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	17,800,000	504.34	89,773,197	441.24	78,542,329	1.2	2031/3/13	0.89
21	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,600,000	557.69	81,423,573	519.18	75,800,302	5.75	2026/3/5	0.86
22	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000	2,923.31	78,929,390	2,791.86	75,380,232	3.885	2029/8/15	0.86
23	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000	612.77	81,498,737	556.76	74,049,611	7.75	2031/5/29	0.84
24	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,944.23	76,550,141	2,842.25	73,898,673	4.181	2024/7/15	0.84
25	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000	614.46	72,506,825	620.36	73,203,569	8.75	2044/1/31	0.83
26	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000	626.41	70,157,920	627.15	70,240,800	8.5	2037/1/31	0.80

27	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000	2,944.53	73,613,452	2,787.61	69,690,477	3.733	2028/6/15	0.79
28	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	14,000,000	523.33	73,266,768	494.38	69,213,902	0.45	2023/10/25	0.78
29	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000	1,912.40	66,934,244	1,958.07	68,532,740	3.72	2051/4/12	0.78
30	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000	2,883.36	69,200,862	2,829.35	67,904,582	3.9	2026/11/30	0.77

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.31
合　　計	97.31

②【投資不動産物件】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

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

種類	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物(2022年03月限)	買建	527	日本円	10,141,698,976	10,005,095,000	2.43

（参考）外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド

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

種類	国／地域	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2022年03月限)	買建	378	米ドル	86,298,900	9,962,345,016	83,599,425	9,650,717,622	0.82
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2022年03月限)	買建	21	カナダドル	5,340,980	482,984,821	5,273,940	476,922,390	0.04
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2022年03月限)	買建	245	ユーロ	10,358,505	1,332,725,252	10,111,150	1,300,900,551	0.11

	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200株価指数先物(2022年03月限)	買建	20	豪ドル	3,611,650	291,749,088	3,456,000	279,175,680	0.02
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2022年03月限)	買建	52	英ポンド	3,856,930	596,744,209	3,853,460	596,207,324	0.05
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2022年03月限)	買建	27	スイスフラン	3,351,510	415,587,240	3,236,760	401,358,240	0.03

（参考）新興国株式マザーファンド

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

種類	国／地域	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマージングマーケット株価指数先物(2022年03月限)	買建	332	米ドル	20,370,940	2,351,621,311	19,694,240	2,273,503,052	3.24
	香港	香港先物取引所	MSCI China A 50 Connect 指数先物(2022年02月限)	買建	71	米ドル	4,688,130	541,197,728	4,476,550	516,772,932	0.73

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

2022年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	55	55	1.0544	1.0544
第2計算期間 (2017年12月26日)	87	87	1.1699	1.1699
第3計算期間 (2018年12月26日)	88	88	1.0553	1.0553
第4計算期間 (2019年12月26日)	114	114	1.1863	1.1863
第5計算期間 (2020年12月28日)	131	131	1.2347	1.2347
第6計算期間 (2021年12月27日)	150	150	1.3015	1.3015
2021年 1月末日	133	—	1.2469	—
2月末日	135	—	1.2495	—
3月末日	138	—	1.2744	—
4月末日	139	—	1.2764	—
5月末日	141	—	1.2847	—
6月末日	143	—	1.2933	—
7月末日	144	—	1.2897	—
8月末日	146	—	1.2990	—
9月末日	146	—	1.2964	—
10月末日	148	—	1.3076	—
11月末日	148	—	1.2932	—
12月末日	150	—	1.3046	—
2022年 1月末日	147	—	1.2734	—

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

2022年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	10	10	1.0514	1.0514
第2計算期間 (2017年12月26日)	21	21	1.1664	1.1664
第3計算期間 (2018年12月26日)	27	27	1.0377	1.0377
第4計算期間 (2019年12月26日)	40	40	1.1878	1.1878
第5計算期間 (2020年12月28日)	50	50	1.2467	1.2467
第6計算期間 (2021年12月27日)	59	59	1.3469	1.3469
2021年 1月末日	51	—	1.2648	—

2月末日	52	—	1.2759	—
3月末日	52	—	1.3089	—
4月末日	53	—	1.3117	—
5月末日	56	—	1.3222	—
6月末日	54	—	1.3339	—
7月末日	54	—	1.3245	—
8月末日	55	—	1.3379	—
9月末日	55	—	1.3392	—
10月末日	58	—	1.3551	—
11月末日	57	—	1.3338	—
12月末日	59	—	1.3526	—
2022年 1月末日	58	—	1.3136	—

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

2022年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	7	7	1.0472	1.0472
第2計算期間 (2017年12月26日)	15	15	1.1589	1.1589
第3計算期間 (2018年12月26日)	19	19	1.0320	1.0320
第4計算期間 (2019年12月26日)	28	28	1.1848	1.1848
第5計算期間 (2020年12月28日)	37	37	1.2479	1.2479
第6計算期間 (2021年12月27日)	39	39	1.3648	1.3648
2021年 1月末日	33	—	1.2692	—
2月末日	34	—	1.2844	—
3月末日	35	—	1.3211	—
4月末日	36	—	1.3241	—
5月末日	36	—	1.3357	—
6月末日	37	—	1.3486	—
7月末日	37	—	1.3361	—
8月末日	37	—	1.3519	—
9月末日	38	—	1.3556	—
10月末日	39	—	1.3741	—
11月末日	38	—	1.3489	—
12月末日	39	—	1.3720	—
2022年 1月末日	38	—	1.3281	—

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

2022年1月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2016年12月26日)	6	6	1.0409	1.0409
第2計算期間 (2017年12月26日)	10	10	1.1478	1.1478
第3計算期間 (2018年12月26日)	13	13	1.0248	1.0248
第4計算期間 (2019年12月26日)	18	18	1.1734	1.1734
第5計算期間 (2020年12月28日)	23	23	1.2457	1.2457
第6計算期間 (2021年12月27日)	30	30	1.3742	1.3742
2021年 1月末日	23	—	1.2684	—
2月末日	24	—	1.2868	—
3月末日	26	—	1.3264	—
4月末日	26	—	1.3297	—
5月末日	27	—	1.3420	—
6月末日	27	—	1.3560	—
7月末日	27	—	1.3412	—
8月末日	29	—	1.3586	—
9月末日	28	—	1.3639	—
10月末日	29	—	1.3841	—
11月末日	29	—	1.3566	—
12月末日	30	—	1.3822	—
2022年 1月末日	29	—	1.3354	—

②【分配の推移】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円

第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	0.0000円
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	0.0000円

③【収益率の推移】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.4%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	11.0%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△9.8%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	12.4%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	4.1%
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	5.4%

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

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.9%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	5.0%
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	8.0%

※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。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.7%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.7%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.8%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	5.3%
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	9.4%

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

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.3%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	△10.7%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	6.2%
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	10.3%

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

（４）【設定及び解約の実績】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数

第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	55,225,894	2,600,834	52,625,060
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	24,780,288	2,633,235	74,772,113
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	18,821,572	10,010,450	83,583,235
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	16,232,168	3,027,760	96,787,643
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	12,106,975	2,687,771	106,206,847
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	10,754,745	1,432,534	115,529,058

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	9,846,136	172	9,845,964
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	8,525,619	19,110	18,352,473
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	8,382,826	156,480	26,578,819
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	7,806,968	403,555	33,982,232
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	8,125,766	1,891,861	40,216,137
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	7,570,614	3,926,197	43,860,554

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,747,567	22	6,747,545
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	6,892,208	7,296	13,632,457
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	5,291,632	64,250	18,859,839
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	5,443,331	88,292	24,214,878
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	6,341,882	549,936	30,006,824
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	3,237,613	4,394,649	28,849,788

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

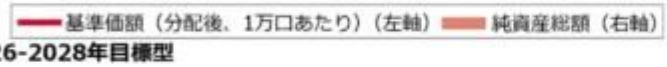
	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,671,960	59,305	6,612,655
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	2,418,017	29,744	9,000,928
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	4,410,696	625,991	12,785,633
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	3,370,205	55,192	16,100,646
第5計算期間	2019年12月27日～2020年12月28日	3,607,259	1,199,279	18,508,626
第6計算期間	2020年12月29日～2021年12月27日	4,315,249	953,733	21,870,142

※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≫

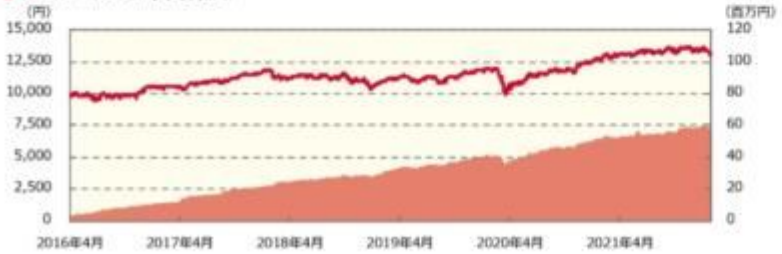
運用実績（2022年1月31日現在）

基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



2026-2028年目標型

2029-2031年目標型



2032-2034年目標型

2035-2037年目標型

分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2026-2028年目標型

2021年12月	0 円
2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
設定来累計	0 円

2029-2031年目標型

2021年12月	0 円
2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
設定来累計	0 円

2032-2034年目標型

2021年12月	0 円
2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
設定来累計	0 円

2035-2037年目標型

2021年12月	0 円
2020年12月	0 円
2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
設定来累計	0 円

運用実績（2022年1月31日現在）

主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率（%）			
	野村ターゲットデートファンド2016			
	2026-2028年目標型	2029-2031年目標型	2032-2034年目標型	2035-2037年目標型
国内株式マザーファンド	16.6	22.9	27.1	29.6
外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	9.3	12.9	15.2	16.6
新興国株式マザーファンド	7.4	10.1	11.8	13.0
国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	27.2	19.5	15.3	12.7
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	27.1	19.4	15.2	12.7
外国債券マザーファンド	7.8	9.7	9.8	9.8
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	4.4	5.4	5.5	5.5

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（%）			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年目標型	2029-2031年目標型	2032-2034年目標型	2035-2037年目標型
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.7	1.0	1.2	1.3
2	ソニーグループ	電気機器	0.5	0.7	0.8	0.9
3	キーエンス	電気機器	0.3	0.5	0.5	0.6
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	0.3	0.4	0.4	0.5
5	リクルートホールディングス	サービス業	0.3	0.4	0.4	0.5

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（%）			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年目標型	2029-2031年目標型	2032-2034年目標型	2035-2037年目標型
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.5	0.7	0.8	0.9
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.4	0.5	0.6	0.7
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.3	0.4	0.4
4	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.2	0.2	0.2
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.2	0.2	0.2

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（%）			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年目標型	2029-2031年目標型	2032-2034年目標型	2035-2037年目標型
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.5	0.7	0.8	0.9
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.3	0.4	0.5	0.6
3	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	0.3	0.4	0.5	0.5
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.3	0.4	0.4	0.5
5	ALIBABA GROUP HOLDING	インターネット販売・通信販売	0.2	0.3	0.3	0.4

運用実績（2022年1月31日現在）

・「国内債券NOMURA-BPI総合　マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年目標型	2029-2031年目標型	2032-2034年目標型	2035-2037年目標型
1	国庫債券　利付（１０年）第３６０回	国債証券	0.4	0.3	0.2	0.2
2	国庫債券　利付（１０年）第３５９回	国債証券	0.3	0.2	0.2	0.2
3	国庫債券　利付（１０年）第３６３回	国債証券	0.3	0.2	0.2	0.2
4	国庫債券　利付（１０年）第３６２回	国債証券	0.3	0.2	0.2	0.1
5	国庫債券　利付（５年）第１４１回	国債証券	0.3	0.2	0.2	0.1

・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年目標型	2029-2031年目標型	2032-2034年目標型	2035-2037年目標型
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

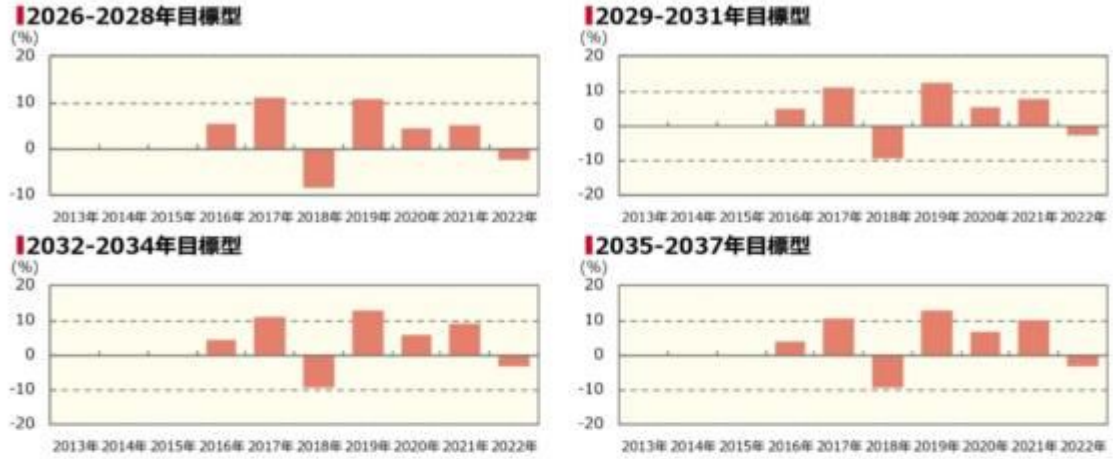
順位	銘柄	種類	投資比率（%）			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年目標型	2029-2031年目標型	2032-2034年目標型	2035-2037年目標型
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.3	0.3	0.3	0.3
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.2	0.3	0.3	0.3
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年目標型	2029-2031年目標型	2032-2034年目標型	2035-2037年目標型
1	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	0.2	0.2	0.2
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	0.2	0.2	0.2
3	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
4	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
5	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1

運用実績（2022年1月31日現在）

年間収益率の推移（暦年ベース）



・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、毎月基本投資割合を変更するため、暦年ベースで収益率を表示した場合、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマークは掲載しておりません。
・2016年は設定日（2016年4月1日）から年末までの収益率。
・2022年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

・申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
・取得申込みの受付けについては、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。
・販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得の申込みができません。

申込日当日またはその翌営業日が以下のいずれかの休業日と同日の場合

・ニューヨーク証券取引所　　・ニューヨークの銀行

※申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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/

・購入コースには、分配金を受取る「一般コース」と、分配金が再投資される「自動けいぞく投資コース」があります。販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。また、原則として、お買付け後のコース変更はできません。
・販売の単位は、１万口以上１口単位（当初元本1口＝１円）または１万円以上１円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。
・スイッチングのお取扱いはありません。

■積立方式■

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

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

・受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
・取得申込日から起算して7営業日目までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。
・金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付けを取り消す場合があります。

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

2【換金（解約）手続等】

・受益者は、委託者に1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。
・受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
・一部解約の実行の請求の受付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。
ただし、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求ができません。(申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。)
・換金価額は、換金申込日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

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

・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。
・金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消す場合があります。
また、一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の計算方法＞

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当たりの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日※1の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日※1における以下のいずれかの価額で評価します。※2 ①日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ②金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） ③価格情報会社の提供する価額
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。

※1　外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日とします。
※2　残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)による評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

2026-2028年目標型：2029年3月16日までとします(2016年4月1日設定)。
2029-2031年目標型：2032年3月16日までとします(2016年4月1日設定)。
2032-2034年目標型：2035年3月16日までとします(2016年4月1日設定)。
2035-2037年目標型：2038年3月16日までとします(2016年4月1日設定)。

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年12月27日から翌年12月26日までとします。
なお、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

(ａ) ファンドの繰上償還条項

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

(ｂ) 信託期間の終了

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

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

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

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

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

(ⅵ)委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(ｄ)信託約款の変更等」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(ｃ) 運用報告書

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

(ｄ) 信託約款の変更等

(ⅰ)委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

(ⅱ)委託者は、上記(ⅰ)の事項（上記(ⅰ)の変更事項にあってはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当す

る場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

(ⅴ)書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

(vi)上記(ⅱ)から(ⅴ)までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

(vii)上記(ⅰ)から(vi)の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(ｅ) 公告

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

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

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

(ｆ) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

(ｇ) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(ｈ) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

1.他の受益者の氏名または名称および住所

2.他の受益者が有する受益権の内容

(ｉ) 関係法人との契約の更新に関する手続

委託者と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」は、契約終了の３ヵ月前までに当事者の一方から別段の意思表示のないときは、原則１年毎に自動的に更新されるものとします。
なお、運用の外部委託を行なう場合は、委託者と運用の委託先との間で締結する「運用指図に関する権限の委託契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から更新しない旨を書面によって通知がない限り、1年毎に自動的に更新されるものとします。但し、当該契約はファンドの償還日に終了するものとします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

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

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

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

■収益分配金請求権の失効■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

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

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

第３【ファンドの経理状況】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

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

(２)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2020年12月29日から2021年12月27日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2020年12月28日現在)	第6期 (2021年12月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	758,604	895,932
親投資信託受益証券	131,031,690	150,207,527
未収入金	-	25,256
流動資産合計	131,790,294	151,128,715
資産合計	131,790,294	151,128,715
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	34,322	40,423
未払委託者報酬	617,667	727,475
その他未払費用	1,992	2,376
流動負債合計	653,981	770,274
負債合計	653,981	770,274
純資産の部		
元本等		
元本	106,206,847	115,529,058
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	24,929,466	34,829,383
（分配準備積立金）	16,739,869	23,725,539
元本等合計	131,136,313	150,358,441
純資産合計	131,136,313	150,358,441
負債純資産合計	131,790,294	151,128,715

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2019年12月27日 至　2020年12月28日	第6期 自　2020年12月29日 至　2021年12月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	6,591,710	8,757,890
営業収益合計	6,591,710	8,757,890
営業費用		
支払利息	28	18
受託者報酬	65,346	78,334
委託者報酬	1,176,035	1,409,764
その他費用	3,791	4,583
営業費用合計	1,245,200	1,492,699
営業利益又は営業損失（△）	5,346,510	7,265,191
経常利益又は経常損失（△）	5,346,510	7,265,191
当期純利益又は当期純損失（△）	5,346,510	7,265,191
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（△）	△75,399	69,331
期首剰余金又は期首欠損金（△）	18,032,693	24,929,466
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,962,979	3,039,018
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,962,979	3,039,018
剰余金減少額又は欠損金増加額	488,115	334,961
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	488,115	334,961
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	24,929,466	34,829,383

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
２.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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12月29日から2021年12月27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5期 2020年12月28日現在	第6期 2021年12月27日現在
１．　計算期間の末日における受益権の総数 106,206,847口	１．　計算期間の末日における受益権の総数 115,529,058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	２．　計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額　1.2347円	1口当たり純資産額　1.3015円
(10,000口当たり純資産額)　(12,347円)	(10,000口当たり純資産額)　(13,015円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期
自 2019年12月27日
至 2020年12月28日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,912,691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	3,239,679円
収益調整金額	C	9,316,449円
分配準備積立金額	D	11,587,499円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	26,056,318円
当ファンドの期末残存口数	F	106,206,847口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,453円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

第6期
自 2020年12月29日
至 2021年12月27日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	2,175,141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	5,020,719円
収益調整金額	C	11,837,403円
分配準備積立金額	D	16,529,679円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	35,562,942円
当ファンドの期末残存口数	F	115,529,058口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,078円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27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。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の２ 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制 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。	3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第5期 2020年12月28日現在	第6期 2021年12月27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。	１．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
２．時価の算定方法	２．時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日		第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	
期首元本額	96,787,643円	期首元本額	106,206,847円
期中追加設定元本額	12,106,975円	期中追加設定元本額	10,754,745円
期中一部解約元本額	2,687,771円	期中一部解約元本額	1,432,534円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27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	6,775,627	7,088,720
合計	6,775,627	7,088,720

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12月27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12月27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	12,670,623	26,468,931	
		外国債券マザーファンド	4,591,048	11,817,816	
		外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	3,306,462	15,095,652	
		国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	29,798,474	39,643,889	
		新興国株式マザーファンド	6,859,553	10,969,111	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	4,828,773	6,735,172	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	32,368,774	39,476,956	
	小計	銘柄数：7	94,423,707	150,207,527	
		組入時価比率：99.9%		100.0%	
合計				150,207,527	

(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。

【野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2020年12月28日現在)	第6期 (2021年12月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	286,220	347,478
親投資信託受益証券	50,098,958	59,025,755
流動資産合計	50,385,178	59,373,233
資産合計	50,385,178	59,373,233
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	12,944	15,529
未払委託者報酬	232,938	279,488
その他未払費用	733	870
流動負債合計	246,615	295,887
負債合計	246,615	295,887
純資産の部		
元本等		
元本	40,216,137	43,860,554
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,922,426	15,216,792
（分配準備積立金）	6,216,409	9,539,443
元本等合計	50,138,563	59,077,346
純資産合計	50,138,563	59,077,346
負債純資産合計	50,385,178	59,373,233

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2019年12月27日 至　2020年12月28日	第6期 自　2020年12月29日 至　2021年12月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	3,085,661	4,694,687
営業収益合計	3,085,661	4,694,687
営業費用		
支払利息	4	8
受託者報酬	23,962	30,090
委託者報酬	431,237	541,574
その他費用	1,323	1,665
営業費用合計	456,526	573,337
営業利益又は営業損失（△）	2,629,135	4,121,350
経常利益又は経常損失（△）	2,629,135	4,121,350
当期純利益又は当期純損失（△）	2,629,135	4,121,350
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（△）	29,647	243,202
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,380,861	9,922,426
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,285,547	2,387,905
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,285,547	2,387,905
剰余金減少額又は欠損金増加額	343,470	971,687
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	343,470	971,687
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	9,922,426	15,216,792

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
２.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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12月29日から2021年12月27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5期 2020年12月28日現在	第6期 2021年12月27日現在
１．　計算期間の末日における受益権の総数 40,216,137口	１．　計算期間の末日における受益権の総数 43,860,554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	２．　計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額　1.2467円	1口当たり純資産額　1.3469円
(10,000口当たり純資産額)　(12,467円)	(10,000口当たり純資産額)　(13,469円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期
自 2019年12月27日
至 2020年12月28日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	763,840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	1,835,648円
収益調整金額	C	4,849,043円
分配準備積立金額	D	3,616,921円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	11,065,452円
当ファンドの期末残存口数	F	40,216,137口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,751円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

第6期
自 2020年12月29日
至 2021年12月27日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	932,456円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,945,692円
収益調整金額	C	6,432,403円
分配準備積立金額	D	5,661,295円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,971,846円
当ファンドの期末残存口数	F	43,860,554口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,641円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27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。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の２ 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制 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。	3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第5期 2020年12月28日現在	第6期 2021年12月27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。	１．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
２．時価の算定方法	２．時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日		第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	
期首元本額	33,982,232円	期首元本額	40,216,137円
期中追加設定元本額	8,125,766円	期中追加設定元本額	7,570,614円
期中一部解約元本額	1,891,861円	期中一部解約元本額	3,926,197円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,073,229	3,768,428
合計	3,073,229	3,768,428

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12月27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12月27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	6,768,344	14,139,070	
		外国債券マザーファンド	2,208,084	5,683,829	
		外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	1,778,631	8,120,339	
		国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	8,290,793	11,030,071	
		新興国株式マザーファンド	3,681,860	5,887,662	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2,278,443	3,177,972	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	9,008,538	10,986,812	
	小計	銘柄数：7	34,014,693	59,025,755	
		組入時価比率：99.9%		100.0%	
合計				59,025,755	

(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。

【野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2020年12月28日現在)	第6期 (2021年12月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	206,984	234,036
親投資信託受益証券	37,417,180	39,340,566
流動資産合計	37,624,164	39,574,602
資産合計	37,624,164	39,574,602
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	9,304	10,501
未払委託者報酬	167,549	189,011
その他未払費用	490	574
流動負債合計	177,343	200,086
負債合計	177,343	200,086
純資産の部		
元本等		
元本	30,006,824	28,849,788
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,439,997	10,524,728
（分配準備積立金）	4,677,082	7,138,223
元本等合計	37,446,821	39,374,516
純資産合計	37,446,821	39,374,516
負債純資産合計	37,624,164	39,574,602

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2019年12月27日 至　2020年12月28日	第6期 自　2020年12月29日 至　2021年12月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,323,872	3,549,935
営業収益合計	2,323,872	3,549,935
営業費用		
支払利息	-	13
受託者報酬	17,264	20,281
委託者報酬	310,836	364,961
その他費用	898	1,125
営業費用合計	328,998	386,380
営業利益又は営業損失（△）	1,994,874	3,163,555
経常利益又は経常損失（△）	1,994,874	3,163,555
当期純利益又は当期純損失（△）	1,994,874	3,163,555
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（△）	△52,537	33,882
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,473,823	7,439,997
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,016,499	1,029,524
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,016,499	1,029,524
剰余金減少額又は欠損金増加額	97,736	1,074,466
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	97,736	1,074,466
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,439,997	10,524,728

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
２.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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12月29日から2021年12月27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5期 2020年12月28日現在	第6期 2021年12月27日現在
１．　計算期間の末日における受益権の総数 30,006,824口	１．　計算期間の末日における受益権の総数 28,849,788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	２．　計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額　1.2479円	1口当たり純資産額　1.3648円
(10,000口当たり純資産額)　(12,479円)	(10,000口当たり純資産額)　(13,648円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期
自 2019年12月27日
至 2020年12月28日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	568,111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	1,479,300円
収益調整金額	C	3,391,517円
分配準備積立金額	D	2,629,671円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,068,599円
当ファンドの期末残存口数	F	30,006,824口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,688円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

第6期
自 2020年12月29日
至 2021年12月27日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	659,819円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,469,854円
収益調整金額	C	3,773,421円
分配準備積立金額	D	4,008,550円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	10,911,644円
当ファンドの期末残存口数	F	28,849,788口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,782円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27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。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の２ 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制 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。	3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第5期 2020年12月28日現在	第6期 2021年12月27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。	１．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
２．時価の算定方法	２．時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日		第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	
期首元本額	24,214,878円	期首元本額	30,006,824円
期中追加設定元本額	6,341,882円	期中追加設定元本額	3,237,613円
期中一部解約元本額	549,936円	期中一部解約元本額	4,394,649円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,412,502	3,056,902
合計	2,412,502	3,056,902

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12月27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12月27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	5,284,655	11,039,644	
		外国債券マザーファンド	1,468,866	3,781,007	
		外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	1,383,281	6,315,369	
		国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	4,318,789	5,745,716	
		新興国株式マザーファンド	2,890,116	4,621,584	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1,515,670	2,114,056	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	4,692,678	5,723,190	
	小計	銘柄数：7	21,554,055	39,340,566	
		組入時価比率：99.9%		100.0%	
合計				39,340,566	

(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。

【野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2020年12月28日現在)	第6期 (2021年12月27日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	128,894	179,691
親投資信託受益証券	23,038,068	30,024,981
流動資産合計	23,166,962	30,204,672
資産合計	23,166,962	30,204,672
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	5,829	7,941
未払委託者報酬	104,790	142,865
その他未払費用	269	405
流動負債合計	110,888	151,211
負債合計	110,888	151,211
純資産の部		
元本等		
元本	18,508,626	21,870,142
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,547,448	8,183,319
（分配準備積立金）	3,148,088	5,432,233
元本等合計	23,056,074	30,053,461
純資産合計	23,056,074	30,053,461
負債純資産合計	23,166,962	30,204,672

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自　2019年12月27日 至　2020年12月28日	第6期 自　2020年12月29日 至　2021年12月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,539,239	2,814,020
営業収益合計	1,539,239	2,814,020
営業費用		
支払利息	1	2
受託者報酬	10,876	15,015
委託者報酬	195,605	270,002
その他費用	499	786
営業費用合計	206,981	285,805
営業利益又は営業損失（△）	1,332,258	2,528,215
経常利益又は経常損失（△）	1,332,258	2,528,215
当期純利益又は当期純損失（△）	1,332,258	2,528,215
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（△）	△115,438	106,894
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,791,490	4,547,448
剰余金増加額又は欠損金減少額	508,226	1,457,366
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	508,226	1,457,366
剰余金減少額又は欠損金増加額	199,964	242,816
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	199,964	242,816
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	4,547,448	8,183,319

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
２.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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12月29日から2021年12月27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5期 2020年12月28日現在	第6期 2021年12月27日現在
１．　計算期間の末日における受益権の総数 18,508,626口	１．　計算期間の末日における受益権の総数 21,870,142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	２．　計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額
1口当たり純資産額　1.2457円	1口当たり純資産額　1.3742円
(10,000口当たり純資産額)　(12,457円)	(10,000口当たり純資産額)　(13,742円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期
自 2019年12月27日
至 2020年12月28日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	370,446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	1,077,250円
収益調整金額	C	1,950,671円
分配準備積立金額	D	1,700,392円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,098,759円
当ファンドの期末残存口数	F	18,508,626口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,754円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

第6期
自 2020年12月29日
至 2021年12月27日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	495,986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	1,925,335円
収益調整金額	C	3,025,834円
分配準備積立金額	D	3,010,912円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,458,067円
当ファンドの期末残存口数	F	21,870,142口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	3,867円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27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。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の２ 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、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。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制 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。	3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第5期 2020年12月28日現在	第6期 2021年12月27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。	１．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
２．時価の算定方法	２．時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日		第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27日	
期首元本額	16,100,646円	期首元本額	18,508,626円
期中追加設定元本額	3,607,259円	期中追加設定元本額	4,315,249円
期中一部解約元本額	1,199,279円	期中一部解約元本額	953,733円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2019年12月27日 至 2020年12月28日	第6期 自 2020年12月29日 至 2021年12月27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	1,631,304	2,379,091
合計	1,631,304	2,379,091

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12月27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12月27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	4,377,793	9,145,209	
		外国債券マザーファンド	1,119,781	2,882,428	
		外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド	1,147,391	5,238,413	
		国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド	2,758,515	3,669,928	
		新興国株式マザーファンド	2,389,996	3,821,842	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1,155,463	1,611,639	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	2,997,313	3,655,522	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：99.9%	15,946,252	30,024,981 100.0%	
合計				30,024,981	

(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）

「野村ターゲットデートファンド２０１６」の各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」および「新興国債券（現地通貨建て）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12月27日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,773,116,090
株式	418,121,205,870
派生商品評価勘定	110,169,517
未収入金	6,018,120

	(2021年12月27日現在)
未収配当金	22,402,810
未収利息	530,192
その他未収収益	6,607,271
差入委託証拠金	119,374,903
流動資産合計	431,159,424,773
資産合計	431,159,424,773
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,062,375
未払解約金	561,124,377
未払利息	6,253
有価証券貸借取引受入金	6,347,878,659
流動負債合計	6,912,071,664
負債合計	6,912,071,664
純資産の部	
元本等	
元本	203,088,871,279
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	221,158,481,830
元本等合計	424,247,353,109
純資産合計	424,247,353,109
負債純資産合計	431,159,424,773

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（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12月27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	2.0890円
(10,000口当たり純資産額)	(20,890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	
	6,000,738,840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12月29日 至 2021年12月27日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析･把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集･分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2021年12月27日現在
１．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２．時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年12月27日現在	
期首	2020年12月29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	233,420,305,440円
同期中における追加設定元本額	34,989,398,002円
同期中における一部解約元本額	65,320,832,163円
期末元本額	203,088,871,279円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	134,404,925円
バランスセレクト５０	306,987,495円
バランスセレクト７０	445,426,675円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,291,161,602円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	2,956,056,772円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	7,979,355,277円
野村資産設計ファンド２０１５	38,034,804円
野村資産設計ファンド２０２０	38,028,208円
野村資産設計ファンド２０２５	68,934,644円
野村資産設計ファンド２０３０	98,409,124円
野村資産設計ファンド２０３５	83,993,388円
野村資産設計ファンド２０４０	160,368,505円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	14,304,140,586円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,396,072,217円
のむラップ・ファンド（普通型）	11,660,488,146円
のむラップ・ファンド（積極型）	3,928,445,431円
野村資産設計ファンド２０４５	29,506,891円
野村インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	2,074,948,109円
マイ・ロード	3,338,582,496円
ネクストコア	17,716,835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	1,417,018,218円
野村ＴＯＰＩＸインデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	2,655,148,408円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,455,847,051円
野村資産設計ファンド２０５０	39,322,309円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型	12,670,623円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型	6,768,344円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型	5,284,655円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型	4,377,793円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	389,576,876円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	566,430,591円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	3,145,052円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,331,820円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	23,962,976円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	6,539,759円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	28,886,925円
野村６資産均等バランス	2,537,561,788円
世界６資産分散ファンド	79,178,408円

野村資産設計ファンド２０６０	25,571,854円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	1,385,201,925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）	298,801,683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）	144,459,380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）	458,747,633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）	391,780,811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）	2,872,101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）	8,289,771円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡ積極型（適格機関投資家専用）	1,135,765円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	2,378,397,997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）	6,047,310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）	62,538,217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）	62,263,227円
野村世界インデックス・バランス４０ＶＡ（適格機関投資家専用）	14,767,952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）	91,942,959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）	197,191,947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）	4,304,287,526円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	47,217,150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）	348,532,147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）	1,753,607,614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）	161,618,213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）	84,780,816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）	2,509,913円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	6,092,187円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	28,412,511円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	33,711,639円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	116,406,801円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	8,961,505,923円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	25,048,880,345円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	28,953,530,323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）	34,538,998,417円
マイバランスＤＣ３０	3,321,799,936円
マイバランスＤＣ５０	5,632,451,613円
マイバランスＤＣ７０	5,895,901,009円
野村ＤＣ国内株式インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	10,789,715,780円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	455,732,390円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	38,778,197円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	1,358,764,725円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	1,105,424,411円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	975,353,302円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	11,556,445円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	5,192,340円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	84,768,387円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	25,644,510円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	22,355,892円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	17,680,628円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	498,757,411円

マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	422,114,871円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	268,208,734円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	382,759,421円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	12,568,438円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	89,357,272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）	167,740,426円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	29,358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12月27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	7,300	3,035.00	22,155,500	
		日本水産	209,500	537.00	112,501,500	
		マルハニチロ	32,800	2,352.00	77,145,600	
		雪国まいたけ	15,300	1,111.00	16,998,300	貸付有価証券 200株
		カネコ種苗	6,300	1,455.00	9,166,500	
		サカタのタネ	25,000	3,280.00	82,000,000	貸付有価証券 100株
		ホクト	17,600	1,864.00	32,806,400	貸付有価証券 1,100株
		ホクリヨウ	2,800	691.00	1,934,800	貸付有価証券 200株
		住石ホールディングス	36,700	133.00	4,881,100	貸付有価証券 5,400株（2,200株）
		日鉄鉱業	4,800	6,430.00	30,864,000	
		三井松島ホールディングス	8,800	1,703.00	14,986,400	貸付有価証券 3,900株（300株）
		ＩＮＰＥＸ	840,600	1,010.00	849,006,000	
		石油資源開発	24,600	2,494.00	61,352,400	
		K&Oエナジーグループ	10,200	1,449.00	14,779,800	
		ヒノキヤグループ	4,600	2,244.00	10,322,400	
		ショーボンドホールディングス	29,900	5,140.00	153,686,000	貸付有価証券 6,500株

ミライト・ホールディングス	67,500	1,853.00	125,077,500	貸付有価証券 400株
タマホーム	12,700	2,280.00	28,956,000	貸付有価証券 5,900株（100株）
サンヨーホームズ	2,400	717.00	1,720,800	
日本アクア	8,300	677.00	5,619,100	
ファーストコーポレーション	6,400	707.00	4,524,800	貸付有価証券 200株
ベステラ	4,200	1,231.00	5,170,200	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	34,900	221.00	7,712,900	貸付有価証券 2,800株
キャンディル	3,600	482.00	1,735,200	貸付有価証券 1,500株
スペースバリューホールディングス	22,100	1,139.00	25,171,900	貸付有価証券 800株（700株）
ダイセキ環境ソリューション	4,000	1,589.00	6,356,000	
第一カッター興業	5,200	1,314.00	6,832,800	
安藤・間	115,200	851.00	98,035,200	貸付有価証券 47,000株
東急建設	61,400	661.00	40,585,400	貸付有価証券 2,900株
コムシスホールディングス	67,500	2,540.00	171,450,000	
ビーアールホールディングス	28,500	329.00	9,376,500	貸付有価証券 300株
高松コンストラクショングループ	13,000	1,937.00	25,181,000	
東建コーポレーション	6,500	9,100.00	59,150,000	
ソネック	2,200	987.00	2,171,400	貸付有価証券 1,000株
ヤマウラ	10,100	963.00	9,726,300	貸付有価証券 3,600株
オリエンタル白石	70,400	225.00	15,840,000	貸付有価証券 100株
大成建設	139,800	3,470.00	485,106,000	
大林組	483,900	881.00	426,315,900	
清水建設	453,300	710.00	321,843,000	貸付有価証券 2,000株
飛島建設	13,000	997.00	12,961,000	
長谷工コーポレーション	144,100	1,390.00	200,299,000	貸付有価証券

					9,700株
		松井建設	19,000	747.00	14,193,000	
		錢高組	2,100	3,880.00	8,148,000	
		鹿島建設	354,500	1,310.00	464,395,000	
		不動テトラ	10,300	1,641.00	16,902,300	
		大末建設	5,100	1,321.00	6,737,100	貸付有価証券 100株
		鉄建建設	10,500	1,722.00	18,081,000	
		西松建設	29,300	3,665.00	107,384,500	貸付有価証券 1,200株
		三井住友建設	109,100	419.00	45,712,900	
		大豊建設	7,100	3,845.00	27,299,500	貸付有価証券 3,300株
		佐田建設	10,400	466.00	4,846,400	
		ナカノフドー建設	11,600	333.00	3,862,800	
		奥村組	28,500	3,170.00	90,345,000	
		東鉄工業	22,500	2,477.00	55,732,500	
		イチケン	3,500	1,835.00	6,422,500	
		富士ピー・エス	6,200	478.00	2,963,600	貸付有価証券 2,900株
		淺沼組	5,400	5,310.00	28,674,000	
		戸田建設	200,900	716.00	143,844,400	
		熊谷組	24,700	2,825.00	69,777,500	
		北野建設	2,900	2,017.00	5,849,300	
		植木組	4,300	1,434.00	6,166,200	貸付有価証券 1,400株
		矢作建設工業	21,400	755.00	16,157,000	
		ピーエス三菱	15,900	601.00	9,555,900	
		日本ハウスホールディングス	33,000	475.00	15,675,000	貸付有価証券 300株
		大東建託	49,500	12,800.00	633,600,000	
		新日本建設	20,600	806.00	16,603,600	
		ＮＩＰＰＯ	40,000	3,990.00	159,600,000	貸付有価証券 10,400株（1,000株）
		東亜道路工業	2,500	4,805.00	12,012,500	
		日本道路	4,700	8,180.00	38,446,000	
		東亜建設工業	11,900	2,394.00	28,488,600	貸付有価証券 5,800株（5,300株）
		日本国土開発	47,100	550.00	25,905,000	

若築建設	8,100	1,820.00	14,742,000	
東洋建設	54,200	568.00	30,785,600	
五洋建設	191,800	633.00	121,409,400	貸付有価証券 5,000株
世紀東急工業	23,200	789.00	18,304,800	
福田組	5,200	4,220.00	21,944,000	貸付有価証券 2,400株
住友林業	123,800	2,246.00	278,054,800	貸付有価証券 29,900株
日本基礎技術	13,300	550.00	7,315,000	
巴コーポレーション	21,500	462.00	9,933,000	
大和ハウス工業	446,800	3,266.00	1,459,248,800	
ライト工業	30,500	1,944.00	59,292,000	
積水ハウス	524,800	2,440.50	1,280,774,400	
日特建設	10,000	634.00	6,340,000	
北陸電気工事	8,400	1,043.00	8,761,200	
ユアテック	27,700	650.00	18,005,000	
日本リーテック	10,100	1,542.00	15,574,200	
四電工	5,300	1,684.00	8,925,200	
中電工	22,300	2,094.00	46,696,200	
関電工	78,700	840.00	66,108,000	
きんでん	108,100	1,707.00	184,526,700	
東京エネシス	16,100	1,067.00	17,178,700	
トーエネック	4,900	3,270.00	16,023,000	
住友電設	11,900	2,051.00	24,406,900	
日本電設工業	26,500	1,636.00	43,354,000	
エクシオグループ	73,400	2,380.00	174,692,000	
新日本空調	12,800	2,331.00	29,836,800	
九電工	37,300	3,370.00	125,701,000	
三機工業	31,400	1,422.00	44,650,800	
日揮ホールディングス	149,100	940.00	140,154,000	
中外炉工業	4,900	1,570.00	7,693,000	
ヤマト	14,200	758.00	10,763,600	
太平電業	10,700	2,809.00	30,056,300	
高砂熱学工業	43,700	1,872.00	81,806,400	
三晃金属工業	1,900	2,299.00	4,368,100	
朝日工業社	3,300	3,135.00	10,345,500	

明星工業	31,300	742.00	23,224,600	
大氣社	23,500	3,095.00	72,732,500	
ダイダン	10,700	2,252.00	24,096,400	
日比谷総合設備	15,600	2,034.00	31,730,400	貸付有価証券 100株
フィル・カンパニー	2,800	2,259.00	6,325,200	
テスホールディングス	8,800	1,990.00	17,512,000	
インフロニア・ホールディングス	206,300	1,013.00	208,981,900	
レイズネクスト	23,400	1,163.00	27,214,200	
ニップン	45,300	1,620.00	73,386,000	
日清製粉グループ本社	175,000	1,659.00	290,325,000	
日東富士製粉	2,200	3,650.00	8,030,000	
昭和産業	14,700	2,609.00	38,352,300	
鳥越製粉	13,700	669.00	9,165,300	貸付有価証券 6,400株（400株）
中部飼料	17,500	958.00	16,765,000	
フィード・ワン	20,800	679.00	14,123,200	
東洋精糖	2,600	1,025.00	2,665,000	
日本甜菜製糖	8,100	1,668.00	13,510,800	
DM三井製糖ホールディングス	14,100	1,895.00	26,719,500	
塩水港精糖	18,400	209.00	3,845,600	
日新製糖	7,300	1,702.00	12,424,600	
森永製菓	36,300	3,685.00	133,765,500	
中村屋	3,700	3,595.00	13,301,500	
江崎グリコ	42,600	3,655.00	155,703,000	
名糖産業	6,800	1,645.00	11,186,000	
井村屋グループ	8,800	2,202.00	19,377,600	
不二家	8,600	2,292.00	19,711,200	貸付有価証券 4,000株
山崎製パン	116,100	1,531.00	177,749,100	貸付有価証券 900株
第一屋製パン	3,000	530.00	1,590,000	貸付有価証券 1,400株
モロゾフ	2,500	5,770.00	14,425,000	
亀田製菓	8,800	4,270.00	37,576,000	
寿スピリッツ	14,900	5,420.00	80,758,000	

カルビー	70,600	2,617.00	184,760,200	
森永乳業	28,700	5,360.00	153,832,000	
六甲バター	11,300	1,551.00	17,526,300	貸付有価証券 5,300株
ヤクルト本社	114,700	5,960.00	683,612,000	
明治ホールディングス	102,400	6,760.00	692,224,000	
雪印メグミルク	37,300	2,009.00	74,935,700	
プリマハム	19,400	2,460.00	47,724,000	貸付有価証券 100株
日本ハム	59,200	4,120.00	243,904,000	
林兼産業	4,700	499.00	2,345,300	
丸大食品	15,200	1,503.00	22,845,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	13,900	3,420.00	47,538,000	
柿安本店	5,400	2,752.00	14,860,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	99,700	640.00	63,808,000	
サッポロホールディングス	52,800	2,237.00	118,113,600	貸付有価証券 100株
アサヒグループホールディングス	364,300	4,524.00	1,648,093,200	
キリンホールディングス	569,200	1,881.50	1,070,949,800	貸付有価証券 50,500株
宝ホールディングス	105,200	1,211.00	127,397,200	
オエノンホールディングス	44,000	368.00	16,192,000	
養命酒製造	4,700	1,770.00	8,319,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールデ	108,700	1,353.00	147,071,100	貸付有価証券 300株
サントリー食品インターナショナル	103,600	4,235.00	438,746,000	
ダイドーグループホールディングス	7,900	4,725.00	37,327,500	貸付有価証券 700株
伊藤園	47,000	6,140.00	288,580,000	貸付有価証券 200株
キーコーヒー	15,200	1,985.00	30,172,000	
ユニカフェ	4,700	1,092.00	5,132,400	貸付有価証券 2,200株
ジャパンフーズ	2,200	1,204.00	2,648,800	
日清オイリオグループ	19,400	2,829.00	54,882,600	
不二製油グループ本社	33,600	2,282.00	76,675,200	

かどや製油	1,700	3,950.00	6,715,000	
Ｊ－オイルミルズ	14,400	1,635.00	23,544,000	
キッコーマン	111,500	9,460.00	1,054,790,000	
味の素	342,000	3,456.00	1,181,952,000	
ブルドックソース	6,500	2,065.00	13,422,500	
キユーピー	81,300	2,441.00	198,453,300	
ハウス食品グループ本社	57,900	2,868.00	166,057,200	
カゴメ	58,800	3,010.00	176,988,000	
焼津水産化学工業	7,500	908.00	6,810,000	
アリアケジャパン	14,100	6,210.00	87,561,000	
ピエトロ	2,000	1,750.00	3,500,000	貸付有価証券 900株
エバラ食品工業	3,400	2,630.00	8,942,000	
やまみ	1,700	1,826.00	3,104,200	
ニチレイ	73,800	2,643.00	195,053,400	
東洋水産	74,400	4,860.00	361,584,000	
イートアンドホールディングス	5,800	2,166.00	12,562,800	
大冷	1,700	1,908.00	3,243,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	601.00	4,808,000	貸付有価証券 600株
日清食品ホールディングス	60,800	8,380.00	509,504,000	
永谷園ホールディングス	6,900	1,910.00	13,179,000	貸付有価証券 100株
一正蒲鉾	6,000	787.00	4,722,000	
フジッコ	16,800	1,833.00	30,794,400	
ロック・フィールド	16,700	1,488.00	24,849,600	貸付有価証券 7,500株
日本たばこ産業	830,300	2,382.50	1,978,189,750	
ケンコーマヨネーズ	8,700	1,309.00	11,388,300	
わらべや日洋ホールディングス	10,100	2,042.00	20,624,200	
なとり	8,600	2,020.00	17,372,000	
イフジ産業	2,700	903.00	2,438,100	
ピックルスコーポレーション	7,400	1,874.00	13,867,600	
ファーマフーズ	14,600	2,050.00	29,930,000	貸付有価証券 6,300株（2,400株）

		ユーグレナ	78,900	710.00	56,019,000	貸付有価証券 37,000株（32,200株）
		紀文食品	9,000	922.00	8,298,000	貸付有価証券 100株
		ミヨシ油脂	5,900	1,271.00	7,498,900	貸付有価証券 2,700株
		理研ビタミン	16,100	1,690.00	27,209,000	
		片倉工業	16,900	2,487.00	42,030,300	貸付有価証券 300株
		グンゼ	10,200	4,030.00	41,106,000	
		東洋紡	59,700	1,231.00	73,490,700	
		ユニチカ	41,500	291.00	12,076,500	
		富士紡ホールディングス	6,700	3,990.00	26,733,000	
		倉敷紡績	12,900	1,933.00	24,935,700	
		シキボウ	7,900	885.00	6,991,500	
		日本毛織	45,600	900.00	41,040,000	貸付有価証券 2,100株
		ダイトウボウ	24,400	97.00	2,366,800	貸付有価証券 1,100株（1,000株）
		トーア紡コーポレーション	5,600	427.00	2,391,200	
		ダイドーリミテッド	19,900	141.00	2,805,900	貸付有価証券 9,100株
		帝国繊維	17,100	2,071.00	35,414,100	貸付有価証券 8,000株
		帝人	142,200	1,391.00	197,800,200	
		東レ	1,094,200	674.70	738,256,740	
		住江織物	3,300	1,494.00	4,930,200	
		日本フエルト	8,600	434.00	3,732,400	
		イチカワ	2,000	1,340.00	2,680,000	
		日東製網	1,600	1,383.00	2,212,800	
		アツギ	11,600	544.00	6,310,400	
		ダイニック	5,700	708.00	4,035,600	
		セーレン	31,000	2,441.00	75,671,000	貸付有価証券 7,000株（7,000株）
		ソトー	5,500	798.00	4,389,000	
		東海染工	1,700	1,137.00	1,932,900	
		小松マテーレ	24,800	1,248.00	30,950,400	
		ワコールホールディング	37,700	2,101.00	79,207,700	

		ス			
		ホギメディカル	20,400	3,240.00	66,096,000
		クラウディアホールディングス	3,700	236.00	873,200
		ＴＳＩホールディングス	50,500	332.00	16,766,000
		マツオカコーポレーション	4,800	1,141.00	5,476,800
		ワールド	19,800	1,136.00	22,492,800
		三陽商会	7,300	880.00	6,424,000
		ナイガイ	5,100	294.00	1,499,400
		オンワードホールディングス	90,800	294.00	26,695,200 貸付有価証券 5,000株
		ルックホールディングス	4,800	1,194.00	5,731,200 貸付有価証券 2,200株
		ゴールドウイン	27,300	6,610.00	180,453,000
		デサント	29,500	4,170.00	123,015,000 貸付有価証券 600株
		キング	7,100	541.00	3,841,100
		ヤマトインターナショナル	13,300	287.00	3,817,100 貸付有価証券 2,800株
		特種東海製紙	9,300	4,035.00	37,525,500
		王子ホールディングス	631,700	546.00	344,908,200
		日本製紙	72,400	1,059.00	76,671,600 貸付有価証券 1,800株
		三菱製紙	21,400	312.00	6,676,800
		北越コーポレーション	99,100	701.00	69,469,100 貸付有価証券 31,400株
		中越パルプ工業	5,800	937.00	5,434,600
		巴川製紙所	4,500	804.00	3,618,000
		大王製紙	72,900	1,842.00	134,281,800
		阿波製紙	3,900	326.00	1,271,400
		レンゴー	142,800	842.00	120,237,600
		トーモク	9,300	1,716.00	15,958,800 貸付有価証券 600株
		ザ・パック	11,400	2,728.00	31,099,200 貸付有価証券 5,300株
		北の達人コーポレーション	54,100	324.00	17,528,400 貸付有価証券 24,500株（11,000株）
		クラレ	221,000	1,003.00	221,663,000 貸付有価証券 200株

旭化成	1,001,600	1,070.00	1,071,712,000	
共和レザー	9,400	627.00	5,893,800	
昭和電工	131,100	2,453.00	321,588,300	貸付有価証券 9,300株
住友化学	1,110,200	537.00	596,177,400	
住友精化	6,700	3,035.00	20,334,500	
日産化学	82,200	6,710.00	551,562,000	
ラサ工業	5,300	1,621.00	8,591,300	
クレハ	12,000	8,010.00	96,120,000	
多木化学	5,900	5,620.00	33,158,000	貸付有価証券 2,700株（900株）
テイカ	11,100	1,248.00	13,852,800	
石原産業	25,100	1,154.00	28,965,400	
片倉コープアグリ	3,400	1,114.00	3,787,600	
日本曹達	19,300	3,280.00	63,304,000	
東ソー	218,000	1,676.00	365,368,000	
トクヤマ	48,300	1,767.00	85,346,100	
セントラル硝子	24,700	2,131.00	52,635,700	
東亞合成	86,000	1,165.00	100,190,000	
大阪ソーダ	14,100	2,935.00	41,383,500	
関東電化工業	33,100	1,082.00	35,814,200	
デンカ	55,100	3,680.00	202,768,000	
信越化学工業	259,500	19,740.00	5,122,530,000	
日本カーバイド工業	5,300	1,281.00	6,789,300	
堺化学工業	10,600	2,221.00	23,542,600	貸付有価証券 3,500株
第一稀元素化学工業	14,000	1,224.00	17,136,000	
エア・ウォーター	143,100	1,743.00	249,423,300	
日本酸素ホールディングス	145,200	2,487.00	361,112,400	貸付有価証券 1,700株
日本化学工業	4,700	2,616.00	12,295,200	
東邦アセチレン	2,500	1,219.00	3,047,500	貸付有価証券 200株
日本パーカライジング	76,200	1,101.00	83,896,200	貸付有価証券 100株
高圧ガス工業	24,000	763.00	18,312,000	
チタン工業	1,700	1,613.00	2,742,100	
四国化成工業	19,700	1,384.00	27,264,800	

戸田工業	3,200	4,125.00	13,200,000	
ステラ　ケミファ	7,600	2,524.00	19,182,400	
保土谷化学工業	4,800	5,780.00	27,744,000	
日本触媒	25,400	5,240.00	133,096,000	
大日精化工業	12,500	2,273.00	28,412,500	
カネカ	39,100	3,740.00	146,234,000	
三菱瓦斯化学	140,600	1,911.00	268,686,600	
三井化学	137,300	3,075.00	422,197,500	
ＪＳＲ	140,800	4,410.00	620,928,000	
東京応化工業	25,900	6,790.00	175,861,000	
大阪有機化学工業	12,900	3,375.00	43,537,500	
三菱ケミカルホールディングス	1,010,200	840.20	848,770,040	貸付有価証券 1,500株
ＫＨネオケム	24,900	3,050.00	75,945,000	
ダイセル	217,700	780.00	169,806,000	
住友ベークライト	23,800	5,680.00	135,184,000	
積水化学工業	316,200	1,935.00	611,847,000	
日本ゼオン	136,300	1,257.00	171,329,100	
アイカ工業	42,100	3,365.00	141,666,500	
宇部興産	71,200	1,971.00	140,335,200	
積水樹脂	22,800	2,076.00	47,332,800	
タキロンシーアイ	32,700	545.00	17,821,500	
旭有機材	8,500	1,663.00	14,135,500	
ニチバン	8,900	1,804.00	16,055,600	貸付有価証券 500株
リケンテクノス	36,900	504.00	18,597,600	貸付有価証券 100株
大倉工業	7,700	2,228.00	17,155,600	貸付有価証券 3,600株
積水化成品工業	20,300	466.00	9,459,800	
群栄化学工業	3,400	3,570.00	12,138,000	
タイガースポリマー	7,900	439.00	3,468,100	
ミライアル	4,800	1,849.00	8,875,200	
ダイキアクシス	5,900	843.00	4,973,700	貸付有価証券 2,700株
ダイキョーニシカワ	31,900	569.00	18,151,100	
竹本容器	5,400	829.00	4,476,600	
森六ホールディングス	8,100	1,753.00	14,199,300	

恵和	4,100	5,360.00	21,976,000	貸付有価証券 300株（300株）
日本化薬	119,000	1,158.00	137,802,000	貸付有価証券 1,000株
カーリットホールディングス	15,000	678.00	10,170,000	
日本精化	12,200	2,305.00	28,121,000	
扶桑化学工業	13,600	4,835.00	65,756,000	
トリケミカル研究所	15,600	3,620.00	56,472,000	
ＡＤＥＫＡ	69,600	2,497.00	173,791,200	貸付有価証券 1,500株
日油	51,600	5,660.00	292,056,000	
新日本理化	25,000	258.00	6,450,000	貸付有価証券 2,400株
ハリマ化成グループ	11,200	808.00	9,049,600	
花王	341,300	6,070.00	2,071,691,000	
第一工業製薬	5,600	3,075.00	17,220,000	
石原ケミカル	7,600	1,368.00	10,396,800	
日華化学	5,100	818.00	4,171,800	貸付有価証券 2,300株
ニイタカ	3,100	2,058.00	6,379,800	
三洋化成工業	9,000	5,230.00	47,070,000	
有機合成薬品工業	10,500	261.00	2,740,500	貸付有価証券 200株
大日本塗料	18,500	813.00	15,040,500	
日本ペイントホールディングス	567,800	1,187.00	673,978,600	
関西ペイント	156,700	2,476.00	387,989,200	
神東塗料	11,900	169.00	2,011,100	
中国塗料	35,600	923.00	32,858,800	貸付有価証券 200株
日本特殊塗料	11,300	848.00	9,582,400	
藤倉化成	18,800	481.00	9,042,800	
太陽ホールディングス	22,300	3,350.00	74,705,000	
ＤＩＣ	63,800	2,909.00	185,594,200	
サカタインクス	30,000	997.00	29,910,000	貸付有価証券 14,100株
東洋インキＳＣホールディングス	31,900	1,966.00	62,715,400	

T&K　TOKA	12,200	821.00	10,016,200	
富士フイルムホールディングス	271,200	8,452.00	2,292,182,400	
資生堂	287,400	6,406.00	1,841,084,400	
ライオン	186,300	1,549.00	288,578,700	貸付有価証券 100株
高砂香料工業	10,600	2,800.00	29,680,000	
マンダム	32,400	1,404.00	45,489,600	
ミルボン	19,000	5,640.00	107,160,000	貸付有価証券 8,900株
ファンケル	62,400	3,400.00	212,160,000	貸付有価証券 1,000株
コーセー	29,000	13,070.00	379,030,000	
コタ	9,800	1,618.00	15,856,400	
シーボン	2,000	1,645.00	3,290,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	65,900	1,966.00	129,559,400	貸付有価証券 400株
ノエビアホールディングス	13,100	5,380.00	70,478,000	
アジュバンホールディングス	3,400	1,116.00	3,794,400	
新日本製薬	4,200	1,135.00	4,767,000	貸付有価証券 500株
エステー	9,900	1,475.00	14,602,500	貸付有価証券 100株
アグロ　カネショウ	5,100	1,260.00	6,426,000	貸付有価証券 2,300株
コニシ	25,400	1,737.00	44,119,800	
長谷川香料	26,600	2,701.00	71,846,600	
星光ＰＭＣ	8,700	693.00	6,029,100	
小林製薬	43,200	9,070.00	391,824,000	貸付有価証券 200株
荒川化学工業	12,900	1,167.00	15,054,300	
メック	11,500	3,925.00	45,137,500	貸付有価証券 5,400株
日本高純度化学	4,200	2,470.00	10,374,000	
タカラバイオ	40,400	2,608.00	105,363,200	
ＪＣＵ	17,400	5,230.00	91,002,000	
新田ゼラチン	9,700	593.00	5,752,100	
ＯＡＴアグリオ	3,200	1,919.00	6,140,800	貸付有価証券

				1,500株
デクセリアルズ	40,100	4,110.00	164,811,000	
アース製薬	12,700	6,240.00	79,248,000	
北興化学工業	14,400	895.00	12,888,000	
大成ラミック	4,700	2,734.00	12,849,800	
クミアイ化学工業	57,400	766.00	43,968,400	
日本農薬	27,500	481.00	13,227,500	
アキレス	9,900	1,219.00	12,068,100	
有沢製作所	22,500	964.00	21,690,000	
日東電工	93,300	8,840.00	824,772,000	
レック	20,100	837.00	16,823,700	
三光合成	16,200	377.00	6,107,400	貸付有価証券 200株
きもと	23,600	216.00	5,097,600	
藤森工業	13,800	3,975.00	54,855,000	
前澤化成工業	9,800	1,289.00	12,632,200	貸付有価証券 4,600株（100株）
未来工業	5,500	1,550.00	8,525,000	
ウェーブロックホールディングス	5,900	707.00	4,171,300	貸付有価証券 100株
ＪＳＰ	9,000	1,608.00	14,472,000	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	28,400	3,850.00	109,340,000	
天馬	12,100	2,582.00	31,242,200	
信越ポリマー	27,700	1,085.00	30,054,500	
東リ	38,400	211.00	8,102,400	
ニフコ	51,500	3,520.00	181,280,000	
バルカー	12,500	2,587.00	32,337,500	
ユニ・チャーム	297,400	4,962.00	1,475,698,800	
ショーエイコーポレーション	4,100	630.00	2,583,000	貸付有価証券 200株（200株）
協和キリン	181,100	3,185.00	576,803,500	
武田薬品工業	1,212,700	3,137.00	3,804,239,900	
アステラス製薬	1,337,800	1,823.50	2,439,478,300	
大日本住友製薬	95,300	1,360.00	129,608,000	
塩野義製薬	194,000	8,161.00	1,583,234,000	
わかもと製薬	18,400	303.00	5,575,200	貸付有価証券 900株

日本新薬	40,400	8,120.00	328,048,000	
中外製薬	482,600	3,747.00	1,808,302,200	貸付有価証券 600株
科研製薬	24,200	4,185.00	101,277,000	
エーザイ	184,700	6,666.00	1,231,210,200	
ロート製薬	79,200	3,465.00	274,428,000	
小野薬品工業	354,300	2,805.50	993,988,650	
久光製薬	40,800	4,075.00	166,260,000	貸付有価証券 2,700株
持田製薬	19,500	3,410.00	66,495,000	
参天製薬	287,700	1,402.00	403,355,400	
扶桑薬品工業	5,400	2,492.00	13,456,800	
日本ケミファ	1,800	2,004.00	3,607,200	
ツムラ	47,800	3,290.00	157,262,000	
日医工	47,900	667.00	31,949,300	貸付有価証券 6,100株
キッセイ薬品工業	27,300	2,243.00	61,233,900	
生化学工業	27,200	928.00	25,241,600	
栄研化学	27,100	1,883.00	51,029,300	
日水製薬	5,700	1,024.00	5,836,800	貸付有価証券 200株
鳥居薬品	8,300	2,819.00	23,397,700	
ＪＣＲファーマ	43,500	2,177.00	94,699,500	貸付有価証券 400株
東和薬品	22,200	2,736.00	60,739,200	
富士製薬工業	9,500	992.00	9,424,000	
ゼリア新薬工業	28,000	1,951.00	54,628,000	貸付有価証券 900株
第一三共	1,212,500	2,930.50	3,553,231,250	
キョーリン製薬ホールディングス	30,900	1,823.00	56,330,700	
大幸薬品	23,300	694.00	16,170,200	貸付有価証券 10,900株（500株）
ダイト	9,900	2,866.00	28,373,400	
大塚ホールディングス	320,700	4,245.00	1,361,371,500	
大正製薬ホールディングス	36,700	5,240.00	192,308,000	
ペプチドリーム	81,000	2,674.00	216,594,000	貸付有価証券 300株

あすか製薬ホールディングス	17,600	1,012.00	17,811,200	
サワイグループホールディングス	33,800	4,270.00	144,326,000	貸付有価証券 900株
日本コークス工業	130,400	125.00	16,300,000	
ニチレキ	19,700	1,386.00	27,304,200	
ユシロ化学工業	8,000	1,085.00	8,680,000	
ビーピー・カストロール	5,500	1,402.00	7,711,000	
富士石油	41,200	251.00	10,341,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,100	1,135.00	5,788,500	
出光興産	171,200	2,921.00	500,075,200	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,321,200	429.40	996,723,280	
コスモエネルギーホールディングス	44,700	2,199.00	98,295,300	貸付有価証券 100株
横浜ゴム	89,300	1,844.00	164,669,200	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	81,200	1,761.00	142,993,200	
ブリヂストン	444,500	5,030.00	2,235,835,000	貸付有価証券 45,800株
住友ゴム工業	138,600	1,202.00	166,597,200	貸付有価証券 5,600株
藤倉コンポジット	12,400	875.00	10,850,000	
オカモト	9,100	4,120.00	37,492,000	
フコク	6,700	964.00	6,458,800	貸付有価証券 100株
ニッタ	16,000	2,889.00	46,224,000	
住友理工	29,900	590.00	17,641,000	
三ツ星ベルト	18,700	2,124.00	39,718,800	貸付有価証券 500株
バンドー化学	24,900	875.00	21,787,500	貸付有価証券 100株
日東紡績	23,000	2,916.00	67,068,000	
ＡＧＣ	141,600	5,600.00	792,960,000	
日本板硝子	74,100	504.00	37,346,400	
石塚硝子	2,600	1,973.00	5,129,800	
日本山村硝子	5,900	767.00	4,525,300	
日本電気硝子	62,000	3,010.00	186,620,000	
オハラ	6,100	1,216.00	7,417,600	貸付有価証券 600株

		住友大阪セメント	28,500	3,580.00	102,030,000	
		太平洋セメント	87,700	2,256.00	197,851,200	
		日本ヒューム	15,500	685.00	10,617,500	
		日本コンクリート工業	30,400	267.00	8,116,800	
		三谷セキサン	7,200	7,540.00	54,288,000	貸付有価証券 3,300株
		アジアパイルホールディングス	23,700	431.00	10,214,700	
		東海カーボン	129,300	1,206.00	155,935,800	貸付有価証券 200株
		日本カーボン	7,900	4,300.00	33,970,000	
		東洋炭素	10,100	3,305.00	33,380,500	貸付有価証券 200株
		ノリタケカンパニーリミテド	8,500	4,840.00	41,140,000	
		ＴＯＴＯ	110,200	5,280.00	581,856,000	貸付有価証券 800株
		日本碍子	167,200	1,932.00	323,030,400	貸付有価証券 100株
		日本特殊陶業	117,400	1,965.00	230,691,000	
		ダントーホールディングス	10,100	224.00	2,262,400	貸付有価証券 6,300株
		ＭＡＲＵＷＡ	5,300	16,410.00	86,973,000	
		品川リフラクトリーズ	3,600	3,740.00	13,464,000	
		黒崎播磨	2,600	4,110.00	10,686,000	
		ヨータイ	9,800	1,248.00	12,230,400	
		イソライト工業	6,800	1,196.00	8,132,800	貸付有価証券 300株（300株）
		東京窯業	19,600	304.00	5,958,400	
		ニッカトー	7,000	683.00	4,781,000	
		フジミインコーポレーテッド	12,400	7,580.00	93,992,000	
		クニミネ工業	4,800	1,018.00	4,886,400	
		エーアンドエーマテリアル	2,600	887.00	2,306,200	
		ニチアス	35,700	2,726.00	97,318,200	
		ニチハ	21,500	2,927.00	62,930,500	
		日本製鉄	682,900	1,854.00	1,266,096,600	貸付有価証券 6,000株
		神戸製鋼所	284,800	564.00	160,627,200	貸付有価証券

				1,300株
中山製鋼所	24,200	417.00	10,091,400	
合同製鐵	8,200	1,343.00	11,012,600	貸付有価証券 100株
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	412,100	1,450.00	597,545,000	
東京製鐵	52,000	1,366.00	71,032,000	貸付有価証券 500株
共英製鋼	17,200	1,373.00	23,615,600	
大和工業	29,200	3,630.00	105,996,000	
東京鐵鋼	6,700	1,266.00	8,482,200	
大阪製鐵	8,100	1,083.00	8,772,300	
淀川製鋼所	20,000	2,477.00	49,540,000	貸付有価証券 100株
丸一鋼管	54,000	2,507.00	135,378,000	貸付有価証券 100株
モリ工業	4,500	2,640.00	11,880,000	
大同特殊鋼	25,000	4,075.00	101,875,000	
日本高周波鋼業	5,600	320.00	1,792,000	
日本冶金工業	11,100	2,201.00	24,431,100	
山陽特殊製鋼	15,700	1,997.00	31,352,900	
愛知製鋼	8,600	2,408.00	20,708,800	
日立金属	164,400	2,131.00	350,336,400	
日本金属	3,900	982.00	3,829,800	
大平洋金属	9,400	2,102.00	19,758,800	
新日本電工	98,500	288.00	28,368,000	貸付有価証券 2,300株
栗本鐵工所	6,900	1,515.00	10,453,500	
虹技	2,100	953.00	2,001,300	
日本鋳鉄管	1,600	1,009.00	1,614,400	
三菱製鋼	9,800	1,012.00	9,917,600	
日亜鋼業	19,800	266.00	5,266,800	貸付有価証券 200株
日本精線	2,500	4,900.00	12,250,000	貸付有価証券 1,100株（400株）
エンビプロ・ホールディングス	6,500	1,783.00	11,589,500	貸付有価証券 2,900株（2,300株）
シンニッタン	18,400	224.00	4,121,600	
新家工業	3,800	1,602.00	6,087,600	

大紀アルミニウム工業所	23,000	1,566.00	36,018,000	
日本軽金属ホールディングス	38,600	1,691.00	65,272,600	
三井金属鉱業	41,200	3,050.00	125,660,000	貸付有価証券 2,600株
東邦亜鉛	8,500	2,248.00	19,108,000	貸付有価証券 200株
三菱マテリアル	100,800	1,922.00	193,737,600	
住友金属鉱山	195,000	4,300.00	838,500,000	貸付有価証券 300株
ＤＯＷＡホールディングス	41,600	4,650.00	193,440,000	
古河機械金属	25,200	1,254.00	31,600,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17,600	778.00	13,692,800	
東邦チタニウム	27,300	927.00	25,307,100	
ＵＡＣＪ	23,200	2,606.00	60,459,200	
ＣＫサンエツ	3,200	3,790.00	12,128,000	
古河電気工業	47,400	2,257.00	106,981,800	
住友電気工業	570,500	1,476.00	842,058,000	
フジクラ	170,100	555.00	94,405,500	貸付有価証券 2,100株
昭和電線ホールディングス	13,300	1,634.00	21,732,200	
東京特殊電線	2,300	2,873.00	6,607,900	
タツタ電線	26,900	461.00	12,400,900	
カナレ電気	2,300	1,726.00	3,969,800	貸付有価証券 1,000株
平河ヒューテック	8,400	1,211.00	10,172,400	
リョービ	18,800	1,053.00	19,796,400	貸付有価証券 100株
アーレスティ	16,200	374.00	6,058,800	
アサヒホールディングス	61,100	2,014.00	123,055,400	貸付有価証券 6,000株
稲葉製作所	8,600	1,323.00	11,377,800	貸付有価証券 300株
宮地エンジニアリンググループ	4,600	3,200.00	14,720,000	
トーカロ	39,400	1,450.00	57,130,000	
アルファＣｏ	5,900	1,086.00	6,407,400	

ＳＵＭＣＯ	234,800	2,361.00	554,362,800	貸付有価証券 54,600株
川田テクノロジーズ	3,100	3,955.00	12,260,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,000	6,220.00	31,100,000	
ジェイテックコーポレーション	1,700	1,685.00	2,864,500	貸付有価証券 700株（400株）
信和	9,500	822.00	7,809,000	
東洋製罐グループホールディングス	97,200	1,356.00	131,803,200	貸付有価証券 5,300株
ホッカンホールディングス	8,400	1,414.00	11,877,600	
コロナ	8,400	883.00	7,417,200	
横河ブリッジホールディングス	26,200	2,162.00	56,644,400	
駒井ハルテック	2,900	2,327.00	6,748,300	
高田機工	1,400	2,816.00	3,942,400	貸付有価証券 600株
三和ホールディングス	143,900	1,217.00	175,126,300	
文化シヤッター	48,400	1,028.00	49,755,200	貸付有価証券 11,000株（10,800株）
三協立山	19,700	719.00	14,164,300	
アルインコ	11,100	968.00	10,744,800	
東洋シヤッター	3,400	557.00	1,893,800	
ＬＩＸＩＬ	240,100	3,070.00	737,107,000	貸付有価証券 1,600株
日本フイルコン	10,600	539.00	5,713,400	
ノーリツ	29,200	1,730.00	50,516,000	
長府製作所	15,500	2,050.00	31,775,000	貸付有価証券 7,200株
リンナイ	28,800	10,330.00	297,504,000	
ダイニチ工業	7,300	750.00	5,475,000	
日東精工	19,200	652.00	12,518,400	
三洋工業	1,900	1,743.00	3,311,700	
岡部	30,900	723.00	22,340,700	貸付有価証券 200株
ジーテクト	18,900	1,395.00	26,365,500	
東プレ	28,500	1,150.00	32,775,000	
高周波熱錬	27,300	572.00	15,615,600	

東京製綱	9,400	823.00	7,736,200	
サンコール	13,100	554.00	7,257,400	
モリテック　スチール	11,900	351.00	4,176,900	貸付有価証券 100株
パイオラックス	22,600	1,722.00	38,917,200	
エイチワン	15,000	652.00	9,780,000	
日本発條	140,300	983.00	137,914,900	貸付有価証券 100株
中央発條	7,300	823.00	6,007,900	
アドバネクス	2,000	1,294.00	2,588,000	
立川ブラインド工業	6,700	1,105.00	7,403,500	貸付有価証券 3,100株
三益半導体工業	11,900	2,527.00	30,071,300	
日本ドライケミカル	3,800	1,933.00	7,345,400	貸付有価証券 1,600株
日本製鋼所	46,300	3,735.00	172,930,500	
三浦工業	66,000	3,930.00	259,380,000	
タクマ	51,700	1,415.00	73,155,500	
ツガミ	33,500	1,650.00	55,275,000	貸付有価証券 1,100株
オークマ	17,800	5,080.00	90,424,000	
芝浦機械	17,200	3,660.00	62,952,000	
アマダ	240,800	1,114.00	268,251,200	
アイダエンジニアリング	39,900	1,021.00	40,737,900	
滝澤鉄工所	4,400	1,136.00	4,998,400	
ＦＵＪＩ	70,300	2,526.00	177,577,800	貸付有価証券 400株
牧野フライス製作所	16,700	3,980.00	66,466,000	
オーエスジー	70,600	1,744.00	123,126,400	貸付有価証券 1,300株
ダイジェット工業	1,700	958.00	1,628,600	
旭ダイヤモンド工業	40,000	639.00	25,560,000	
DMG森精機	90,500	1,934.00	175,027,000	
ソディック	33,800	812.00	27,445,600	
ディスコ	22,500	34,800.00	783,000,000	
日東工器	8,400	1,796.00	15,086,400	
日進工具	12,000	1,582.00	18,984,000	
パンチ工業	12,700	535.00	6,794,500	

冨士ダイス	7,700	624.00	4,804,800	
豊和工業	7,800	758.00	5,912,400	
ＯＫＫ	5,900	925.00	5,457,500	貸付有価証券 1,000株
東洋機械金属	9,900	521.00	5,157,900	
津田駒工業	2,900	634.00	1,838,600	
エンシュウ	3,300	588.00	1,940,400	
島精機製作所	22,300	1,963.00	43,774,900	貸付有価証券 100株
オプトラン	19,100	2,404.00	45,916,400	
ＮＣホールディングス	4,300	1,622.00	6,974,600	
イワキポンプ	9,700	1,056.00	10,243,200	
フリュー	13,600	1,366.00	18,577,600	
ヤマシンフィルタ	30,800	492.00	15,153,600	貸付有価証券 6,500株
日阪製作所	18,800	834.00	15,679,200	
やまびこ	29,600	1,264.00	37,414,400	
野村マイクロ・サイエンス	4,000	5,080.00	20,320,000	貸付有価証券 1,500株
平田機工	7,200	6,090.00	43,848,000	
ペガサスミシン製造	15,500	505.00	7,827,500	貸付有価証券 100株
マルマエ	6,300	3,215.00	20,254,500	
タツモ	7,100	1,527.00	10,841,700	
ナブテスコ	87,000	3,350.00	291,450,000	
三井海洋開発	16,200	1,369.00	22,177,800	
レオン自動機	16,300	1,309.00	21,336,700	
ＳＭＣ	45,200	76,570.00	3,460,964,000	
ホソカワミクロン	10,700	3,255.00	34,828,500	
ユニオンツール	5,700	3,860.00	22,002,000	
オイレス工業	21,400	1,678.00	35,909,200	貸付有価証券 1,800株
日精エー・エス・ビー機械	5,100	2,991.00	15,254,100	
サトーホールディングス	20,100	2,150.00	43,215,000	
技研製作所	13,500	4,000.00	54,000,000	貸付有価証券 200株
日本エアーテック	7,000	1,254.00	8,778,000	貸付有価証券 3,200株（500株）

カワタ	4,800	984.00	4,723,200	貸付有価証券 400株（400株）
日精樹脂工業	10,700	1,011.00	10,817,700	
オカダアイヨン	4,800	1,522.00	7,305,600	
ワイエイシイホールディングス	6,100	980.00	5,978,000	
小松製作所	699,300	2,660.00	1,860,138,000	
住友重機械工業	88,300	2,748.00	242,648,400	
日立建機	61,800	3,295.00	203,631,000	
日工	21,100	614.00	12,955,400	
巴工業	6,100	2,235.00	13,633,500	貸付有価証券 1,600株
井関農機	14,300	1,371.00	19,605,300	
ＴＯＷＡ	13,200	3,325.00	43,890,000	貸付有価証券 300株
丸山製作所	3,100	1,579.00	4,894,900	
北川鉄工所	6,900	1,449.00	9,998,100	
ローツェ	7,600	12,240.00	93,024,000	
タカキタ	5,400	650.00	3,510,000	貸付有価証券 2,500株
クボタ	752,600	2,531.00	1,904,830,600	
荏原実業	7,100	2,517.00	17,870,700	
三菱化工機	4,900	2,077.00	10,177,300	
月島機械	28,400	1,098.00	31,183,200	
帝国電機製作所	10,800	1,489.00	16,081,200	
東京機械製作所	6,300	1,061.00	6,684,300	貸付有価証券 300株
新東工業	34,000	695.00	23,630,000	貸付有価証券 100株
澁谷工業	13,500	2,865.00	38,677,500	
アイチ　コーポレーション	22,500	792.00	17,820,000	
小森コーポレーション	39,100	688.00	26,900,800	貸付有価証券 100株
鶴見製作所	11,900	1,647.00	19,599,300	
住友精密工業	2,300	2,029.00	4,666,700	
日本ギア工業	5,500	256.00	1,408,000	
酒井重工業	2,700	2,788.00	7,527,600	
荏原製作所	64,100	6,450.00	413,445,000	

石井鐵工所	2,200	2,998.00	6,595,600	
酉島製作所	13,900	928.00	12,899,200	
北越工業	14,500	970.00	14,065,000	
ダイキン工業	196,600	25,750.00	5,062,450,000	貸付有価証券 100株
オルガノ	4,400	7,830.00	34,452,000	
トーヨーカネツ	5,800	2,453.00	14,227,400	
栗田工業	83,500	5,290.00	441,715,000	貸付有価証券 400株
椿本チエイン	20,200	3,075.00	62,115,000	
大同工業	6,800	952.00	6,473,600	
木村化工機	12,800	856.00	10,956,800	
アネスト岩田	24,000	878.00	21,072,000	
ダイフク	84,900	9,520.00	808,248,000	貸付有価証券 500株
サムコ	3,900	2,760.00	10,764,000	貸付有価証券 1,600株（400株）
加藤製作所	7,300	792.00	5,781,600	
油研工業	2,600	1,670.00	4,342,000	
タダノ	80,600	1,059.00	85,355,400	貸付有価証券 200株
フジテック	57,200	2,470.00	141,284,000	
ＣＫＤ	45,500	2,320.00	105,560,000	貸付有価証券 400株
キトー	13,100	1,882.00	24,654,200	
平和	43,000	1,876.00	80,668,000	
理想科学工業	12,900	2,111.00	27,231,900	貸付有価証券 100株
ＳＡＮＫＹＯ	33,300	2,966.00	98,767,800	
日本金銭機械	15,600	667.00	10,405,200	
マースグループホールディングス	9,800	1,641.00	16,081,800	貸付有価証券 100株
フクシマガリレイ	10,600	4,580.00	48,548,000	
オーイズミ	5,400	370.00	1,998,000	
ダイコク電機	7,100	1,178.00	8,363,800	貸付有価証券 2,600株
竹内製作所	23,500	2,670.00	62,745,000	
アマノ	40,400	2,620.00	105,848,000	
ＪＵＫＩ	21,500	855.00	18,382,500	

		ジャノメ	13,100	669.00	8,763,900	貸付有価証券 1,900株
		マックス	20,500	1,882.00	38,581,000	
		グローリー	39,600	2,168.00	85,852,800	
		新晃工業	14,300	1,933.00	27,641,900	
		大和冷機工業	22,300	1,252.00	27,919,600	
		セガサミーホールディングス	153,000	1,816.00	277,848,000	貸付有価証券 400株
		日本ピストンリング	5,600	1,253.00	7,016,800	
		リケン	6,600	2,499.00	16,493,400	
		ＴＰＲ	20,800	1,393.00	28,974,400	
		ツバキ・ナカシマ	33,800	1,455.00	49,179,000	
		ホシザキ	45,100	8,620.00	388,762,000	
		大豊工業	12,600	790.00	9,954,000	
		日本精工	290,500	730.00	212,065,000	貸付有価証券 700株
		ＮＴＮ	331,600	235.00	77,926,000	
		ジェイテクト	148,000	1,003.00	148,444,000	
		不二越	13,100	4,030.00	52,793,000	貸付有価証券 200株
		日本トムソン	42,300	679.00	28,721,700	
		ＴＨＫ	89,800	2,820.00	253,236,000	貸付有価証券 100株
		ユーシン精機	12,000	732.00	8,784,000	
		前澤給装工業	11,600	1,036.00	12,017,600	
		イーグル工業	19,100	1,071.00	20,456,100	
		前澤工業	9,200	595.00	5,474,000	
		日本ピラー工業	15,600	3,540.00	55,224,000	貸付有価証券 400株
		キッツ	52,000	707.00	36,764,000	貸付有価証券 300株
		マキタ	187,800	4,869.00	914,398,200	
		三井Ｅ＆Ｓホールディングス	55,700	378.00	21,054,600	貸付有価証券 18,700株
		日立造船	130,500	787.00	102,703,500	貸付有価証券 800株
		三菱重工業	242,400	2,641.50	640,299,600	
		ＩＨＩ	96,300	2,287.00	220,238,100	
		サノヤスホールディング	19,000	122.00	2,318,000	貸付有価証券

		ス			700株（500株）
		スター精密	23,800	1,570.00	37,366,000	
		日清紡ホールディングス	94,300	894.00	84,304,200	貸付有価証券 1,200株
		イビデン	81,000	6,830.00	553,230,000	貸付有価証券 200株
		コニカミノルタ	337,100	519.00	174,954,900	
		ブラザー工業	188,400	2,192.00	412,972,800	貸付有価証券 300株
		ミネベアミツミ	266,000	3,200.00	851,200,000	
		日立製作所	742,100	6,104.00	4,529,778,400	
		東芝	269,700	4,564.00	1,230,910,800	貸付有価証券 200株
		三菱電機	1,542,900	1,461.00	2,254,176,900	
		富士電機	93,000	6,150.00	571,950,000	
		東洋電機製造	6,100	1,020.00	6,222,000	貸付有価証券 100株
		安川電機	166,100	5,770.00	958,397,000	貸付有価証券 1,000株
		シンフォニアテクノロジー	18,600	1,286.00	23,919,600	
		明電舎	26,200	2,655.00	69,561,000	
		オリジン	3,900	1,237.00	4,824,300	
		山洋電気	6,800	5,810.00	39,508,000	
		デンヨー	13,100	1,791.00	23,462,100	
		ＰＨＣホールディングス	17,700	1,961.00	34,709,700	貸付有価証券 100株
		東芝テック	16,600	4,715.00	78,269,000	
		芝浦メカトロニクス	2,700	9,310.00	25,137,000	
		マブチモーター	36,100	3,860.00	139,346,000	
		日本電産	399,900	13,485.00	5,392,651,500	
		ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,800	437.00	2,971,600	貸付有価証券 600株（600株）
		トレックス・セミコンダクター	7,700	3,625.00	27,912,500	
		東光高岳	8,600	1,348.00	11,592,800	
		ダブル・スコープ	44,400	737.00	32,722,800	貸付有価証券 13,200株（4,200株）
		ダイヘン	16,900	4,600.00	77,740,000	
		ヤーマン	25,200	939.00	23,662,800	貸付有価証券

				11,800株
ＪＶＣケンウッド	125,700	171.00	21,494,700	
ミマキエンジニアリング	13,800	892.00	12,309,600	
Ｉ－ＰＥＸ	7,200	1,935.00	13,932,000	貸付有価証券 100株
日新電機	36,200	1,550.00	56,110,000	
大崎電気工業	28,300	450.00	12,735,000	
オムロン	128,400	11,465.00	1,472,106,000	
日東工業	20,600	1,562.00	32,177,200	
ＩＤＥＣ	19,100	2,684.00	51,264,400	
正興電機製作所	4,800	1,158.00	5,558,400	貸付有価証券 2,200株（200株）
不二電機工業	2,900	1,127.00	3,268,300	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	51,500	2,474.00	127,411,000	
サクサホールディングス	3,600	1,313.00	4,726,800	
メルコホールディングス	4,300	3,885.00	16,705,500	
テクノメディカ	3,500	1,634.00	5,719,000	貸付有価証券 1,500株
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	4,300	1,241.00	5,336,300	貸付有価証券 1,500株（1,000株）
日本電気	196,100	5,200.00	1,019,720,000	
富士通	138,800	19,540.00	2,712,152,000	
沖電気工業	62,700	867.00	54,360,900	
岩崎通信機	6,300	822.00	5,178,600	
電気興業	8,100	2,464.00	19,958,400	
サンケン電気	14,400	6,160.00	88,704,000	
ナカヨ	2,800	1,160.00	3,248,000	
アイホン	8,700	2,107.00	18,330,900	貸付有価証券 1,800株
ルネサスエレクトロニクス	836,100	1,410.00	1,178,901,000	貸付有価証券 200株
セイコーエプソン	191,400	2,054.00	393,135,600	
ワコム	119,700	895.00	107,131,500	貸付有価証券 56,200株
アルバック	28,400	7,150.00	203,060,000	貸付有価証券 800株
アクセル	6,400	1,155.00	7,392,000	
ＥＩＺＯ	12,000	3,970.00	47,640,000	

		日本信号	39,300	899.00	35,330,700	
		京三製作所	33,100	458.00	15,159,800	
		能美防災	20,400	2,241.00	45,716,400	貸付有価証券 200株
		ホーチキ	11,200	1,309.00	14,660,800	
		星和電機	7,000	499.00	3,493,000	
		エレコム	35,300	1,476.00	52,102,800	貸付有価証券 2,300株
		パナソニック	1,645,700	1,232.50	2,028,325,250	
		シャープ	175,900	1,306.00	229,725,400	貸付有価証券 7,600株
		アンリツ	99,400	1,726.00	171,564,400	貸付有価証券 46,700株
		富士通ゼネラル	41,900	2,696.00	112,962,400	貸付有価証券 6,100株
		ソニーグループ	966,600	14,365.00	13,885,209,000	
		ＴＤＫ	223,500	4,540.00	1,014,690,000	
		帝国通信工業	6,800	1,366.00	9,288,800	
		タムラ製作所	59,500	738.00	43,911,000	貸付有価証券 15,900株（3,000株）
		アルプスアルパイン	136,600	1,092.00	149,167,200	貸付有価証券 800株
		池上通信機	4,500	655.00	2,947,500	
		日本電波工業	13,900	1,759.00	24,450,100	
		鈴木	6,900	878.00	6,058,200	
		メイコー	12,500	4,825.00	60,312,500	
		日本トリム	2,900	3,085.00	8,946,500	
		ローランド　ディー.ジー.	9,100	3,595.00	32,714,500	貸付有価証券 600株
		フォスター電機	15,600	722.00	11,263,200	
		ＳＭＫ	3,600	2,136.00	7,689,600	
		ヨコオ	11,400	2,864.00	32,649,600	貸付有価証券 200株
		ティアック	24,900	153.00	3,809,700	
		ホシデン	37,200	1,136.00	42,259,200	
		ヒロセ電機	23,800	19,450.00	462,910,000	
		日本航空電子工業	35,400	1,980.00	70,092,000	貸付有価証券 1,800株
		ＴＯＡ	16,500	783.00	12,919,500	貸付有価証券

				100株
マクセル	30,700	1,363.00	41,844,100	
古野電気	18,300	1,189.00	21,758,700	
ユニデンホールディングス	3,400	3,605.00	12,257,000	
スミダコーポレーション	14,500	1,250.00	18,125,000	貸付有価証券 400株
アイコム	5,700	2,457.00	14,004,900	
リオン	5,900	2,256.00	13,310,400	
本多通信工業	12,000	420.00	5,040,000	貸付有価証券 5,300株
横河電機	154,400	2,076.00	320,534,400	
新電元工業	5,900	3,650.00	21,535,000	
アズビル	90,400	5,190.00	469,176,000	
東亜ディーケーケー	7,600	860.00	6,536,000	貸付有価証券 3,300株
日本光電工業	63,800	3,155.00	201,289,000	
チノー	4,900	1,596.00	7,820,400	
共和電業	14,800	393.00	5,816,400	
日本電子材料	7,500	2,808.00	21,060,000	
堀場製作所	28,500	6,700.00	190,950,000	
アドバンテスト	114,700	10,960.00	1,257,112,000	
小野測器	6,400	477.00	3,052,800	
エスペック	12,500	2,171.00	27,137,500	
キーエンス	139,800	73,180.00	10,230,564,000	
日置電機	7,400	8,580.00	63,492,000	
シスメックス	130,500	15,265.00	1,992,082,500	貸付有価証券 400株
日本マイクロニクス	26,800	1,887.00	50,571,600	
メガチップス	14,300	5,100.00	72,930,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,000	3,325.00	23,275,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
澤藤電機	1,900	1,641.00	3,117,900	
原田工業	7,300	972.00	7,095,600	
コーセル	18,800	836.00	15,716,800	
イリソ電子工業	13,000	4,290.00	55,770,000	
オプテックスグループ	25,300	1,646.00	41,643,800	
千代田インテグレ	6,500	2,111.00	13,721,500	

アイ・オー・データ機器	5,700	736.00	4,195,200	
レーザーテック	67,800	34,290.00	2,324,862,000	貸付有価証券 1,700株
スタンレー電気	108,000	2,874.00	310,392,000	
岩崎電気	5,600	2,290.00	12,824,000	
ウシオ電機	79,100	1,909.00	151,001,900	貸付有価証券 2,000株
岡谷電機産業	11,000	313.00	3,443,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	13,100	304.00	3,982,400	
エノモト	4,300	1,727.00	7,426,100	
日本セラミック	14,300	2,802.00	40,068,600	
遠藤照明	7,100	1,062.00	7,540,200	
古河電池	11,000	1,381.00	15,191,000	貸付有価証券 3,700株（2,200株）
双信電機	6,700	786.00	5,266,200	
山一電機	11,200	2,336.00	26,163,200	
図研	10,000	3,620.00	36,200,000	
日本電子	32,100	8,920.00	286,332,000	貸付有価証券 400株
カシオ計算機	111,700	1,482.00	165,539,400	貸付有価証券 2,400株
ファナック	135,400	24,045.00	3,255,693,000	
日本シイエムケイ	30,200	699.00	21,109,800	貸付有価証券 200株
エンプラス	3,800	2,678.00	10,176,400	
大真空	20,800	1,611.00	33,508,800	貸付有価証券 1,300株
ローム	69,100	10,710.00	740,061,000	
浜松ホトニクス	110,700	7,340.00	812,538,000	
三井ハイテック	15,100	11,410.00	172,291,000	
新光電気工業	45,300	5,540.00	250,962,000	貸付有価証券 1,300株
京セラ	217,100	7,199.00	1,562,902,900	
太陽誘電	74,900	6,630.00	496,587,000	貸付有価証券 200株
村田製作所	453,200	9,180.00	4,160,376,000	貸付有価証券 300株
双葉電子工業	26,400	683.00	18,031,200	

北陸電気工業	5,800	1,374.00	7,969,200	
ニチコン	48,600	1,251.00	60,798,600	貸付有価証券 1,000株
日本ケミコン	14,600	1,737.00	25,360,200	
ＫＯＡ	23,300	1,611.00	37,536,300	
市光工業	18,500	502.00	9,287,000	貸付有価証券 200株
小糸製作所	84,700	6,110.00	517,517,000	
ミツバ	28,400	433.00	12,297,200	貸付有価証券 600株
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	26,800	12,300.00	329,640,000	
キヤノン電子	14,200	1,618.00	22,975,600	
キヤノン	766,700	2,860.00	2,192,762,000	貸付有価証券 93,100株
リコー	428,200	1,077.00	461,171,400	貸付有価証券 9,100株
象印マホービン	41,700	1,433.00	59,756,100	貸付有価証券 1,400株
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,900	1,657.00	3,148,300	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン	97,900	65,600.00	6,422,240,000	
トヨタ紡織	62,900	2,168.00	136,367,200	貸付有価証券 1,300株
芦森工業	2,900	891.00	2,583,900	
ユニプレス	23,000	765.00	17,595,000	
豊田自動織機	124,900	9,160.00	1,144,084,000	
モリタホールディングス	24,700	1,288.00	31,813,600	
三櫻工業	21,300	921.00	19,617,300	貸付有価証券 2,400株
デンソー	339,700	9,293.00	3,156,832,100	
東海理化電機製作所	40,600	1,522.00	61,793,200	貸付有価証券 100株
川崎重工業	112,600	2,065.00	232,519,000	
名村造船所	46,300	209.00	9,676,700	貸付有価証券 9,100株（2,100株）
日本車輌製造	5,600	2,000.00	11,200,000	
三菱ロジスネクスト	20,400	993.00	20,257,200	貸付有価証券 6,300株
近畿車輌	2,300	975.00	2,242,500	

日産自動車	1,819,700	552.70	1,005,748,190	
いすゞ自動車	484,200	1,458.00	705,963,600	
トヨタ自動車	7,815,600	2,108.00	16,475,284,800	
日野自動車	192,700	945.00	182,101,500	
三菱自動車工業	571,100	322.00	183,894,200	貸付有価証券 112,100株
エフテック	10,800	566.00	6,112,800	貸付有価証券 100株
レシップホールディングス	6,100	572.00	3,489,200	
GMB	2,800	738.00	2,066,400	
ファルテック	2,700	700.00	1,890,000	
武蔵精密工業	34,400	1,886.00	64,878,400	貸付有価証券 6,100株
日産車体	22,600	692.00	15,639,200	貸付有価証券 200株
新明和工業	43,600	863.00	37,626,800	
極東開発工業	28,700	1,510.00	43,337,000	
トピー工業	12,700	1,077.00	13,677,900	
ティラド	4,400	2,668.00	11,739,200	
タチエス	27,000	1,227.00	33,129,000	
ＮＯＫ	74,600	1,217.00	90,788,200	
フタバ産業	38,600	417.00	16,096,200	
ＫＹＢ	16,000	3,075.00	49,200,000	
大同メタル工業	29,600	595.00	17,612,000	
プレス工業	76,500	389.00	29,758,500	
ミクニ	19,600	306.00	5,997,600	
太平洋工業	32,300	1,169.00	37,758,700	
河西工業	18,900	280.00	5,292,000	
アイシン	112,900	4,360.00	492,244,000	
マツダ	484,300	889.00	430,542,700	貸付有価証券 22,400株
今仙電機製作所	10,100	580.00	5,858,000	
本田技研工業	1,214,800	3,191.00	3,876,426,800	貸付有価証券 1,800株
スズキ	352,900	4,395.00	1,550,995,500	貸付有価証券 14,000株
ＳＵＢＡＲＵ	442,200	2,043.00	903,414,600	貸付有価証券 800株

安永	7,400	906.00	6,704,400	
ヤマハ発動機	201,300	2,824.00	568,471,200	
ＴＢＫ	16,900	399.00	6,743,100	
エクセディ	23,300	1,640.00	38,212,000	貸付有価証券 600株
豊田合成	49,800	2,466.00	122,806,800	貸付有価証券 1,800株
愛三工業	24,200	759.00	18,367,800	
盟和産業	2,200	1,007.00	2,215,400	
日本プラスト	12,100	517.00	6,255,700	
ヨロズ	14,400	1,058.00	15,235,200	
エフ・シー・シー	25,200	1,460.00	36,792,000	貸付有価証券 800株
シマノ	62,200	30,690.00	1,908,918,000	
テイ・エス　テック	65,100	1,372.00	89,317,200	貸付有価証券 4,000株
ジャムコ	9,000	932.00	8,388,000	
テルモ	436,600	4,885.00	2,132,791,000	
クリエートメディック	4,600	985.00	4,531,000	
日機装	46,300	771.00	35,697,300	
日本エム・ディ・エム	8,900	1,857.00	16,527,300	
島津製作所	198,600	4,845.00	962,217,000	
ＪＭＳ	13,000	585.00	7,605,000	貸付有価証券 100株
クボテック	3,300	246.00	811,800	貸付有価証券 100株（100株）
長野計器	11,200	1,601.00	17,931,200	貸付有価証券 100株
ブイ・テクノロジー	6,700	3,435.00	23,014,500	
東京計器	9,800	982.00	9,623,600	
愛知時計電機	2,200	4,900.00	10,780,000	
インターアクション	7,700	2,462.00	18,957,400	貸付有価証券 700株（700株）
オーバル	13,800	240.00	3,312,000	
東京精密	26,100	4,990.00	130,239,000	貸付有価証券 200株
マニー	61,500	1,549.00	95,263,500	
ニコン	235,600	1,235.00	290,966,000	貸付有価証券 1,600株

トプコン	72,600	1,651.00	119,862,600	
オリンパス	809,100	2,532.50	2,049,045,750	貸付有価証券 4,200株
理研計器	12,500	5,790.00	72,375,000	
タムロン	12,000	2,850.00	34,200,000	
ＨＯＹＡ	301,100	16,870.00	5,079,557,000	
シード	7,200	544.00	3,916,800	
ノーリツ鋼機	13,900	2,696.00	37,474,400	
エー・アンド・デイ	14,100	1,231.00	17,357,100	
朝日インテック	169,200	2,467.00	417,416,400	貸付有価証券 2,300株
シチズン時計	180,700	503.00	90,892,100	貸付有価証券 200株
リズム	4,800	1,209.00	5,803,200	
大研医器	12,200	545.00	6,649,000	
メニコン	51,100	3,370.00	172,207,000	貸付有価証券 3,300株
シンシア	1,600	589.00	942,400	貸付有価証券 700株
松風	6,400	1,970.00	12,608,000	
セイコーホールディングス	21,800	2,302.00	50,183,600	貸付有価証券 300株
ニプロ	115,000	1,073.00	123,395,000	貸付有価証券 2,700株
中本パックス	4,300	1,726.00	7,421,800	
スノーピーク	20,100	3,280.00	65,928,000	貸付有価証券 7,900株（7,200株）
パラマウントベッドホールディングス	29,600	1,909.00	56,506,400	
トランザクション	8,400	1,010.00	8,484,000	貸付有価証券 1,100株（100株）
粧美堂	4,500	399.00	1,795,500	貸付有価証券 2,000株
ニホンフラッシュ	13,200	1,028.00	13,569,600	
前田工繊	17,000	3,865.00	65,705,000	貸付有価証券 1,100株
永大産業	20,200	275.00	5,555,000	
アートネイチャー	13,200	711.00	9,385,200	
バンダイナムコホールディングス	138,300	9,109.00	1,259,774,700	貸付有価証券 100株

アイフィスジャパン	3,900	680.00	2,652,000	貸付有価証券 1,800株
共立印刷	25,800	135.00	3,483,000	
ＳＨＯＥＩ	14,500	4,495.00	65,177,500	貸付有価証券 100株
フランスベッドホールディングス	19,800	910.00	18,018,000	
パイロットコーポレーション	26,000	4,275.00	111,150,000	貸付有価証券 12,200株
萩原工業	10,000	1,220.00	12,200,000	貸付有価証券 3,300株
トッパン・フォームズ	22,000	1,550.00	34,100,000	貸付有価証券 10,300株（200株）
フジシールインターナショナル	37,500	2,096.00	78,600,000	
タカラトミー	64,600	1,095.00	70,737,000	
広済堂ホールディングス	9,600	774.00	7,430,400	貸付有価証券 4,500株
エステールホールディングス	3,700	630.00	2,331,000	貸付有価証券 1,800株
タカノ	5,300	677.00	3,588,100	貸付有価証券 2,300株
プロネクサス	11,900	1,103.00	13,125,700	
ホクシン	10,900	152.00	1,656,800	貸付有価証券 4,700株
ウッドワン	4,700	985.00	4,629,500	
大建工業	9,100	2,114.00	19,237,400	
凸版印刷	234,500	2,149.00	503,940,500	
大日本印刷	182,400	2,857.00	521,116,800	
共同印刷	4,800	2,835.00	13,608,000	
ＮＩＳＳＨＡ	31,700	1,685.00	53,414,500	
光村印刷	1,300	1,371.00	1,782,300	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	7,600	1,790.00	13,604,000	貸付有価証券 1,400株
アシックス	136,400	2,549.00	347,683,600	貸付有価証券 900株
ツツミ	3,800	1,916.00	7,280,800	貸付有価証券 700株
ローランド	10,700	3,865.00	41,355,500	
小松ウオール工業	4,700	1,911.00	8,981,700	

		ヤマハ	91,800	5,680.00	521,424,000	
		河合楽器製作所	4,300	3,355.00	14,426,500	
		クリナップ	14,300	534.00	7,636,200	
		ピジョン	93,200	2,190.00	204,108,000	貸付有価証券 12,400株
		兼松サステック	1,000	1,739.00	1,739,000	
		キングジム	12,400	877.00	10,874,800	貸付有価証券 200株
		リンテック	33,100	2,592.00	85,795,200	
		イトーキ	28,400	368.00	10,451,200	
		任天堂	87,100	55,400.00	4,825,340,000	
		三菱鉛筆	25,400	1,206.00	30,632,400	
		タカラスタンダード	31,900	1,408.00	44,915,200	貸付有価証券 300株
		コクヨ	74,000	1,721.00	127,354,000	
		ナカバヤシ	13,800	498.00	6,872,400	貸付有価証券 300株
		グローブライド	13,800	3,265.00	45,057,000	
		オカムラ	53,000	1,279.00	67,787,000	貸付有価証券 500株
		美津濃	15,300	2,187.00	33,461,100	
		東京電力ホールディングス	1,154,700	292.00	337,172,400	貸付有価証券 40,400株
		中部電力	472,000	1,201.00	566,872,000	
		関西電力	584,600	1,065.00	622,599,000	貸付有価証券 23,500株
		中国電力	241,100	916.00	220,847,600	
		北陸電力	141,100	580.00	81,838,000	貸付有価証券 100株
		東北電力	361,400	813.00	293,818,200	貸付有価証券 2,300株
		四国電力	138,900	803.00	111,536,700	
		九州電力	318,000	849.00	269,982,000	
		北海道電力	134,100	509.00	68,256,900	貸付有価証券 300株
		沖縄電力	32,700	1,448.00	47,349,600	貸付有価証券 700株
		電源開発	131,500	1,531.00	201,326,500	
		エフオン	9,300	583.00	5,421,900	貸付有価証券

					100株
		イーレックス	22,700	2,000.00	45,400,000	
		レノバ	30,100	3,900.00	117,390,000	貸付有価証券 1,100株
		東京瓦斯	295,800	2,042.00	604,023,600	貸付有価証券 1,100株
		大阪瓦斯	279,400	1,881.00	525,551,400	
		東邦瓦斯	70,800	2,950.00	208,860,000	貸付有価証券 800株
		北海道瓦斯	7,600	1,487.00	11,301,200	
		広島ガス	29,400	361.00	10,613,400	
		西部ガスホールディングス	17,400	2,109.00	36,696,600	
		静岡ガス	40,100	978.00	39,217,800	
		メタウォーター	17,400	1,924.00	33,477,600	
		ＳＢＳホールディングス	11,400	3,220.00	36,708,000	
		東武鉄道	150,800	2,636.00	397,508,800	貸付有価証券 3,500株
		相鉄ホールディングス	49,400	2,066.00	102,060,400	貸付有価証券 1,300株
		東急	389,100	1,548.00	602,326,800	
		京浜急行電鉄	198,200	1,122.00	222,380,400	貸付有価証券 6,700株
		小田急電鉄	229,500	2,166.00	497,097,000	貸付有価証券 100株
		京王電鉄	80,100	5,080.00	406,908,000	貸付有価証券 900株
		京成電鉄	107,400	3,140.00	337,236,000	
		富士急行	18,400	4,110.00	75,624,000	貸付有価証券 2,000株
		新京成電鉄	3,600	2,009.00	7,232,400	
		東日本旅客鉄道	271,600	7,033.00	1,910,162,800	貸付有価証券 400株
		西日本旅客鉄道	187,000	4,819.00	901,153,000	
		東海旅客鉄道	128,300	15,360.00	1,970,688,000	貸付有価証券 100株
		西武ホールディングス	201,400	1,078.00	217,109,200	貸付有価証券 400株
		鴻池運輸	24,600	1,200.00	29,520,000	
		西日本鉄道	42,800	2,578.00	110,338,400	貸付有価証券

				500株
ハマキョウレックス	10,900	2,852.00	31,086,800	
サカイ引越センター	7,100	4,245.00	30,139,500	
近鉄グループホールディングス	146,100	3,185.00	465,328,500	貸付有価証券 2,400株
阪急阪神ホールディングス	182,700	3,305.00	603,823,500	
南海電気鉄道	65,200	2,124.00	138,484,800	
京阪ホールディングス	65,100	2,563.00	166,851,300	貸付有価証券 100株
神戸電鉄	3,500	3,115.00	10,902,500	貸付有価証券 1,600株
名古屋鉄道	120,100	1,733.00	208,133,300	貸付有価証券 5,700株
山陽電気鉄道	11,200	1,990.00	22,288,000	貸付有価証券 4,700株
アルプス物流	10,200	1,079.00	11,005,800	
日本通運	50,600	6,920.00	350,152,000	
ヤマトホールディングス	204,800	2,714.00	555,827,200	
山九	40,600	4,770.00	193,662,000	
丸運	8,300	247.00	2,050,100	
丸全昭和運輸	11,800	3,280.00	38,704,000	
センコーグループホールディングス	73,300	931.00	68,242,300	貸付有価証券 4,000株（3,700株）
トナミホールディングス	3,500	3,815.00	13,352,500	
ニッコンホールディングス	49,000	2,164.00	106,036,000	
日本石油輸送	1,600	2,640.00	4,224,000	
福山通運	24,000	3,885.00	93,240,000	
セイノーホールディングス	99,500	1,166.00	116,017,000	
エスライン	4,400	897.00	3,946,800	
神奈川中央交通	3,600	3,330.00	11,988,000	貸付有価証券 1,500株
日立物流	28,200	5,300.00	149,460,000	貸付有価証券 100株
丸和運輸機関	30,900	1,381.00	42,672,900	貸付有価証券 9,000株
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	14,800	1,630.00	24,124,000	

		九州旅客鉄道	113,000	2,371.00	267,923,000	
		ＳＧホールディングス	276,100	2,664.00	735,530,400	貸付有価証券 300株
		日本郵船	122,200	8,730.00	1,066,806,000	
		商船三井	80,900	8,430.00	681,987,000	
		川崎汽船	45,000	6,820.00	306,900,000	
		ＮＳユナイテッド海運	8,000	3,465.00	27,720,000	
		明治海運	17,200	702.00	12,074,400	貸付有価証券 8,000株（1,900株）
		飯野海運	67,800	546.00	37,018,800	貸付有価証券 400株
		共栄タンカー	2,600	834.00	2,168,400	貸付有価証券 200株（200株）
		乾汽船	10,000	2,225.00	22,250,000	貸付有価証券 600株
		日本航空	335,100	2,170.00	727,167,000	貸付有価証券 2,100株
		ＡＮＡホールディングス	371,200	2,376.00	881,971,200	貸付有価証券 167,300株（28,700株）
		パスコ	2,800	1,315.00	3,682,000	
		トランコム	4,100	8,740.00	35,834,000	
		日新	11,700	1,619.00	18,942,300	
		三菱倉庫	46,400	2,895.00	134,328,000	
		三井倉庫ホールディングス	15,500	2,402.00	37,231,000	
		住友倉庫	51,600	1,931.00	99,639,600	貸付有価証券 600株
		澁澤倉庫	8,700	2,285.00	19,879,500	
		東陽倉庫	24,500	319.00	7,815,500	
		日本トランスシティ	32,200	669.00	21,541,800	
		ケイヒン	2,500	1,327.00	3,317,500	
		中央倉庫	8,900	962.00	8,561,800	
		川西倉庫	2,700	1,068.00	2,883,600	貸付有価証券 1,200株
		安田倉庫	12,000	976.00	11,712,000	
		ファイズホールディングス	3,100	514.00	1,593,400	
		東洋埠頭	4,400	1,411.00	6,208,400	
		宇徳	10,400	723.00	7,519,200	貸付有価証券

				300株（200株）
上組	80,400	2,175.00	174,870,000	
サンリツ	4,000	840.00	3,360,000	
キムラユニティー	3,900	1,294.00	5,046,600	貸付有価証券 1,800株
キユーソー流通システム	7,300	890.00	6,497,000	貸付有価証券 3,300株
近鉄エクスプレス	27,600	2,976.00	82,137,600	貸付有価証券 200株
東海運	8,300	302.00	2,506,600	
エーアイテイー	9,200	1,392.00	12,806,400	
内外トランスライン	5,600	2,095.00	11,732,000	貸付有価証券 2,600株
日本コンセプト	4,700	1,620.00	7,614,000	貸付有価証券 100株（100株）
ＮＥＣネッツエスアイ	50,100	1,757.00	88,025,700	
クロスキャット	4,000	1,855.00	7,420,000	
システナ	216,000	428.00	92,448,000	
デジタルアーツ	8,100	8,450.00	68,445,000	
日鉄ソリューションズ	21,900	3,495.00	76,540,500	
キューブシステム	7,600	1,050.00	7,980,000	貸付有価証券 3,400株
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,100	1,496.00	3,141,600	貸付有価証券 1,000株
コア	6,400	1,618.00	10,355,200	
ラクーンホールディングス	10,700	1,405.00	15,033,500	貸付有価証券 3,200株（800株）
ソリトンシステムズ	7,600	1,344.00	10,214,400	貸付有価証券 200株（200株）
ソフトクリエイトホールディングス	6,600	4,150.00	27,390,000	
ＴＩＳ	144,400	3,405.00	491,682,000	
ＪＮＳホールディングス	7,000	460.00	3,220,000	貸付有価証券 400株
グリー	92,800	802.00	74,425,600	貸付有価証券 43,600株（5,400株）
GMOペパボ	1,600	2,466.00	3,945,600	貸付有価証券 100株
コーエーテクモホールディングス	48,300	4,495.00	217,108,500	貸付有価証券 20,200株（3,300株）

		三菱総合研究所	6,500	4,005.00	26,032,500	
		ボルテージ	4,100	358.00	1,467,800	貸付有価証券 1,900株（100株）
		電算	1,700	2,281.00	3,877,700	
		ＡＧＳ	7,700	867.00	6,675,900	
		ファインデックス	12,700	971.00	12,331,700	
		ブレインパッド	3,900	4,575.00	17,842,500	貸付有価証券 200株（200株）
		ＫＬａｂ	27,800	491.00	13,649,800	貸付有価証券 1,500株
		ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	21,900	991.00	21,702,900	
		イーブックイニシアティブジャパン	1,100	4,720.00	5,192,000	
		ネクソン	341,400	2,244.00	766,101,600	
		アイスタイル	46,200	267.00	12,335,400	貸付有価証券 8,300株（7,200株）
		エムアップホールディングス	4,400	4,380.00	19,272,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
		エイチーム	10,400	873.00	9,079,200	
		エニグモ	16,300	719.00	11,719,700	貸付有価証券 300株
		テクノスジャパン	11,700	519.00	6,072,300	貸付有価証券 100株
		ｅｎｉｓｈ	9,300	354.00	3,292,200	貸付有価証券 3,700株（1,400株）
		コロプラ	49,700	644.00	32,006,800	貸付有価証券 1,300株
		オルトプラス	11,700	323.00	3,779,100	貸付有価証券 300株
		ブロードリーフ	75,000	434.00	32,550,000	貸付有価証券 43,600株
		クロス・マーケティンググループ	5,700	1,031.00	5,876,700	貸付有価証券 1,900株（1,800株）
		デジタルハーツホールディングス	6,900	2,327.00	16,056,300	
		システム情報	11,300	824.00	9,311,200	
		メディアドゥ	5,300	4,075.00	21,597,500	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
		じげん	42,800	296.00	12,668,800	
		ブイキューブ	15,400	1,017.00	15,661,800	貸付有価証券

					5,400株（5,400株）
		エンカレッジ・テクノロジ	3,300	596.00	1,966,800	
		サイバーリンクス	5,000	1,023.00	5,115,000	貸付有価証券 2,300株（300株）
		ディー・エル・イー	10,100	307.00	3,100,700	貸付有価証券 4,700株（700株）
		フィックスターズ	16,100	852.00	13,717,200	貸付有価証券 500株
		ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,100	2,147.00	13,096,700	貸付有価証券 2,800株（200株）
		オプティム	10,600	1,270.00	13,462,000	貸付有価証券 4,900株（3,400株）
		セレス	5,500	2,512.00	13,816,000	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
		ＳＨＩＦＴ	7,700	23,910.00	184,107,000	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
		ティーガイア	13,400	1,611.00	21,587,400	
		セック	2,200	2,278.00	5,011,600	
		テクマトリックス	25,600	1,839.00	47,078,400	
		プロシップ	5,000	1,501.00	7,505,000	
		ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,000	2,613.00	107,133,000	貸付有価証券 100株
		GMOペイメントゲートウェイ	29,300	14,370.00	421,041,000	
		ザッパラス	5,900	549.00	3,239,100	貸付有価証券 100株
		システムリサーチ	4,400	1,961.00	8,628,400	
		インターネットイニシアティブ	40,300	4,675.00	188,402,500	
		さくらインターネット	16,200	533.00	8,634,600	貸付有価証券 6,800株
		ヴィンクス	4,200	841.00	3,532,200	
		GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,400	4,310.00	14,654,000	貸付有価証券 1,500株（1,100株）
		ＳＲＡホールディングス	7,300	2,851.00	20,812,300	
		システムインテグレータ	4,800	552.00	2,649,600	
		朝日ネット	13,800	580.00	8,004,000	貸付有価証券 100株
		ｅＢＡＳＥ	18,100	615.00	11,131,500	
		アバント	16,200	1,186.00	19,213,200	

		アドソル日進	5,400	1,691.00	9,131,400	貸付有価証券 100株（100株）
		ＯＤＫソリューションズ	3,100	661.00	2,049,100	
		フリービット	9,000	1,022.00	9,198,000	
		コムチュア	17,000	3,340.00	56,780,000	
		サイバーコム	2,300	1,095.00	2,518,500	
		アステリア	10,900	1,032.00	11,248,800	貸付有価証券 500株
		アイル	8,400	1,445.00	12,138,000	
		マークラインズ	7,600	2,758.00	20,960,800	
		メディカル・データ・ビジョン	19,200	1,218.00	23,385,600	貸付有価証券 4,700株（4,700株）
		ｇｕｍｉ	21,000	681.00	14,301,000	貸付有価証券 6,000株（1,800株）
		ショーケース	3,300	467.00	1,541,100	
		モバイルファクトリー	3,400	842.00	2,862,800	貸付有価証券 1,500株（800株）
		テラスカイ	5,500	1,719.00	9,454,500	貸付有価証券 2,800株（1,000株）
		デジタル・インフォメーション・テクノロジ	6,700	1,274.00	8,535,800	
		ＰＣＩホールディングス	6,800	1,181.00	8,030,800	
		パイプドＨＤ	2,700	2,502.00	6,755,400	貸付有価証券 1,200株（900株）
		アイビーシー	2,500	687.00	1,717,500	
		ネオジャパン	4,300	1,390.00	5,977,000	
		ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,200	3,020.00	9,664,000	貸付有価証券 100株（100株）
		ラクス	52,100	3,315.00	172,711,500	貸付有価証券 2,000株
		ランドコンピュータ	3,400	830.00	2,822,000	
		ダブルスタンダード	4,600	3,020.00	13,892,000	
		オープンドア	9,000	1,940.00	17,460,000	貸付有価証券 2,100株（1,800株）
		マイネット	5,400	577.00	3,115,800	
		アカツキ	6,800	2,594.00	17,639,200	
		ベネフィットジャパン	1,100	2,418.00	2,659,800	
		Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,000	2,648.00	10,592,000	
		カナミックネットワーク	16,100	463.00	7,454,300	貸付有価証券

					100株
		ノムラシステムコーポレーション	7,800	271.00	2,113,800	貸付有価証券 600株（600株）
		チェンジ	27,900	1,880.00	52,452,000	貸付有価証券 12,800株（200株）
		シンクロ・フード	7,700	329.00	2,533,300	
		オークネット	8,000	1,563.00	12,504,000	貸付有価証券 3,600株
		キャピタル・アセット・プランニング	3,000	672.00	2,016,000	
		セグエグループ	3,900	746.00	2,909,400	
		エイトレッド	2,100	2,284.00	4,796,400	貸付有価証券 1,300株
		マクロミル	31,000	1,028.00	31,868,000	
		ビーグリー	3,600	1,664.00	5,990,400	貸付有価証券 1,700株（300株）
		オロ	4,800	2,906.00	13,948,800	貸付有価証券 200株（200株）
		ユーザーローカル	4,600	1,750.00	8,050,000	
		テモナ	3,300	455.00	1,501,500	貸付有価証券 700株（700株）
		ニーズウェル	3,400	579.00	1,968,600	
		マネーフォワード	23,000	6,960.00	160,080,000	貸付有価証券 2,800株
		サインポスト	4,900	1,136.00	5,566,400	貸付有価証券 2,200株（100株）
		電算システムホールディングス	6,200	2,626.00	16,281,200	
		ソルクシーズ	12,800	446.00	5,708,800	貸付有価証券 300株
		フェイス	4,000	670.00	2,680,000	貸付有価証券 1,800株
		プロトコーポレーション	16,100	1,335.00	21,493,500	
		ハイマックス	4,000	1,079.00	4,316,000	
		野村総合研究所	292,500	4,935.00	1,443,487,500	
		サイバネットシステム	10,800	702.00	7,581,600	貸付有価証券 300株
		ＣＥホールディングス	8,000	456.00	3,648,000	貸付有価証券 3,500株
		日本システム技術	3,000	2,585.00	7,755,000	
		インテージホールディン	18,900	1,700.00	32,130,000	貸付有価証券

		グス				8,800株（500株）
		東邦システムサイエンス	4,000	1,014.00	4,056,000	貸付有価証券 1,700株
		ソースネクスト	65,300	176.00	11,492,800	貸付有価証券 4,800株
		インフォコム	16,600	1,950.00	32,370,000	
		シンプレクス・ホールディングス	16,000	2,856.00	45,696,000	
		ＨＥＲＯＺ	4,300	1,240.00	5,332,000	貸付有価証券 1,000株（900株）
		ラクスル	16,600	5,480.00	90,968,000	貸付有価証券 2,600株（2,400株）
		ＩＰＳ	4,200	2,230.00	9,366,000	貸付有価証券 900株（300株）
		ＦＩＧ	16,400	339.00	5,559,600	貸付有価証券 7,700株
		システムサポート	4,500	1,121.00	5,044,500	
		イーソル	9,300	597.00	5,552,100	貸付有価証券 2,300株
		アルテリア・ネットワークス	19,200	1,511.00	29,011,200	
		ＥｄｕＬａｂ	1,400	941.00	1,317,400	
		東海ソフト	2,400	953.00	2,287,200	
		ウイングアーク１ｓｔ	8,600	2,159.00	18,567,400	
		ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	3,400	2,292.00	7,792,800	貸付有価証券 1,500株（200株）
		サーバーワークス	2,600	3,120.00	8,112,000	
		東名	1,400	1,155.00	1,617,000	
		ヴィッツ	1,400	1,399.00	1,958,600	貸付有価証券 100株
		トビラシステムズ	3,000	755.00	2,265,000	貸付有価証券 600株（600株）
		Ｓａｎｓａｎ	53,800	2,558.00	137,620,400	貸付有価証券 100株
		Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,700	1,065.00	2,875,500	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
		ギフティ	13,600	1,990.00	27,064,000	貸付有価証券 3,400株
		ベース	2,600	3,845.00	9,997,000	貸付有価証券 100株
		ＪＭＤＣ	4,400	8,520.00	37,488,000	

フォーカスシステムズ	10,100	967.00	9,766,700	
クレスコ	11,000	2,025.00	22,275,000	
フジ・メディア・ホールディングス	145,800	1,113.00	162,275,400	貸付有価証券 200株
オービック	47,700	21,310.00	1,016,487,000	貸付有価証券 100株
ジャストシステム	21,500	5,350.00	115,025,000	
ＴＤＣソフト	13,200	1,134.00	14,968,800	
Ｚホールディングス	2,200,600	640.20	1,408,824,120	貸付有価証券 125,100株
トレンドマイクロ	80,900	6,530.00	528,277,000	
ＩＤホールディングス	9,500	859.00	8,160,500	
日本オラクル	30,700	8,640.00	265,248,000	
アルファシステムズ	4,000	4,005.00	16,020,000	
フューチャー	16,000	3,535.00	56,560,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,900	1,469.00	13,074,100	
ＳＢテクノロジー	6,500	2,477.00	16,100,500	
トーセ	4,100	705.00	2,890,500	
オービックビジネスコンサルタント	14,400	4,765.00	68,616,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	69,000	3,670.00	253,230,000	
アイティフォー	18,300	773.00	14,145,900	
東計電算	1,800	5,120.00	9,216,000	貸付有価証券 800株
エックスネット	2,400	968.00	2,323,200	
大塚商会	81,900	5,520.00	452,088,000	
サイボウズ	20,200	1,829.00	36,945,800	貸付有価証券 600株
電通国際情報サービス	21,900	3,845.00	84,205,500	
ＡＣＣＥＳＳ	17,100	684.00	11,696,400	
デジタルガレージ	25,000	4,900.00	122,500,000	貸付有価証券 500株
ＥＭシステムズ	25,000	758.00	18,950,000	
ウェザーニューズ	4,500	9,110.00	40,995,000	
ＣＩＪ	9,800	850.00	8,330,000	
ビジネスエンジニアリング	1,700	3,875.00	6,587,500	貸付有価証券 700株

		日本エンタープライズ	15,400	182.00	2,802,800	貸付有価証券 100株
		WOWOW	7,300	1,690.00	12,337,000	貸付有価証券 3,200株
		スカラ	13,500	665.00	8,977,500	貸付有価証券 3,300株
		インテリジェント　ウェイブ	8,800	514.00	4,523,200	
		ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	12,900	641.00	8,268,900	貸付有価証券 200株
		ネットワンシステムズ	57,700	3,020.00	174,254,000	貸付有価証券 500株
		システムソフト	32,200	114.00	3,670,800	貸付有価証券 4,700株
		アルゴグラフィックス	11,800	3,060.00	36,108,000	
		マーベラス	23,800	720.00	17,136,000	
		エイベックス	26,100	1,454.00	37,949,400	
		日本ユニシス	47,300	3,180.00	150,414,000	
		兼松エレクトロニクス	8,200	3,890.00	31,898,000	
		都築電気	7,700	1,732.00	13,336,400	
		ＴＢＳホールディングス	92,100	1,693.00	155,925,300	貸付有価証券 700株
		日本テレビホールディングス	126,400	1,166.00	147,382,400	貸付有価証券 900株
		朝日放送グループホールディングス	15,000	703.00	10,545,000	
		テレビ朝日ホールディングス	36,400	1,419.00	51,651,600	貸付有価証券 200株
		スカパーＪＳＡＴホールディングス	128,200	414.00	53,074,800	貸付有価証券 100株
		テレビ東京ホールディングス	10,800	2,012.00	21,729,600	
		日本ＢＳ放送	5,100	1,105.00	5,635,500	
		ビジョン	25,900	1,144.00	29,629,600	
		スマートバリュー	3,900	411.00	1,602,900	
		ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	14,400	3,005.00	43,272,000	貸付有価証券 5,000株（300株）
		ワイヤレスゲート	6,200	301.00	1,866,200	
		コネクシオ	10,700	1,461.00	15,632,700	貸付有価証券 100株
		日本通信	125,900	200.00	25,180,000	貸付有価証券

				11,400株（6,500株）
クロップス	2,800	1,016.00	2,844,800	
日本電信電話	1,770,900	3,075.00	5,445,517,500	貸付有価証券 26,500株
ＫＤＤＩ	1,103,800	3,333.00	3,678,965,400	
ソフトバンク	2,293,200	1,439.50	3,301,061,400	
光通信	17,800	17,550.00	312,390,000	
エムティーアイ	14,700	607.00	8,922,900	貸付有価証券 200株
GMOインターネット	53,600	2,732.00	146,435,200	貸付有価証券 100株
ファイバーゲート	4,900	1,209.00	5,924,100	貸付有価証券 2,300株（200株）
アイドママーケティングコミュニケーション	3,200	280.00	896,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	44,100	5,720.00	252,252,000	貸付有価証券 800株
学研ホールディングス	21,400	986.00	21,100,400	
ゼンリン	24,700	986.00	24,354,200	貸付有価証券 100株
昭文社ホールディングス	6,100	453.00	2,763,300	
インプレスホールディングス	12,500	217.00	2,712,500	貸付有価証券 100株
アイネット	7,800	1,341.00	10,459,800	
松竹	10,000	11,740.00	117,400,000	
東宝	89,300	4,925.00	439,802,500	
東映	5,000	17,050.00	85,250,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	403,100	2,435.00	981,548,500	
ピー・シー・エー	8,900	1,606.00	14,293,400	貸付有価証券 1,100株
ビジネスブレイン太田昭和	5,200	1,862.00	9,682,400	
ＤＴＳ	29,000	2,495.00	72,355,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	70,400	6,040.00	425,216,000	貸付有価証券 300株
シーイーシー	16,200	1,029.00	16,669,800	貸付有価証券 300株
カプコン	142,700	2,697.00	384,861,900	貸付有価証券 3,100株

アイ・エス・ビー	7,100	1,013.00	7,192,300	
ジャステック	8,800	1,018.00	8,958,400	貸付有価証券 1,300株
ＳＣＳＫ	104,800	2,243.00	235,066,400	
日本システムウエア	5,700	2,279.00	12,990,300	
アイネス	13,700	1,457.00	19,960,900	
ＴＫＣ	25,600	3,395.00	86,912,000	
富士ソフト	16,100	5,510.00	88,711,000	貸付有価証券 300株（300株）
ＮＳＤ	48,700	2,062.00	100,419,400	
コナミホールディングス	55,000	5,500.00	302,500,000	貸付有価証券 100株
福井コンピュータホールディングス	6,900	3,370.00	23,253,000	貸付有価証券 200株
ＪＢＣＣホールディングス	10,200	1,790.00	18,258,000	
ミロク情報サービス	13,300	1,369.00	18,207,700	
ソフトバンクグループ	907,900	5,220.00	4,739,238,000	貸付有価証券 600株
ホウスイ	1,200	803.00	963,600	
高千穂交易	5,800	1,542.00	8,943,600	貸付有価証券 2,100株
オルバヘルスケアホールディングス	2,500	1,465.00	3,662,500	
伊藤忠食品	3,700	4,915.00	18,185,500	
エレマテック	12,200	1,063.00	12,968,600	
ＪＡＬＵＸ	4,300	2,551.00	10,969,300	
あらた	12,100	4,265.00	51,606,500	
トーメンデバイス	2,300	7,150.00	16,445,000	貸付有価証券 400株
東京エレクトロン　デバイス	4,500	6,580.00	29,610,000	
フィールズ	13,300	501.00	6,663,300	
双日	167,900	1,705.00	286,269,500	
アルフレッサ　ホールディングス	168,900	1,506.00	254,363,400	
横浜冷凍	42,600	816.00	34,761,600	
神栄	2,100	1,114.00	2,339,400	貸付有価証券 900株
ラサ商事	8,000	970.00	7,760,000	

		アルコニックス	18,900	1,310.00	24,759,000	貸付有価証券 100株
		神戸物産	118,000	4,475.00	528,050,000	貸付有価証券 9,700株
		ハイパー	3,800	560.00	2,128,000	貸付有価証券 1,700株
		あい　ホールディングス	21,700	1,924.00	41,750,800	
		ディーブイエックス	5,200	1,061.00	5,517,200	
		ダイワボウホールディングス	73,900	1,835.00	135,606,500	貸付有価証券 400株
		マクニカ・富士エレホールディングス	36,200	2,732.00	98,898,400	
		ラクト・ジャパン	5,200	2,348.00	12,209,600	貸付有価証券 100株（100株）
		グリムス	6,800	2,490.00	16,932,000	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
		バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,400	802.00	21,172,800	
		八洲電機	11,000	974.00	10,714,000	貸付有価証券 5,100株
		メディアスホールディングス	8,600	960.00	8,256,000	貸付有価証券 200株（200株）
		レスターホールディングス	14,400	1,954.00	28,137,600	
		ジューテックホールディングス	3,500	1,110.00	3,885,000	
		大光	5,800	676.00	3,920,800	貸付有価証券 2,700株
		ＯＣＨＩホールディングス	4,400	1,254.00	5,517,600	
		ＴＯＫＡＩホールディングス	73,600	844.00	62,118,400	
		黒谷	4,100	615.00	2,521,500	貸付有価証券 1,100株
		Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,600	730.00	1,898,000	
		三洋貿易	15,300	1,009.00	15,437,700	
		ビューティガレージ	2,400	2,927.00	7,024,800	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
		ウイン・パートナーズ	11,000	970.00	10,670,000	
		ミタチ産業	4,200	1,106.00	4,645,200	
		シップヘルスケアホール	48,700	2,654.00	129,249,800	貸付有価証券

		ディングス				4,600株
		明治電機工業	4,800	1,217.00	5,841,600	
		デリカフーズホールディングス	5,900	600.00	3,540,000	貸付有価証券 2,600株
		スターティアホールディングス	3,400	1,062.00	3,610,800	
		コメダホールディングス	33,200	2,023.00	67,163,600	貸付有価証券 100株
		ピーバンドットコム	2,100	497.00	1,043,700	
		アセンテック	5,200	917.00	4,768,400	貸付有価証券 1,700株
		富士興産	3,800	1,006.00	3,822,800	
		協栄産業	1,500	1,599.00	2,398,500	
		フルサト・マルカホールディングス	14,600	2,190.00	31,974,000	貸付有価証券 400株（100株）
		ヤマエグループホールディングス	10,200	1,047.00	10,679,400	
		小野建	14,700	1,651.00	24,269,700	貸付有価証券 1,400株
		南陽	3,100	1,829.00	5,669,900	
		佐鳥電機	9,500	1,061.00	10,079,500	貸付有価証券 200株
		エコートレーディング	3,200	626.00	2,003,200	
		伯東	9,300	2,527.00	23,501,100	
		コンドーテック	11,700	971.00	11,360,700	
		中山福	8,000	338.00	2,704,000	
		ナガイレーベン	20,100	2,200.00	44,220,000	
		三菱食品	14,600	2,719.00	39,697,400	
		松田産業	11,100	2,452.00	27,217,200	貸付有価証券 200株
		第一興商	28,800	3,505.00	100,944,000	
		メディパルホールディングス	164,000	2,153.00	353,092,000	貸付有価証券 300株
		ＳＰＫ	6,000	1,396.00	8,376,000	
		萩原電気ホールディングス	5,600	2,004.00	11,222,400	
		アズワン	10,900	15,700.00	171,130,000	貸付有価証券 300株
		スズデン	5,300	1,785.00	9,460,500	
		尾家産業	4,000	991.00	3,964,000	

		シモジマ	9,300	1,114.00	10,360,200	
		ドウシシャ	14,300	1,532.00	21,907,600	
		小津産業	3,300	1,910.00	6,303,000	
		高速	9,000	1,609.00	14,481,000	
		たけびし	5,700	1,462.00	8,333,400	貸付有価証券 2,200株
		リックス	3,400	1,470.00	4,998,000	
		丸文	13,400	806.00	10,800,400	
		ハピネット	12,700	1,476.00	18,745,200	貸付有価証券 100株
		橋本総業ホールディングス	3,100	1,997.00	6,190,700	
		日本ライフライン	45,000	1,038.00	46,710,000	
		タカショー	11,500	707.00	8,130,500	貸付有価証券 5,400株（500株）
		ＩＤＯＭ	46,100	693.00	31,947,300	
		進和	9,000	2,138.00	19,242,000	
		エスケイジャパン	3,700	422.00	1,561,400	貸付有価証券 200株
		ダイトロン	6,400	2,162.00	13,836,800	
		シークス	21,700	1,424.00	30,900,800	貸付有価証券 10,100株
		田中商事	4,700	626.00	2,942,200	
		オーハシテクニカ	8,500	1,328.00	11,288,000	
		白銅	4,900	2,840.00	13,916,000	
		ダイコー通産	1,800	1,162.00	2,091,600	
		伊藤忠商事	1,062,900	3,491.00	3,710,583,900	
		丸紅	1,499,000	1,104.00	1,654,896,000	
		高島	2,200	2,285.00	5,027,000	
		長瀬産業	83,400	1,815.00	151,371,000	
		蝶理	8,500	1,763.00	14,985,500	
		豊田通商	152,600	5,280.00	805,728,000	
		三共生興	20,100	559.00	11,235,900	
		兼松	56,700	1,260.00	71,442,000	
		ツカモトコーポレーション	2,500	1,305.00	3,262,500	
		三井物産	1,180,100	2,676.50	3,158,537,650	
		日本紙パルプ商事	7,900	4,050.00	31,995,000	貸付有価証券

					400株
		カメイ	18,000	1,019.00	18,342,000	
		東都水産	800	4,120.00	3,296,000	貸付有価証券 400株
		ＯＵＧホールディングス	2,200	2,643.00	5,814,600	貸付有価証券 1,000株
		スターゼン	11,200	1,968.00	22,041,600	
		山善	63,900	1,033.00	66,008,700	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
		椿本興業	3,100	4,280.00	13,268,000	
		住友商事	959,200	1,677.50	1,609,058,000	
		内田洋行	6,500	5,110.00	33,215,000	
		三菱商事	1,138,800	3,621.00	4,123,594,800	
		第一実業	6,900	4,820.00	33,258,000	
		キヤノンマーケティングジャパン	37,700	2,294.00	86,483,800	
		西華産業	8,000	1,544.00	12,352,000	
		佐藤商事	12,500	1,172.00	14,650,000	
		菱洋エレクトロ	9,000	2,342.00	21,078,000	貸付有価証券 1,500株（1,300株）
		東京産業	13,700	767.00	10,507,900	
		ユアサ商事	14,400	2,906.00	41,846,400	
		神鋼商事	3,400	3,360.00	11,424,000	
		トルク	8,100	202.00	1,636,200	
		阪和興業	30,400	3,105.00	94,392,000	
		正栄食品工業	9,800	3,875.00	37,975,000	貸付有価証券 4,600株
		カナデン	12,300	1,047.00	12,878,100	
		菱電商事	12,000	1,799.00	21,588,000	
		岩谷産業	36,500	5,620.00	205,130,000	貸付有価証券 200株
		ナイス	5,200	1,695.00	8,814,000	
		ニチモウ	2,200	2,416.00	5,315,200	
		極東貿易	4,400	2,507.00	11,030,800	
		アステナホールディングス	21,400	472.00	10,100,800	
		三愛石油	37,400	1,299.00	48,582,600	
		稲畑産業	33,500	1,655.00	55,442,500	
		ＧＳＩクレオス	7,300	1,181.00	8,621,300	貸付有価証券

					3,300株
		明和産業	14,000	880.00	12,320,000	貸付有価証券 6,600株（100株）
		クワザワホールディングス	6,000	595.00	3,570,000	
		ワキタ	32,400	1,056.00	34,214,400	
		東邦ホールディングス	48,700	1,736.00	84,543,200	貸付有価証券 600株
		サンゲツ	40,200	1,572.00	63,194,400	
		ミツウロコグループホールディングス	22,400	1,204.00	26,969,600	
		シナネンホールディングス	5,600	3,485.00	19,516,000	
		伊藤忠エネクス	33,600	979.00	32,894,400	
		サンリオ	46,900	2,498.00	117,156,200	貸付有価証券 1,400株
		サンワテクノス	9,200	1,568.00	14,425,600	
		リョーサン	16,800	2,236.00	37,564,800	
		新光商事	22,800	902.00	20,565,600	
		トーホー	6,900	1,201.00	8,286,900	
		三信電気	7,000	1,431.00	10,017,000	貸付有価証券 400株
		東陽テクニカ	15,000	1,071.00	16,065,000	
		モスフードサービス	19,900	3,060.00	60,894,000	
		加賀電子	13,700	3,185.00	43,634,500	
		ソーダニッカ	15,700	792.00	12,434,400	貸付有価証券 100株
		立花エレテック	12,200	1,593.00	19,434,600	貸付有価証券 3,500株
		フォーバル	6,600	922.00	6,085,200	
		ＰＡＬＴＡＣ	21,300	4,615.00	98,299,500	
		三谷産業	17,800	307.00	5,464,600	
		太平洋興発	5,600	604.00	3,382,400	
		西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,400	3,280.00	11,152,000	貸付有価証券 1,500株
		ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,970.00	2,561,000	
		コーア商事ホールディングス	11,400	654.00	7,455,600	貸付有価証券 800株（600株）
		国際紙パルプ商事	31,600	313.00	9,890,800	貸付有価証券

				6,800株
ヤマタネ	7,100	1,597.00	11,338,700	
丸紅建材リース	1,300	1,712.00	2,225,600	
日鉄物産	10,800	4,895.00	52,866,000	
泉州電業	4,300	5,620.00	24,166,000	貸付有価証券 1,200株
トラスコ中山	31,600	2,694.00	85,130,400	
オートバックスセブン	51,100	1,390.00	71,029,000	
モリト	11,100	710.00	7,881,000	貸付有価証券 100株
加藤産業	21,900	3,280.00	71,832,000	
北恵	3,800	925.00	3,515,000	貸付有価証券 1,700株
イノテック	9,200	1,477.00	13,588,400	
イエローハット	26,300	1,585.00	41,685,500	
ＪＫホールディングス	12,200	1,092.00	13,322,400	貸付有価証券 7,700株
日伝	12,600	2,316.00	29,181,600	
北沢産業	10,300	236.00	2,430,800	
杉本商事	7,100	2,235.00	15,868,500	
因幡電機産業	40,500	2,664.00	107,892,000	
東テク	5,000	2,398.00	11,990,000	
ミスミグループ本社	190,700	4,640.00	884,848,000	
アルテック	10,200	275.00	2,805,000	
タキヒヨー	4,600	1,568.00	7,212,800	
蔵王産業	2,900	1,918.00	5,562,200	
スズケン	59,400	3,265.00	193,941,000	貸付有価証券 100株
ジェコス	10,500	805.00	8,452,500	
グローセル	17,700	403.00	7,133,100	
ローソン	33,600	5,570.00	187,152,000	
サンエー	11,500	4,120.00	47,380,000	貸付有価証券 800株
カワチ薬品	11,800	2,134.00	25,181,200	
エービーシー・マート	23,700	4,875.00	115,537,500	
ハードオフコーポレーション	6,700	707.00	4,736,900	
アスクル	24,600	1,386.00	34,095,600	

ゲオホールディングス	20,300	1,203.00	24,420,900	貸付有価証券 1,100株
アダストリア	16,400	1,606.00	26,338,400	貸付有価証券 300株
ジーフット	9,200	338.00	3,109,600	貸付有価証券 4,300株（100株）
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2,200	370.00	814,000	
くら寿司	15,900	3,540.00	56,286,000	貸付有価証券 1,900株（1,400株）
キャンドゥ	7,200	2,210.00	15,912,000	貸付有価証券 3,300株（1,000株）
アイケイ	4,400	403.00	1,773,200	
パルグループホールディングス	13,300	1,644.00	21,865,200	
エディオン	69,800	1,056.00	73,708,800	貸付有価証券 32,800株
サーラコーポレーション	30,800	630.00	19,404,000	貸付有価証券 3,100株（2,700株）
ワッツ	7,400	713.00	5,276,200	貸付有価証券 3,300株（100株）
ハローズ	6,900	2,633.00	18,167,700	
フジオフードグループ本社	12,800	1,375.00	17,600,000	貸付有価証券 6,000株
あみやき亭	3,600	2,864.00	10,310,400	
ひらまつ	32,200	183.00	5,892,600	貸付有価証券 300株
大黒天物産	4,900	5,130.00	25,137,000	貸付有価証券 800株（500株）
ハニーズホールディングス	12,000	991.00	11,892,000	
ファーマライズホールディングス	3,700	743.00	2,749,100	貸付有価証券 1,600株
アルペン	11,600	2,164.00	25,102,400	貸付有価証券 5,400株（100株）
ハブ	4,900	646.00	3,165,400	貸付有価証券 2,100株（1,100株）
クオールホールディングス	18,600	1,373.00	25,537,800	
ジンズホールディングス	10,300	6,910.00	71,173,000	貸付有価証券 3,900株（3,000株）
ビックカメラ	90,100	942.00	84,874,200	貸付有価証券

					33,100株（3,100株）
		ＤＣＭホールディングス	93,800	1,079.00	101,210,200	貸付有価証券 700株
		ＭｏｎｏｔａＲＯ	192,100	2,066.00	396,878,600	貸付有価証券 37,500株
		東京一番フーズ	3,800	579.00	2,200,200	貸付有価証券 100株
		ＤＤホールディングス	8,000	537.00	4,296,000	貸付有価証券 500株（100株）
		きちりホールディングス	4,000	407.00	1,628,000	貸付有価証券 1,800株
		アークランドサービスホールディングス	11,100	2,278.00	25,285,800	貸付有価証券 5,200株
		Ｊ．フロント　リテイリング	181,500	979.00	177,688,500	
		ドトール・日レスホールディングス	26,200	1,570.00	41,134,000	
		マツキヨココカラ＆カンパニー	93,500	4,135.00	386,622,500	貸付有価証券 3,300株
		ブロンコビリー	8,700	2,384.00	20,740,800	貸付有価証券 4,000株
		ＺＯＺＯ	104,500	3,455.00	361,047,500	
		トレジャー・ファクトリー	4,400	917.00	4,034,800	
		物語コーポレーション	8,100	6,700.00	54,270,000	貸付有価証券 3,800株
		三越伊勢丹ホールディングス	266,000	832.00	221,312,000	
		Ｈａｍｅｅ	3,900	1,237.00	4,824,300	貸付有価証券 1,800株
		マーケットエンタープライズ	1,000	732.00	732,000	貸付有価証券 400株（300株）
		ウエルシアホールディングス	80,300	3,535.00	283,860,500	
		クリエイトＳＤホールディングス	22,400	3,180.00	71,232,000	
		丸善ＣＨＩホールディングス	17,700	349.00	6,177,300	貸付有価証券 8,100株
		ミサワ	3,100	698.00	2,163,800	貸付有価証券 1,400株
		ティーライフ	2,000	1,336.00	2,672,000	
		エー・ピーホールディン	3,000	438.00	1,314,000	

グス				
チムニー	4,600	1,141.00	5,248,600	貸付有価証券 2,100株
シュッピン	12,600	1,033.00	13,015,800	
オイシックス・ラ・大地	21,900	2,926.00	64,079,400	
ネクステージ	30,700	2,423.00	74,386,100	
ジョイフル本田	44,500	1,444.00	64,258,000	貸付有価証券 19,600株
鳥貴族ホールディングス	5,600	1,735.00	9,716,000	貸付有価証券 1,600株（100株）
ホットランド	11,400	1,318.00	15,025,200	貸付有価証券 5,300株（900株）
すかいらーくホールディングス	196,200	1,520.00	298,224,000	貸付有価証券 92,200株
ＳＦＰホールディングス	7,400	1,341.00	9,923,400	貸付有価証券 3,400株
綿半ホールディングス	11,400	1,280.00	14,592,000	
ヨシックスホールディングス	3,000	1,820.00	5,460,000	貸付有価証券 1,300株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	44,200	1,049.00	46,365,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,900	1,132.00	8,942,800	貸付有価証券 3,700株（100株）
ＢＥＥＮＯＳ	7,700	2,363.00	18,195,100	貸付有価証券 2,000株（1,600株）
あさひ	12,600	1,339.00	16,871,400	貸付有価証券 5,900株
日本調剤	9,200	1,355.00	12,466,000	
コスモス薬品	15,300	16,610.00	254,133,000	貸付有価証券 6,900株
トーエル	7,400	811.00	6,001,400	貸付有価証券 3,200株
オンリー	1,400	760.00	1,064,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	594,500	5,001.00	2,973,094,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	80,900	697.00	56,387,300	貸付有価証券 26,800株（1,600株）
ツルハホールディングス	33,200	10,880.00	361,216,000	貸付有価証券 100株
サンマルクホールディングス	12,000	1,415.00	16,980,000	

フェリシモ	3,400	1,343.00	4,566,200	
トリドールホールディングス	37,800	2,455.00	92,799,000	貸付有価証券 100株
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	13,900	586.00	8,145,400	
ウイルプラスホールディングス	2,400	982.00	2,356,800	
ＪＭホールディングス	10,200	1,578.00	16,095,600	貸付有価証券 100株
サツドラホールディングス	6,800	618.00	4,202,400	
アレンザホールディングス	11,600	1,042.00	12,087,200	
串カツ田中ホールディングス	4,000	1,978.00	7,912,000	貸付有価証券 100株
バロックジャパンリミテッド	10,500	830.00	8,715,000	
クスリのアオキホールディングス	15,100	7,020.00	106,002,000	
力の源ホールディングス	7,800	564.00	4,399,200	貸付有価証券 3,100株
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	89,000	4,295.00	382,255,000	
メディカルシステムネットワーク	14,700	564.00	8,290,800	
一家ホールディングス	3,200	522.00	1,670,400	
はるやまホールディングス	7,100	447.00	3,173,700	
ノジマ	24,600	2,292.00	56,383,200	貸付有価証券 100株
カッパ・クリエイト	21,300	1,304.00	27,775,200	貸付有価証券 10,000株（200株）
ライトオン	11,400	732.00	8,344,800	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
良品計画	174,900	1,728.00	302,227,200	
三城ホールディングス	18,800	215.00	4,042,000	
アドヴァングループ	15,500	964.00	14,942,000	
アルビス	4,900	2,175.00	10,657,500	貸付有価証券 900株
コナカ	17,900	324.00	5,799,600	
ハウス　オブ　ローゼ	1,900	1,646.00	3,127,400	
Ｇ－７ホールディングス	16,900	1,657.00	28,003,300	

		イオン北海道	26,700	1,307.00	34,896,900	
		コジマ	26,100	524.00	13,676,400	貸付有価証券 12,200株
		ヒマラヤ	5,300	933.00	4,944,900	
		コーナン商事	21,600	3,260.00	70,416,000	貸付有価証券 100株
		エコス	5,600	1,879.00	10,522,400	
		ワタミ	18,400	884.00	16,265,600	貸付有価証券 8,500株
		マルシェ	3,700	390.00	1,443,000	貸付有価証券 1,700株
		パン・パシフィック・インターナショナルホ	303,900	1,582.00	480,769,800	
		西松屋チェーン	33,300	1,326.00	44,155,800	貸付有価証券 15,600株（200株）
		ゼンショーホールディングス	74,200	2,667.00	197,891,400	貸付有価証券 4,100株
		幸楽苑ホールディングス	9,600	1,391.00	13,353,600	貸付有価証券 700株（700株）
		ハークスレイ	6,300	450.00	2,835,000	
		サイゼリヤ	22,500	2,951.00	66,397,500	
		ＶＴホールディングス	57,200	444.00	25,396,800	貸付有価証券 600株
		魚力	4,200	2,018.00	8,475,600	貸付有価証券 2,100株
		ポプラ	4,000	134.00	536,000	
		フジ・コーポレーション	8,000	1,136.00	9,088,000	
		ユナイテッドアローズ	15,900	1,793.00	28,508,700	
		ハイデイ日高	21,900	1,612.00	35,302,800	貸付有価証券 11,100株
		ＹＵ－ＷＡ　Ｃｒｅａｔｉｏｎ　Ｈｏｌｄｉ	8,900	202.00	1,797,800	
		コロワイド	62,400	1,578.00	98,467,200	貸付有価証券 24,200株（1,500株）
		ピーシーデポコーポレーション	17,600	295.00	5,192,000	貸付有価証券 1,800株
		壱番屋	10,700	4,535.00	48,524,500	貸付有価証券 100株
		トップカルチャー	5,500	277.00	1,523,500	
		ＰＬＡＮＴ	3,900	701.00	2,733,900	
		スギホールディングス	30,300	6,720.00	203,616,000	貸付有価証券

				200株
薬王堂ホールディングス	7,600	2,163.00	16,438,800	
スクロール	23,400	810.00	18,954,000	貸付有価証券 4,800株
ヨンドシーホールディングス	14,000	1,702.00	23,828,000	貸付有価証券 200株
木曽路	20,100	2,158.00	43,375,800	貸付有価証券 8,900株
ＳＲＳホールディングス	20,700	741.00	15,338,700	貸付有価証券 9,700株（900株）
千趣会	27,400	403.00	11,042,200	貸付有価証券 12,800株
タカキュー	11,700	110.00	1,287,000	貸付有価証券 5,400株
リテールパートナーズ	18,400	1,338.00	24,619,200	貸付有価証券 100株
ケーヨー	28,100	836.00	23,491,600	貸付有価証券 1,000株
上新電機	17,400	2,104.00	36,609,600	
日本瓦斯	73,900	1,500.00	110,850,000	貸付有価証券 500株
ロイヤルホールディングス	26,100	1,807.00	47,162,700	貸付有価証券 12,200株
東天紅	1,100	963.00	1,059,300	
いなげや	18,800	1,359.00	25,549,200	
チヨダ	14,800	753.00	11,144,400	貸付有価証券 6,700株（100株）
ライフコーポレーション	14,200	3,405.00	48,351,000	
リンガーハット	18,700	2,228.00	41,663,600	貸付有価証券 7,600株
ＭｒＭａｘＨＤ	19,000	590.00	11,210,000	
テンアライド	14,700	303.00	4,454,100	貸付有価証券 6,200株
ＡＯＫＩホールディングス	29,400	606.00	17,816,400	貸付有価証券 100株
オークワ	23,800	950.00	22,610,000	貸付有価証券 9,400株
コメリ	23,500	2,518.00	59,173,000	
青山商事	31,400	648.00	20,347,200	貸付有価証券 3,500株
しまむら	17,700	9,130.00	161,601,000	

はせがわ	8,000	288.00	2,304,000	
高島屋	110,700	1,054.00	116,677,800	貸付有価証券 900株
松屋	30,600	831.00	25,428,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	72,000	797.00	57,384,000	
近鉄百貨店	5,800	2,567.00	14,888,600	
丸井グループ	128,600	2,154.00	277,004,400	
アクシアル　リテイリング	11,800	3,340.00	39,412,000	
井筒屋	7,100	387.00	2,747,700	貸付有価証券 3,200株（1,400株）
イオン	584,800	2,683.50	1,569,310,800	貸付有価証券 8,600株
イズミ	27,500	3,210.00	88,275,000	貸付有価証券 200株
平和堂	28,000	1,901.00	53,228,000	貸付有価証券 13,100株
フジ	18,300	1,937.00	35,447,100	貸付有価証券 7,300株
ヤオコー	17,300	6,960.00	120,408,000	貸付有価証券 2,700株
ゼビオホールディングス	20,700	887.00	18,360,900	
ケーズホールディングス	140,100	1,104.00	154,670,400	貸付有価証券 2,300株
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,800	632.00	4,929,600	
日産東京販売ホールディングス	22,300	224.00	4,995,200	
シルバーライフ	3,100	1,271.00	3,940,100	貸付有価証券 1,400株（1,100株）
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,700	5,870.00	39,329,000	貸付有価証券 100株
ナルミヤ・インターナショナル	3,400	940.00	3,196,000	
ブックオフグループホールディングス	8,900	995.00	8,855,500	貸付有価証券 800株
ギフト	2,400	2,635.00	6,324,000	
アインホールディングス	22,100	5,710.00	126,191,000	貸付有価証券 1,000株
元気寿司	4,300	2,464.00	10,595,200	貸付有価証券 1,900株

ヤマダホールディングス	555,700	384.00	213,388,800	
アークランドサカモト	23,800	1,629.00	38,770,200	貸付有価証券 200株
ニトリホールディングス	60,300	16,965.00	1,022,989,500	貸付有価証券 100株
グルメ杵屋	12,100	978.00	11,833,800	貸付有価証券 4,800株
愛眼	11,100	175.00	1,942,500	貸付有価証券 100株
ケーユーホールディングス	7,900	1,130.00	8,927,000	
吉野家ホールディングス	53,000	2,300.00	121,900,000	貸付有価証券 100株
松屋フーズホールディングス	7,300	3,595.00	26,243,500	
サガミホールディングス	23,200	1,017.00	23,594,400	貸付有価証券 10,400株
関西スーパーマーケット	11,500	1,072.00	12,328,000	貸付有価証券 5,400株（3,700株）
王将フードサービス	10,000	5,980.00	59,800,000	
プレナス	17,000	1,943.00	33,031,000	
ミニストップ	11,300	1,391.00	15,718,300	
アークス	29,000	2,099.00	60,871,000	貸付有価証券 100株
バローホールディングス	33,600	2,125.00	71,400,000	
藤久	3,500	777.00	2,719,500	
ベルク	6,700	5,530.00	37,051,000	
大庄	8,100	942.00	7,630,200	貸付有価証券 2,300株
ファーストリテイリング	20,300	66,360.00	1,347,108,000	貸付有価証券 500株
サンドラッグ	57,200	2,948.00	168,625,600	貸付有価証券 200株
サックスバー　ホールディングス	14,300	508.00	7,264,400	貸付有価証券 100株
ヤマザワ	3,500	1,608.00	5,628,000	
やまや	3,100	2,423.00	7,511,300	貸付有価証券 700株
ベルーナ	32,600	674.00	21,972,400	貸付有価証券 1,400株
島根銀行	4,800	532.00	2,553,600	

じもとホールディングス	10,800	625.00	6,750,000	
めぶきフィナンシャルグループ	790,700	232.00	183,442,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,100	1,480.00	28,268,000	
九州フィナンシャルグループ	310,800	413.00	128,360,400	
ゆうちょ銀行	359,200	1,043.00	374,645,600	貸付有価証券 115,900株
富山第一銀行	36,300	283.00	10,272,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	869,200	419.00	364,194,800	貸付有価証券 2,400株
西日本フィナンシャルホールディングス	99,400	727.00	72,263,800	
三十三フィナンシャルグループ	14,100	1,455.00	20,515,500	
第四北越フィナンシャルグループ	24,800	2,470.00	61,256,000	
ひろぎんホールディングス	224,500	671.00	150,639,500	貸付有価証券 14,700株
おきなわフィナンシャルグループ	13,700	2,187.00	29,961,900	
十六フィナンシャルグループ	20,400	2,122.00	43,288,800	
北國フィナンシャルホールディングス	14,100	2,509.00	35,376,900	貸付有価証券 200株
新生銀行	99,300	1,842.00	182,910,600	貸付有価証券 13,900株（3,800株）
あおぞら銀行	85,000	2,516.00	213,860,000	貸付有価証券 200株
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,759,500	620.60	6,056,745,700	
りそなホールディングス	1,741,800	443.90	773,185,020	貸付有価証券 1,600株
三井住友トラスト・ホールディングス	287,600	3,827.00	1,100,645,200	貸付有価証券 700株
三井住友フィナンシャルグループ	1,053,400	3,925.00	4,134,595,000	貸付有価証券 30,800株
千葉銀行	507,900	655.00	332,674,500	貸付有価証券 3,100株
群馬銀行	292,300	345.00	100,843,500	貸付有価証券 1,100株

武蔵野銀行	22,700	1,729.00	39,248,300	貸付有価証券 500株
千葉興業銀行	35,800	250.00	8,950,000	貸付有価証券 100株
筑波銀行	59,300	169.00	10,021,700	貸付有価証券 100株
七十七銀行	47,700	1,305.00	62,248,500	
青森銀行	11,800	1,706.00	20,130,800	貸付有価証券 100株
秋田銀行	9,800	1,600.00	15,680,000	
山形銀行	17,100	836.00	14,295,600	
岩手銀行	10,000	1,790.00	17,900,000	
東邦銀行	127,000	207.00	26,289,000	
東北銀行	7,300	999.00	7,292,700	
みちのく銀行	9,800	783.00	7,673,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	128,200	1,922.00	246,400,400	貸付有価証券 2,700株
静岡銀行	370,600	824.00	305,374,400	貸付有価証券 26,800株
スルガ銀行	133,400	495.00	66,033,000	貸付有価証券 9,900株
八十二銀行	342,800	381.00	130,606,800	貸付有価証券 12,500株
山梨中央銀行	16,500	843.00	13,909,500	
大垣共立銀行	30,100	1,884.00	56,708,400	
福井銀行	13,000	1,361.00	17,693,000	
清水銀行	6,300	1,581.00	9,960,300	
富山銀行	2,700	1,755.00	4,738,500	
滋賀銀行	28,600	2,026.00	57,943,600	
南都銀行	23,700	1,881.00	44,579,700	貸付有価証券 100株
百五銀行	146,100	337.00	49,235,700	貸付有価証券 600株
京都銀行	54,500	4,895.00	266,777,500	貸付有価証券 2,300株
紀陽銀行	53,900	1,381.00	74,435,900	
ほくほくフィナンシャルグループ	95,000	864.00	82,080,000	貸付有価証券 400株
山陰合同銀行	90,200	638.00	57,547,600	
中国銀行	121,600	901.00	109,561,600	貸付有価証券

					1,100株
		鳥取銀行	4,800	1,129.00	5,419,200	
		伊予銀行	201,600	565.00	113,904,000	貸付有価証券 100株
		百十四銀行	16,200	1,463.00	23,700,600	
		四国銀行	23,100	755.00	17,440,500	
		阿波銀行	23,300	2,138.00	49,815,400	
		大分銀行	8,800	1,741.00	15,320,800	
		宮崎銀行	9,500	2,018.00	19,171,000	
		佐賀銀行	8,600	1,413.00	12,151,800	
		琉球銀行	33,000	756.00	24,948,000	
		セブン銀行	452,000	235.00	106,220,000	貸付有価証券 27,700株
		みずほフィナンシャルグループ	1,946,300	1,448.50	2,819,215,550	
		高知銀行	5,500	726.00	3,993,000	
		山口フィナンシャルグループ	177,300	655.00	116,131,500	
		長野銀行	5,000	1,162.00	5,810,000	
		名古屋銀行	11,400	2,710.00	30,894,000	
		北洋銀行	229,400	249.00	57,120,600	
		愛知銀行	5,500	3,745.00	20,597,500	貸付有価証券 200株
		中京銀行	5,500	1,597.00	8,783,500	
		大光銀行	5,200	1,271.00	6,609,200	
		愛媛銀行	21,200	816.00	17,299,200	
		トマト銀行	5,500	1,049.00	5,769,500	
		京葉銀行	64,900	448.00	29,075,200	
		栃木銀行	73,500	187.00	13,744,500	貸付有価証券 100株
		北日本銀行	4,700	1,531.00	7,195,700	
		東和銀行	26,700	516.00	13,777,200	
		福島銀行	17,400	226.00	3,932,400	貸付有価証券 200株
		大東銀行	7,300	752.00	5,489,600	
		トモニホールディングス	117,600	308.00	36,220,800	
		フィデアホールディングス	13,900	1,290.00	17,931,000	貸付有価証券 500株（400株）
		池田泉州ホールディング	175,000	165.00	28,875,000	貸付有価証券

		ス			1,300株
		ＦＰＧ	51,200	648.00	33,177,600 貸付有価証券 200株
		ジャパンインベストメントアドバイザー	11,800	1,281.00	15,115,800 貸付有価証券 5,500株
		マーキュリアホールディングス	6,000	563.00	3,378,000 貸付有価証券 1,900株（1,800株）
		ＳＢＩホールディングス	187,700	3,130.00	587,501,000 貸付有価証券 8,100株
		日本アジア投資	12,000	191.00	2,292,000
		ジャフコ　グループ	19,400	6,560.00	127,264,000
		大和証券グループ本社	1,139,700	648.40	738,981,480 貸付有価証券 700株
		野村ホールディングス	2,323,500	500.80	1,163,608,800
		岡三証券グループ	119,700	380.00	45,486,000 貸付有価証券 300株
		丸三証券	45,200	505.00	22,826,000 貸付有価証券 10,500株
		東洋証券	50,200	145.00	7,279,000 貸付有価証券 2,100株
		東海東京フィナンシャル・ホールディングス	174,800	395.00	69,046,000 貸付有価証券 200株
		光世証券	3,200	481.00	1,539,200
		水戸証券	40,600	263.00	10,677,800
		いちよし証券	28,500	655.00	18,667,500
		松井証券	74,500	774.00	57,663,000 貸付有価証券 700株
		マネックスグループ	124,100	722.00	89,600,200
		極東証券	20,400	737.00	15,034,800
		岩井コスモホールディングス	14,400	1,335.00	19,224,000 貸付有価証券 200株
		アイザワ証券グループ	25,000	1,032.00	25,800,000
		マネーパートナーズグループ	16,200	213.00	3,450,600
		スパークス・グループ	70,300	299.00	21,019,700 貸付有価証券 700株
		小林洋行	4,400	221.00	972,400
		かんぽ生命保険	153,200	1,825.00	279,590,000 貸付有価証券 100株
		ＳＯＭＰＯホールディングス	268,300	4,835.00	1,297,230,500 貸付有価証券 1,900株

アニコム　ホールディングス	46,700	802.00	37,453,400	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	341,200	3,540.00	1,207,848,000	
第一生命ホールディングス	749,100	2,303.00	1,725,177,300	貸付有価証券 4,400株
東京海上ホールディングス	501,200	6,348.00	3,181,617,600	
Ｔ＆Ｄホールディングス	395,000	1,466.00	579,070,000	貸付有価証券 14,900株
アドバンスクリエイト	7,300	1,076.00	7,854,800	貸付有価証券 3,200株
全国保証	36,300	4,930.00	178,959,000	貸付有価証券 1,200株
あんしん保証	4,500	287.00	1,291,500	
ジェイリース	5,100	1,989.00	10,143,900	貸付有価証券 2,300株
イントラスト	6,400	732.00	4,684,800	
日本モーゲージサービス	8,500	1,114.00	9,469,000	貸付有価証券 100株
Ｃａｓａ	5,300	917.00	4,860,100	貸付有価証券 1,800株
アルヒ	22,500	1,021.00	22,972,500	貸付有価証券 5,500株（5,300株）
プレミアグループ	7,700	3,610.00	27,797,000	
クレディセゾン	97,700	1,184.00	115,676,800	
芙蓉総合リース	16,000	7,950.00	127,200,000	
みずほリース	23,500	3,130.00	73,555,000	貸付有価証券 10,800株
東京センチュリー	29,500	5,560.00	164,020,000	貸付有価証券 400株
日本証券金融	59,800	950.00	56,810,000	
アイフル	255,400	351.00	89,645,400	貸付有価証券 400株
リコーリース	13,500	3,820.00	51,570,000	
イオンフィナンシャルサービス	82,800	1,234.00	102,175,200	貸付有価証券 1,900株
アコム	300,200	331.00	99,366,200	
ジャックス	16,800	2,950.00	49,560,000	
オリエントコーポレーション	411,700	123.00	50,639,100	貸付有価証券 8,300株

オリックス	923,900	2,293.00	2,118,502,700	貸付有価証券 100株
三菱ＨＣキャピタル	562,200	571.00	321,016,200	
九州リースサービス	7,500	572.00	4,290,000	貸付有価証券 1,600株（100株）
日本取引所グループ	385,400	2,506.50	966,005,100	貸付有価証券 700株
イー・ギャランティ	22,400	2,318.00	51,923,200	
アサックス	7,900	700.00	5,530,000	貸付有価証券 4,500株
ＮＥＣキャピタルソリューション	6,200	1,984.00	12,300,800	
いちご	169,500	274.00	46,443,000	貸付有価証券 500株
日本駐車場開発	166,900	136.00	22,698,400	貸付有価証券 2,400株
スター・マイカ・ホールディングス	8,200	1,314.00	10,774,800	
ＳＲＥホールディングス	3,700	7,310.00	27,047,000	
ＡＤワークスグループ	30,700	154.00	4,727,800	貸付有価証券 14,400株
ヒューリック	363,400	1,110.00	403,374,000	貸付有価証券 56,200株
三栄建築設計	6,100	1,683.00	10,266,300	
野村不動産ホールディングス	78,700	2,617.00	205,957,900	
三重交通グループホールディングス	30,800	477.00	14,691,600	貸付有価証券 13,700株
サムティ	24,500	2,173.00	53,238,500	貸付有価証券 9,600株
ディア・ライフ	19,600	534.00	10,466,400	
コーセーアールイー	4,500	698.00	3,141,000	貸付有価証券 500株
日本商業開発	9,600	1,777.00	17,059,200	貸付有価証券 4,500株
プレサンスコーポレーション	19,800	2,042.00	40,431,600	貸付有価証券 500株
ハウスコム	2,600	1,200.00	3,120,000	
日本管理センター	7,300	990.00	7,227,000	
サンセイランディック	4,500	818.00	3,681,000	貸付有価証券 700株（700株）

		エストラスト	1,800	631.00	1,135,800	
		フージャースホールディングス	19,500	658.00	12,831,000	
		オープンハウス	48,300	6,000.00	289,800,000	
		東急不動産ホールディングス	448,300	636.00	285,118,800	貸付有価証券 9,000株
		飯田グループホールディングス	126,900	2,576.00	326,894,400	
		イーグランド	2,400	1,505.00	3,612,000	
		ムゲンエステート	9,300	479.00	4,454,700	貸付有価証券 600株（600株）
		ビーロット	10,300	540.00	5,562,000	貸付有価証券 4,800株
		ファーストブラザーズ	3,500	883.00	3,090,500	貸付有価証券 1,500株
		ハウスドゥ	7,500	888.00	6,660,000	貸付有価証券 600株（600株）
		シーアールイー	4,200	1,646.00	6,913,200	貸付有価証券 1,400株
		プロパティエージェント	1,700	1,721.00	2,925,700	貸付有価証券 1,100株
		ケイアイスター不動産	6,800	8,210.00	55,828,000	
		アグレ都市デザイン	2,500	1,457.00	3,642,500	
		グッドコムアセット	6,600	1,060.00	6,996,000	
		ジェイ・エス・ビー	3,100	2,967.00	9,197,700	
		テンポイノベーション	4,200	878.00	3,687,600	
		グローバル・リンク・マネジメント	2,600	975.00	2,535,000	貸付有価証券 1,200株
		フェイスネットワーク	1,400	1,255.00	1,757,000	
		パーク２４	81,700	1,568.00	128,105,600	貸付有価証券 1,200株
		パラカ	3,900	1,559.00	6,080,100	貸付有価証券 1,700株
		三井不動産	693,800	2,277.00	1,579,782,600	貸付有価証券 900株
		三菱地所	999,900	1,579.50	1,579,342,050	
		平和不動産	26,100	3,800.00	99,180,000	貸付有価証券 900株
		東京建物	150,300	1,690.00	254,007,000	
		ダイビル	38,600	2,209.00	85,267,400	貸付有価証券

				300株
京阪神ビルディング	23,500	1,513.00	35,555,500	
住友不動産	319,300	3,378.00	1,078,595,400	貸付有価証券 1,500株
テーオーシー	27,400	650.00	17,810,000	貸付有価証券 200株
東京楽天地	2,500	3,985.00	9,962,500	
レオパレス２１	157,800	181.00	28,561,800	貸付有価証券 200株
スターツコーポレーション	20,700	2,483.00	51,398,100	
フジ住宅	17,700	675.00	11,947,500	
空港施設	15,200	545.00	8,284,000	
明和地所	7,200	567.00	4,082,400	
ゴールドクレスト	12,000	1,591.00	19,092,000	貸付有価証券 500株
エスリード	5,900	1,650.00	9,735,000	
日神グループホールディングス	24,700	491.00	12,127,700	貸付有価証券 9,300株
日本エスコン	28,300	801.00	22,668,300	貸付有価証券 600株（600株）
タカラレーベン	63,800	280.00	17,864,000	貸付有価証券 300株
ＡＶＡＮＴＩＡ	7,800	870.00	6,786,000	貸付有価証券 300株
イオンモール	76,300	1,622.00	123,758,600	
毎日コムネット	5,200	717.00	3,728,400	
ファースト住建	5,700	1,208.00	6,885,600	
カチタス	37,700	4,295.00	161,921,500	貸付有価証券 2,300株
トーセイ	21,000	992.00	20,832,000	
穴吹興産	3,300	1,890.00	6,237,000	
サンフロンティア不動産	21,000	985.00	20,685,000	
ＦＪネクストホールディングス	14,900	1,000.00	14,900,000	
インテリックス	3,400	625.00	2,125,000	
ランドビジネス	6,400	264.00	1,689,600	
サンネクスタグループ	4,800	1,051.00	5,044,800	
グランディハウス	10,300	475.00	4,892,500	貸付有価証券 100株

日本空港ビルデング	58,000	4,740.00	274,920,000	貸付有価証券 1,400株
明豊ファシリティワークス	6,700	818.00	5,480,600	
日本工営	8,700	3,165.00	27,535,500	
ＬＩＦＵＬＬ	45,000	235.00	10,575,000	貸付有価証券 2,300株
ミクシィ	33,700	2,012.00	67,804,400	
ジェイエイシーリクルートメント	11,900	2,170.00	25,823,000	
日本M&Aセンターホールディングス	241,800	2,706.00	654,310,800	
メンバーズ	4,400	2,408.00	10,595,200	
中広	2,400	397.00	952,800	
ＵＴグループ	21,300	4,185.00	89,140,500	貸付有価証券 800株（800株）
アイティメディア	7,000	1,818.00	12,726,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	7,700	1,207.00	9,293,900	貸付有価証券 3,400株
夢真ビーネックスグループ	39,200	1,634.00	64,052,800	貸付有価証券 200株
コシダカホールディングス	39,400	615.00	24,231,000	貸付有価証券 9,400株
アルトナー	3,600	835.00	3,006,000	
パソナグループ	16,000	3,275.00	52,400,000	
ＣＤＳ	3,600	1,611.00	5,799,600	
リンクアンドモチベーション	32,500	557.00	18,102,500	貸付有価証券 15,200株（5,500株）
エス・エム・エス	50,100	4,400.00	220,440,000	
サニーサイドアップグループ	5,100	723.00	3,687,300	貸付有価証券 300株（300株）
パーソルホールディングス	147,400	3,380.00	498,212,000	
リニカル	8,300	735.00	6,100,500	
クックパッド	46,300	246.00	11,389,800	貸付有価証券 2,200株
エスクリ	6,600	420.00	2,772,000	貸付有価証券 2,000株
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,200	596.00	4,291,200	
学情	6,000	1,052.00	6,312,000	貸付有価証券

					2,600株
		スタジオアリス	6,600	2,114.00	13,952,400	貸付有価証券 4,100株
		シミックホールディングス	8,200	1,500.00	12,300,000	
		エプコ	3,100	780.00	2,418,000	
		ＮＪＳ	3,200	1,943.00	6,217,600	
		綜合警備保障	58,700	4,555.00	267,378,500	貸付有価証券 100株
		カカクコム	108,200	3,120.00	337,584,000	貸付有価証券 200株
		セントケア・ホールディング	9,600	741.00	7,113,600	
		サイネックス	2,500	599.00	1,497,500	
		ルネサンス	10,200	1,100.00	11,220,000	
		ディップ	25,900	3,850.00	99,715,000	
		デジタルホールディングス	10,300	1,378.00	14,193,400	貸付有価証券 4,800株（4,800株）
		新日本科学	17,900	1,555.00	27,834,500	
		キャリアデザインセンター	3,700	945.00	3,496,500	
		ベネフィット・ワン	53,600	4,860.00	260,496,000	貸付有価証券 11,500株
		エムスリー	260,100	5,752.00	1,496,095,200	
		ツカダ・グローバルホールディング	9,400	289.00	2,716,600	貸付有価証券 4,400株（900株）
		ブラス	1,900	798.00	1,516,200	貸付有価証券 800株（800株）
		アウトソーシング	84,500	1,635.00	138,157,500	貸付有価証券 300株
		ウェルネット	14,900	435.00	6,481,500	貸付有価証券 600株
		ワールドホールディングス	5,900	2,555.00	15,074,500	
		ディー・エヌ・エー	56,100	1,762.00	98,848,200	貸付有価証券 100株
		博報堂ＤＹホールディングス	205,300	1,937.00	397,666,100	
		ぐるなび	24,200	427.00	10,333,400	貸付有価証券 2,300株
		タカミヤ	17,900	420.00	7,518,000	

		ジャパンベストレスキューシステム	10,000	1,028.00	10,280,000	
		ファンコミュニケーションズ	36,900	416.00	15,350,400	貸付有価証券 300株
		ライク	3,900	1,716.00	6,692,400	貸付有価証券 800株（800株）
		ビジネス・ブレークスルー	5,500	416.00	2,288,000	貸付有価証券 1,500株
		エスプール	41,600	1,184.00	49,254,400	
		WDBホールディングス	6,700	3,025.00	20,267,500	
		手間いらず	1,900	5,010.00	9,519,000	貸付有価証券 100株（100株）
		ティア	8,600	433.00	3,723,800	
		CDG	1,600	1,377.00	2,203,200	
		アドウェイズ	22,000	835.00	18,370,000	
		バリューコマース	11,600	4,410.00	51,156,000	
		インフォマート	161,600	955.00	154,328,000	貸付有価証券 500株
		JPホールディングス	37,900	235.00	8,906,500	貸付有価証券 300株
		レッグス	3,100	1,366.00	4,234,600	貸付有価証券 1,400株（300株）
		プレステージ・インターナショナル	55,300	650.00	35,945,000	
		アミューズ	8,000	2,017.00	16,136,000	
		ドリームインキュベータ	4,000	1,460.00	5,840,000	貸付有価証券 200株（100株）
		クイック	10,100	1,417.00	14,311,700	
		TAC	8,000	219.00	1,752,000	
		電通グループ	152,000	4,145.00	630,040,000	
		テイクアンドギヴ・ニーズ	6,900	962.00	6,637,800	
		ぴあ	5,100	3,345.00	17,059,500	貸付有価証券 2,100株
		イオンファンタジー	5,700	1,842.00	10,499,400	貸付有価証券 2,600株
		シーティーエス	16,600	788.00	13,080,800	
		ネクシィーズグループ	5,200	686.00	3,567,200	貸付有価証券 200株（200株）
		H．U．グループホール	38,500	2,903.00	111,765,500	

		ディングス				
		アルプス技研	13,000	1,912.00	24,856,000	
		ダイオーズ	2,900	1,008.00	2,923,200	貸付有価証券 1,300株
		日本空調サービス	15,400	804.00	12,381,600	
		オリエンタルランド	174,200	19,575.00	3,409,965,000	貸付有価証券 4,000株
		ダスキン	34,200	2,784.00	95,212,800	
		明光ネットワークジャパン	17,300	558.00	9,653,400	
		ファルコホールディングス	7,000	2,075.00	14,525,000	
		秀英予備校	3,200	405.00	1,296,000	貸付有価証券 1,400株
		ラウンドワン	41,200	1,372.00	56,526,400	貸付有価証券 500株
		リゾートトラスト	67,600	1,921.00	129,859,600	貸付有価証券 200株
		ビー・エム・エル	19,000	3,505.00	66,595,000	
		りらいあコミュニケーションズ	22,400	959.00	21,481,600	
		リソー教育	67,300	379.00	25,506,700	貸付有価証券 300株
		早稲田アカデミー	8,200	1,059.00	8,683,800	貸付有価証券 2,800株
		ユー・エス・エス	165,100	1,788.00	295,198,800	
		東京個別指導学院	13,000	615.00	7,995,000	貸付有価証券 200株
		サイバーエージェント	363,400	1,917.00	696,637,800	貸付有価証券 12,500株
		楽天グループ	757,200	1,135.00	859,422,000	貸付有価証券 48,600株
		クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,940.00	14,938,000	
		モーニングスター	25,800	622.00	16,047,600	貸付有価証券 100株
		テー・オー・ダブリュー	25,800	310.00	7,998,000	
		山田コンサルティンググループ	7,600	1,124.00	8,542,400	
		セントラルスポーツ	5,500	2,364.00	13,002,000	貸付有価証券 2,500株

フルキャストホールディングス	12,600	2,517.00	31,714,200	
エン・ジャパン	23,800	3,205.00	76,279,000	
リソルホールディングス	1,600	4,190.00	6,704,000	貸付有価証券 600株
テクノプロ・ホールディングス	88,300	3,440.00	303,752,000	
アトラグループ	3,300	333.00	1,098,900	貸付有価証券 2,000株
インターワークス	4,200	385.00	1,617,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,800	6,700.00	45,560,000	貸付有価証券 2,100株
ＫｅｅＰｅｒ技研	9,500	2,192.00	20,824,000	
ファーストロジック	2,800	797.00	2,231,600	
三機サービス	2,800	989.00	2,769,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	9,300	837.00	7,784,100	貸付有価証券 3,200株（900株）
デザインワン・ジャパン	3,600	182.00	655,200	貸付有価証券 200株
イー・ガーディアン	6,000	3,395.00	20,370,000	
リブセンス	8,100	181.00	1,466,100	
ジャパンマテリアル	45,300	1,902.00	86,160,600	
ベクトル	20,700	1,177.00	24,363,900	貸付有価証券 8,100株
ウチヤマホールディングス	7,200	298.00	2,145,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,000	1,391.00	15,301,000	
キャリアリンク	5,400	1,275.00	6,885,000	貸付有価証券 200株
ＩＢＪ	12,100	864.00	10,454,400	貸付有価証券 5,600株
アサンテ	6,500	1,692.00	10,998,000	貸付有価証券 2,300株
バリューＨＲ	5,900	2,709.00	15,983,100	貸付有価証券 2,700株
M&Aキャピタルパートナーズ	12,200	5,330.00	65,026,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,700	1,515.00	8,635,500	貸付有価証券 400株（300株）
ＥＲＩホールディングス	4,100	1,621.00	6,646,100	貸付有価証券

					500株（400株）
		アビスト	2,300	2,838.00	6,527,400	
		シグマクシス・ホールディングス	8,900	2,556.00	22,748,400	
		ウィルグループ	10,800	1,350.00	14,580,000	
		エスクロー・エージェント・ジャパン	19,700	162.00	3,191,400	
		メドピア	11,400	3,460.00	39,444,000	貸付有価証券 1,500株
		レアジョブ	2,800	831.00	2,326,800	貸付有価証券 200株（200株）
		リクルートホールディングス	1,137,400	6,925.00	7,876,495,000	
		エラン	20,300	1,110.00	22,533,000	貸付有価証券 100株
		土木管理総合試験所	6,800	324.00	2,203,200	
		ネットマーケティング	7,200	399.00	2,872,800	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
		日本郵政	1,925,300	883.00	1,700,039,900	貸付有価証券 7,100株
		ベルシステム２４ホールディングス	21,200	1,219.00	25,842,800	
		鎌倉新書	16,800	605.00	10,164,000	貸付有価証券 7,800株（2,600株）
		ＳＭＮ	3,200	631.00	2,019,200	
		一蔵	1,800	393.00	707,400	
		グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,700	759.00	2,049,300	
		エアトリ	9,500	3,210.00	30,495,000	貸付有価証券 3,300株（100株）
		アトラエ	10,300	2,484.00	25,585,200	
		ストライク	5,600	5,150.00	28,840,000	
		ソラスト	36,200	1,191.00	43,114,200	貸付有価証券 800株
		セラク	4,700	1,630.00	7,661,000	貸付有価証券 1,800株
		インソース	14,300	2,804.00	40,097,200	貸付有価証券 6,400株
		ベイカレント・コンサルティング	10,400	44,650.00	464,360,000	貸付有価証券 100株
		Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈ	2,800	3,485.00	9,758,000	

		ｏｌｄｉｎｇｓ				
		アイモバイル	4,200	1,255.00	5,271,000	貸付有価証券 1,900株（1,100株）
		キャリアインデックス	5,000	896.00	4,480,000	
		ＭＳ－Ｊａｐａｎ	6,000	906.00	5,436,000	
		船場	2,900	761.00	2,206,900	
		グレイステクノロジー	19,000	354.00	6,726,000	貸付有価証券 3,400株（3,400株）
		ジャパンエレベーターサービスホールディン	46,800	2,049.00	95,893,200	
		フルテック	2,100	1,430.00	3,003,000	貸付有価証券 900株
		グリーンズ	5,600	548.00	3,068,800	貸付有価証券 2,600株
		ツナググループ・ホールディングス	3,300	253.00	834,900	貸付有価証券 100株
		ＧａｍｅＷｉｔｈ	4,400	454.00	1,997,600	
		ソウルドアウト	3,500	1,240.00	4,340,000	
		ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,100	735.00	1,543,500	
		ウェルビー	9,700	1,282.00	12,435,400	
		エル・ティー・エス	1,900	2,728.00	5,183,200	貸付有価証券 800株（800株）
		ミダックホールディングス	6,400	4,220.00	27,008,000	貸付有価証券 2,800株
		日総工産	11,500	851.00	9,786,500	貸付有価証券 400株
		キュービーネットホールディングス	6,800	1,744.00	11,859,200	
		ＲＰＡホールディングス	20,700	327.00	6,768,900	貸付有価証券 300株
		スプリックス	4,200	1,773.00	7,446,600	
		マネジメントソリューションズ	7,200	3,285.00	23,652,000	
		プロレド・パートナーズ	3,200	1,003.00	3,209,600	貸付有価証券 1,400株（1,400株）
		ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	3,300	399.00	1,316,700	貸付有価証券 100株（100株）
		テノ．ホールディングス	1,800	575.00	1,035,000	
		フロンティア・マネジメント	3,800	729.00	2,770,200	貸付有価証券 1,700株（500株）

ピアラ	2,400	610.00	1,464,000	貸付有価証券 300株（200株）
コプロ・ホールディングス	2,900	1,247.00	3,616,300	
ギークス	2,500	1,723.00	4,307,500	
カーブスホールディングス	40,500	784.00	31,752,000	
フォーラムエンジニアリング	10,200	803.00	8,190,600	貸付有価証券 100株
ダイレクトマーケティングミックス	8,000	3,365.00	26,920,000	貸付有価証券 400株（200株）
ポピンズホールディングス	3,400	2,940.00	9,996,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	11,900	4,125.00	49,087,500	貸付有価証券 100株
アドバンテッジリスクマネジメント	7,500	696.00	5,220,000	
リログループ	80,600	2,030.00	163,618,000	貸付有価証券 800株
東祥	11,000	1,649.00	18,139,000	貸付有価証券 4,200株
ＴＲＥホールディングス	20,200	1,655.00	33,431,000	
人・夢・技術グループ	5,900	1,820.00	10,738,000	
エイチ・アイ・エス	32,700	1,909.00	62,424,300	貸付有価証券 15,300株（4,800株）
ラックランド	4,200	3,015.00	12,663,000	貸付有価証券 1,900株
共立メンテナンス	26,300	4,100.00	107,830,000	貸付有価証券 2,300株（800株）
イチネンホールディングス	15,100	1,295.00	19,554,500	
建設技術研究所	8,800	2,390.00	21,032,000	
スペース	10,500	915.00	9,607,500	
燦ホールディングス	6,400	1,506.00	9,638,400	
スバル興業	900	8,840.00	7,956,000	貸付有価証券 400株
東京テアトル	5,800	1,201.00	6,965,800	貸付有価証券 2,600株
タナベ経営	5,700	670.00	3,819,000	
ナガワ	4,700	10,720.00	50,384,000	貸付有価証券 2,200株

東京都競馬	11,000	4,150.00	45,650,000	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
常磐興産	5,900	1,359.00	8,018,100	貸付有価証券 2,600株
カナモト	26,000	2,341.00	60,866,000	貸付有価証券 11,700株
西尾レントオール	13,600	2,804.00	38,134,400	
トランス・コスモス	18,700	3,170.00	59,279,000	貸付有価証券 4,100株（2,100株）
乃村工藝社	63,200	960.00	60,672,000	
藤田観光	6,400	2,448.00	15,667,200	貸付有価証券 3,000株
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	9,200	1,413.00	12,999,600	貸付有価証券 4,500株
日本管財	15,800	2,817.00	44,508,600	
トーカイ	12,900	1,934.00	24,948,600	
白洋舎	1,700	1,600.00	2,720,000	貸付有価証券 700株
セコム	145,300	7,936.00	1,153,100,800	
セントラル警備保障	7,100	2,347.00	16,663,700	
丹青社	30,200	770.00	23,254,000	
メイテック	17,800	6,570.00	116,946,000	
応用地質	16,600	2,051.00	34,046,600	
船井総研ホールディングス	30,200	2,534.00	76,526,800	貸付有価証券 14,100株
進学会ホールディングス	4,800	273.00	1,310,400	貸付有価証券 900株
オオバ	10,300	792.00	8,157,600	貸付有価証券 4,600株
いであ	4,000	1,857.00	7,428,000	貸付有価証券 1,800株（100株）
学究社	4,700	1,512.00	7,106,400	
ベネッセホールディングス	49,100	2,221.00	109,051,100	
イオンディライト	18,200	3,265.00	59,423,000	
ナック	7,000	953.00	6,671,000	貸付有価証券 100株
ダイセキ	27,200	5,040.00	137,088,000	貸付有価証券 100株
ステップ	5,400	1,883.00	10,168,200	

	小計	銘柄数：2,165 組入時価比率：98.6%			418,121,205,870 100.0%	
合計					418,121,205,870	

(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12月27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12月27日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 株価指数先物取引 買建	5,998,579,903	－	6,105,840,000	107,107,142
合計	5,998,579,903	－	6,105,840,000	107,107,142

（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12月27日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	12,295,085,911
コール・ローン	833,078,061
株式	1,165,664,791,327
投資証券	28,013,308,362
派生商品評価勘定	287,150,038
未収入金	9,473,523
未収配当金	849,731,484
差入委託証拠金	7,040,669,165
流動資産合計	1,214,993,287,871

	(2021年12月27日現在)
資産合計	1,214,993,287,871
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	930,721
未払解約金	175,804,248
未払利息	407
その他未払費用	3,272,200
流動負債合計	180,007,576
負債合計	180,007,576
純資産の部	
元本等	
元本	266,083,698,954
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	948,729,581,341
元本等合計	1,214,813,280,295
純資産合計	1,214,813,280,295
負債純資産合計	1,214,993,287,871

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

（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12月27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	4.5655円
(10,000口当たり純資産額)	(45,655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12月29日 至 2021年12月27日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○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12月27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12月27日現在	
期首	2020年12月29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	238,838,088,958円
同期中における追加設定元本額	56,613,323,020円
同期中における一部解約元本額	29,367,713,024円
期末元本額	266,083,698,954円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	30,873,638円
バランスセレクト５０	96,264,045円
バランスセレクト７０	115,520,877円
野村外国株式インデックスファンド	490,346,862円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,134,421,896円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	4,044,031,232円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	3,638,716,987円
野村資産設計ファンド２０１５	9,885,645円
野村資産設計ファンド２０２０	9,884,647円
野村資産設計ファンド２０２５	17,963,027円
野村資産設計ファンド２０３０	25,744,100円
野村資産設計ファンド２０３５	21,936,807円
野村資産設計ファンド２０４０	42,087,448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）	45,351,844,950円
のむラップ・ファンド（保守型）	773,317,723円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,817,304,985円
のむラップ・ファンド（積極型）	8,124,325,290円
野村資産設計ファンド２０４５	7,748,585円
野村インデックスファンド・外国株式	6,658,567,768円
マイ・ロード	945,646,944円
ネクストコア	8,730,620円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	133,893,976円
野村外国株インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	2,101,987,678円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	511,737,924円
野村資産設計ファンド２０５０	10,310,416円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型	3,306,462円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型	1,778,631円

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型	1,383,281円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型	1,147,391円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	203,333,809円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	677,607,881円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	3,080,828円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,994,461円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	32,802,445円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	8,724,175円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	39,319,153円
野村６資産均等バランス	1,157,169,830円
野村つみたて外国株投信	9,511,879,785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）	4,656,275,036円
世界６資産分散ファンド	36,106,745円
野村資産設計ファンド２０６０	6,696,853円
野村スリーゼロ先進国株式投信	526,274,009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	5,371,374,916円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	4,462,827,738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）	136,261,001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）	65,876,074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）	630,376,638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）	897,236,742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）	1,309,733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）	4,620,327円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡ積極型（適格機関投資家専用）	1,139,442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）	1,103,058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）	19,012,415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）	377,891,226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）	5,050,821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）	27,949,380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）	89,922,878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）	2,243,232,771円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	21,531,865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）	191,801,137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）	11,674,074,158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）	1,144,532円
先進８ヵ国国債入替型プラス外国株式戦略２０オープン（部分為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	4,487,122円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	1,401,616円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	8,841,006円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	8,644,754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）	83,284,584,811円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	2,069,256,540円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	7,701,199,888円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	7,380,261,652円

マイバランスＤＣ３０	761,711,429円
マイバランスＤＣ５０	1,730,429,872円
マイバランスＤＣ７０	1,521,901,721円
野村ＤＣ外国株式インデックスファンド・ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ	31,573,380,265円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	233,234,694円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	17,997,739円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	359,681,284円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	295,078,054円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	283,512,900円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	15,809,785円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	7,103,195円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	38,655,775円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	6,708,855円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	5,867,128円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	4,636,028円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	148,884,448円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	116,723,455円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	68,470,161円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	96,969,211円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	3,291,469円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	22,637,992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）	95,615,485円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	8,923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12月27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	151,000	24.22	3,657,220.00	
		HALLIBURTON CO	160,000	22.71	3,633,600.00	
		SCHLUMBERGER LTD	251,000	29.57	7,422,070.00	
		CHENIERE ENERGY INC	44,200	103.95	4,594,590.00	
		CHEVRON CORP	348,000	116.41	40,510,680.00	
		CONOCOPHILLIPS	240,500	71.19	17,121,195.00	
		COTERRA ENERGY INC	136,000	19.39	2,637,040.00	
		DEVON ENERGY CORP	116,000	42.05	4,877,800.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	30,600	105.94	3,241,764.00	

	EOG RESOURCES INC	106,000	87.18	9,241,080.00	
	EXXON MOBIL CORP	761,900	61.02	46,491,138.00	
	HESS CORP	50,200	73.49	3,689,198.00	
	KINDER MORGAN INC	372,000	15.64	5,818,080.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	117,000	63.04	7,375,680.00	
	OCCIDENTAL PETE CORP	166,000	28.85	4,789,100.00	
	ONEOK INC	78,300	58.02	4,542,966.00	
	PHILLIPS 66	80,000	71.90	5,752,000.00	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	41,200	180.03	7,417,236.00	
	VALERO ENERGY CORP	73,600	71.73	5,279,328.00	
	WILLIAMS COS	218,000	25.85	5,635,300.00	
	AIR PRODUCTS	40,100	299.48	12,009,148.00	
	ALBEMARLE CORP	20,800	227.90	4,740,320.00	
	CELANESE CORP-SERIES A	19,500	161.32	3,145,740.00	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	39,300	72.30	2,841,390.00	
	CORTEVA INC	134,000	46.44	6,222,960.00	
	DOW INC	132,600	55.14	7,311,564.00	
	DUPONT DE NEMOURS INC	93,900	78.54	7,374,906.00	
	EASTMAN CHEMICAL CO.	25,000	117.39	2,934,750.00	
	ECOLAB INC	46,000	228.24	10,499,040.00	
	FMC CORP	23,200	109.12	2,531,584.00	
	INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	45,400	143.09	6,496,286.00	
	LINDE PLC	92,900	339.17	31,508,893.00	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	47,200	90.55	4,273,960.00	
	MOSAIC CO/THE	69,000	39.18	2,703,420.00	
	PPG INDUSTRIES	42,800	167.06	7,150,168.00	
	RPM INTERNATIONAL INC	23,500	97.51	2,291,485.00	
	SHERWIN-WILLIAMS	44,800	338.38	15,159,424.00	
	MARTIN MARIETTA MATERIALS	11,100	437.06	4,851,366.00	
	VULCAN MATERIALS CO	23,500	206.36	4,849,460.00	
	AMCOR PLC	268,000	11.66	3,124,880.00	
	AVERY DENNISON CORP	14,600	208.47	3,043,662.00	
	BALL CORP	59,700	90.00	5,373,000.00	
	CROWN HOLDINGS INC	24,700	105.69	2,610,543.00	
	IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	67,500	45.84	3,094,200.00	

PACKAGING CORP OP AMERICA	17,700	131.30	2,324,010.00	
SEALED AIR CORP	26,500	65.39	1,732,835.00	
WESTROCK CO	47,300	43.00	2,033,900.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	266,000	41.13	10,940,580.00	
NEWMONT CORP	143,600	59.53	8,548,508.00	
NUCOR CORP	53,200	114.30	6,080,760.00	
STEEL DYNAMICS	37,100	61.65	2,287,215.00	
BOEING CO	100,600	204.22	20,544,532.00	
GENERAL DYNAMICS	42,400	204.69	8,678,856.00	
HEICO CORP	7,900	142.28	1,124,012.00	
HEICO CORP-CLASS A	12,300	128.64	1,582,272.00	
HOWMET AEROSPACE INC	72,000	31.13	2,241,360.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	7,500	182.21	1,366,575.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	36,400	208.26	7,580,664.00	
LOCKHEED MARTIN	45,100	347.02	15,650,602.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	27,100	381.17	10,329,707.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	271,400	84.90	23,041,860.00	
TEXTRON INC	40,700	75.91	3,089,537.00	
TRANSDIGM GROUP INC	9,370	628.00	5,884,360.00	
ALLEGION PLC	16,300	127.28	2,074,664.00	
CARRIER GLOBAL CORP	147,900	52.82	7,812,078.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	25,600	102.75	2,630,400.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	128,300	78.11	10,021,513.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	316.11	1,801,827.00	
MASCO CORP	45,800	68.00	3,114,400.00	
OWENS CORNING INC	18,900	88.83	1,678,887.00	
SMITH (A.O.) CORP	24,700	82.77	2,044,419.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	42,900	197.30	8,464,170.00	
AMETEK INC	42,200	142.57	6,016,454.00	
EATON CORP PLC	72,200	168.04	12,132,488.00	
EMERSON ELEC	108,500	91.28	9,903,880.00	
GENERAC HOLDINGS INC	11,600	351.29	4,074,964.00	
PLUG POWER INC	94,000	29.40	2,763,600.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	21,100	340.12	7,176,532.00	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	28,300	59.84	1,693,472.00	
SUNRUN INC	29,200	34.65	1,011,780.00	
3M CORP	104,600	174.97	18,301,862.00	
GENERAL ELECTRIC CO	198,400	94.00	18,649,600.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	124,200	205.22	25,488,324.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	38,300	55.69	2,132,927.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	19,000	478.33	9,088,270.00	
CATERPILLAR INC DEL	98,000	206.20	20,207,600.00	
CUMMINS INC	25,800	213.97	5,520,426.00	
DEERE & COMPANY	53,000	349.22	18,508,660.00	
DOVER CORP	25,600	173.74	4,447,744.00	
FORTIVE CORP	61,700	74.50	4,596,650.00	
IDEX CORP	13,300	230.64	3,067,512.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	56,400	240.50	13,564,200.00	
INGERSOLL-RAND INC	72,500	59.74	4,331,150.00	
KORNIT DIGITAL LTD	8,200	143.66	1,178,012.00	
NORDSON CORP	9,600	253.66	2,435,136.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	72,400	85.25	6,172,100.00	
PACCAR	63,400	84.95	5,385,830.00	
PARKER HANNIFIN CORP	23,200	311.89	7,235,848.00	
PENTAIR PLC	30,000	71.22	2,136,600.00	
SNAP-ON INC	9,700	209.94	2,036,418.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	29,500	182.20	5,374,900.00	
WABTEC CORP	31,800	89.85	2,857,230.00	
XYLEM INC	32,000	117.50	3,760,000.00	
FASTENAL CO	104,700	62.59	6,553,173.00	
GRAINGER(W.W.) INC	7,940	503.01	3,993,899.40	
UNITED RENTALS INC	12,900	331.73	4,279,317.00	
CINTAS CORP	16,600	435.00	7,221,000.00	
COPART INC	38,900	146.18	5,686,402.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	40,300	135.42	5,457,426.00	
ROLLINS INC	41,000	32.78	1,343,980.00	
WASTE CONNECTIONS INC	46,200	132.19	6,107,178.00	
WASTE MANAGEMENT INC	76,300	161.94	12,356,022.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	24,300	102.45	2,489,535.00	

EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	30,600	130.76	4,001,256.00	
FEDEX CORPORATION	45,900	253.82	11,650,338.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	131,100	212.19	27,818,109.00	
DELTA AIR LINES INC	30,000	39.30	1,179,000.00	
SOUTHWEST AIRLINES	24,900	41.87	1,042,563.00	
AMERCO	1,720	716.69	1,232,706.80	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	45,855	71.25	3,267,168.75	
CSX CORP	406,000	36.79	14,936,740.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	14,600	197.23	2,879,558.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	26,700	58.95	1,573,965.00	
LYFT INC-A	46,900	44.18	2,072,042.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	44,300	287.53	12,737,579.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	17,400	348.31	6,060,594.00	
UBER TECHOLOGIES INC	223,000	43.91	9,791,930.00	
UNION PAC CORP	117,400	245.64	28,838,136.00	
APTIV PLC	48,500	162.40	7,876,400.00	
BORGWARNER INC	45,000	43.62	1,962,900.00	
LEAR CORP	10,900	180.02	1,962,218.00	
FORD MOTOR COMPANY	703,000	20.25	14,235,750.00	
GENERAL MOTORS CO	236,500	56.91	13,459,215.00	
LUCID GROUP INC	72,100	37.64	2,713,844.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	30,800	96.84	2,982,672.00	
TESLA INC	151,440	1,067.00	161,586,480.00	
DR HORTON INC	60,800	104.92	6,379,136.00	
GARMIN LTD	27,300	134.48	3,671,304.00	
LENNAR CORP-A	48,400	112.05	5,423,220.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	171.16	1,745,832.00	
NEWELL BRANDS INC	66,000	21.41	1,413,060.00	
NVR INC	607	5,784.63	3,511,270.41	
PULTEGROUP INC	47,000	54.65	2,568,550.00	
WHIRLPOOL CORP	11,300	227.27	2,568,151.00	
HASBRO INC	23,400	97.92	2,291,328.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	52,000	38.59	2,006,680.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	21,300	391.56	8,340,228.00	

NIKE INC-B	230,000	165.67	38,104,100.00	
V F CORP	58,800	69.45	4,083,660.00	
AIRBNB INC-CLASS A	42,400	171.31	7,263,544.00	
ARAMARK	39,000	36.05	1,405,950.00	
BOOKING HOLDINGS INC	7,430	2,402.25	17,848,717.50	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	37,400	94.76	3,544,024.00	
CARNIVAL CORP	149,000	21.20	3,158,800.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,040	1,748.67	8,813,296.80	
DARDEN RESTAURANTS INC	23,400	148.84	3,482,856.00	
DOMINOS PIZZA INC	6,900	545.84	3,766,296.00	
DRAFTKINGS INC - CL A	58,400	29.44	1,719,296.00	
EXPEDIA GROUP INC	26,700	183.78	4,906,926.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	50,000	154.71	7,735,500.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	64,000	38.59	2,469,760.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	49,600	165.19	8,193,424.00	
MCDONALD'S CORP	134,400	265.95	35,743,680.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	10.44	354,960.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	45.74	3,247,540.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	41,100	79.53	3,268,683.00	
STARBUCKS CORP	212,200	112.37	23,844,914.00	
VAIL RESORTS INC	7,400	332.23	2,458,502.00	
WYNN RESORTS LTD	19,300	88.88	1,715,384.00	
YUM BRANDS INC	52,700	135.34	7,132,418.00	
GENUINE PARTS CO	25,200	135.37	3,411,324.00	
LKQ CORP	49,000	57.73	2,828,770.00	
POOL CORP	7,360	549.65	4,045,424.00	
AMAZON.COM INC	82,020	3,421.37	280,620,767.40	
CHEWY INC - CLASS A	15,100	59.26	894,826.00	
DOORDASH INC-A	19,600	153.68	3,012,128.00	
EBAY INC	117,000	64.89	7,592,130.00	
ETSY INC	23,200	228.09	5,291,688.00	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	5,200	117.27	609,804.00	
MERCADOLIBRE INC	8,010	1,262.73	10,114,467.30	
WAYFAIR INC - CLASS A	13,100	204.37	2,677,247.00	
DOLLAR GENERAL CORP	41,900	221.33	9,273,727.00	

DOLLAR TREE INC	40,700	137.00	5,575,900.00	
TARGET CORP	87,800	221.01	19,404,678.00	
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	232.13	2,785,560.00	
AUTOZONE	3,850	2,014.50	7,755,825.00	
BATH & BODY WORKS INC	47,000	69.50	3,266,500.00	
BEST BUY COMPANY INC	40,700	98.08	3,991,856.00	
BURLINGTON STORES INC	12,100	287.19	3,474,999.00	
CARMAX INC	29,500	126.31	3,726,145.00	
CARVANA CO	13,800	240.78	3,322,764.00	
HOME DEPOT	189,900	397.07	75,403,593.00	
LOWES COS INC	124,600	250.09	31,161,214.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	12,390	679.42	8,418,013.80	
ROSS STORES INC	64,000	110.16	7,050,240.00	
TJX COS INC	215,100	73.75	15,863,625.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	20,600	228.27	4,702,362.00	
ULTA BEAUTY INC	9,400	392.37	3,688,278.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	79,550	550.37	43,781,933.50	
KROGER CO	128,000	43.21	5,530,880.00	
SYSCO CORP	93,200	76.65	7,143,780.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	134,000	50.48	6,764,320.00	
WALMART INC	277,300	139.49	38,680,577.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	55,500	71.72	3,980,460.00	
COCA COLA CO	738,600	58.22	43,001,292.00	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	36,300	55.23	2,004,849.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	30,100	244.04	7,345,604.00	
KEURIG DR PEPPER INC	125,000	35.94	4,492,500.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	35,000	45.59	1,595,650.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	72,300	93.84	6,784,632.00	
PEPSICO INC	248,700	169.78	42,224,286.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	101,900	65.44	6,668,336.00	
BUNGE LIMITED	24,700	90.16	2,226,952.00	
CAMPBELL SOUP CO	36,000	41.96	1,510,560.00	
CONAGRA BRANDS INC	87,000	33.33	2,899,710.00	
GENERAL MILLS	110,400	65.99	7,285,296.00	
HERSHEY CO/THE	26,400	188.46	4,975,344.00	

HORMEL FOODS CORP	55,000	47.77	2,627,350.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	20,100	132.99	2,673,099.00	
KELLOGG CO	46,300	62.87	2,910,881.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	120,000	35.25	4,230,000.00	
MCCORMICK & CO INC.	45,700	93.03	4,251,471.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	250,500	64.94	16,267,470.00	
TYSON FOODS INC-CL A	52,500	85.22	4,474,050.00	
ALTRIA GROUP INC	334,000	46.70	15,597,800.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	280,500	92.93	26,066,865.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	45,000	99.53	4,478,850.00	
CLOROX CO	22,500	169.83	3,821,175.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	145,200	82.79	12,021,108.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	60,400	138.89	8,388,956.00	
PROCTER & GAMBLE CO	437,000	160.10	69,963,700.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	41,800	365.99	15,298,382.00	
ABBOTT LABORATORIES	319,000	139.16	44,392,040.00	
ABIOMED INC	8,000	352.21	2,817,680.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	13,320	653.98	8,711,013.60	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	91,000	85.55	7,785,050.00	
BECTON,DICKINSON	51,400	248.91	12,793,974.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	258,000	42.72	11,021,760.00	
DENTSPLY SIRONA INC	38,400	55.43	2,128,512.00	
DEXCOM INC	17,560	572.01	10,044,495.60	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	112,900	128.57	14,515,553.00	
HOLOGIC INC	46,100	76.12	3,509,132.00	
IDEXX LABORATORIES INC	15,450	645.02	9,965,559.00	
INMODE LTD	8,800	72.07	634,216.00	
INSULET CORP	12,500	273.26	3,415,750.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	64,230	363.94	23,375,866.20	
MASIMO CORP	9,300	293.34	2,728,062.00	
MEDTRONIC PLC	242,100	102.90	24,912,090.00	
NOVOCURE LTD	16,400	84.00	1,377,600.00	
RESMED INC	26,500	258.82	6,858,730.00	
STERIS PLC	18,300	241.07	4,411,581.00	
STRYKER CORP	61,400	268.25	16,470,550.00	

TELEFLEX INC	8,100	327.38	2,651,778.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	8,800	411.21	3,618,648.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	38,200	126.99	4,851,018.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	27,300	129.53	3,536,169.00	
ANTHEM INC	44,100	455.71	20,096,811.00	
CARDINAL HEALTH INC	51,400	50.75	2,608,550.00	
CENTENE CORP	104,600	84.72	8,861,712.00	
CIGNA CORP	60,700	225.89	13,711,523.00	
CVS HEALTH CORP	237,500	101.31	24,061,125.00	
DAVITA INC	12,500	111.42	1,392,750.00	
HCA HEALTHCARE INC	46,000	252.05	11,594,300.00	
HENRY SCHEIN INC	25,700	74.93	1,925,701.00	
HUMANA INC	23,300	460.54	10,730,582.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	17,600	301.91	5,313,616.00	
MCKESSON CORP	27,700	240.78	6,669,606.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	10,400	316.73	3,293,992.00	
OAK STREET HEALTH INC	16,300	35.10	572,130.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	22,300	167.05	3,725,215.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	169,700	495.38	84,065,986.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	14,400	128.13	1,845,072.00	
ABBVIE INC	318,000	133.09	42,322,620.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	21,600	194.35	4,197,960.00	
AMGEN INC	102,200	223.79	22,871,338.00	
BIOGEN INC	26,700	235.41	6,285,447.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	33,400	91.16	3,044,744.00	
EXACT SCIENCES CORP	29,600	78.12	2,312,352.00	
GILEAD SCIENCES INC	226,800	72.48	16,438,464.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	38,600	108.51	4,188,486.00	
INCYTE CORP	33,700	73.47	2,475,939.00	
MODERNA INC	62,000	249.99	15,499,380.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,000	85.09	1,446,530.00	
NOVAVAX INC	13,000	177.25	2,304,250.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	18,850	625.38	11,788,413.00	
SEAGEN INC	24,400	158.54	3,868,376.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	47,100	223.45	10,524,495.00	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	399,900	62.05	24,813,795.00	
CATALENT INC	30,200	124.96	3,773,792.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	74,000	28.88	2,137,120.00	
ELI LILLY & CO.	146,300	273.10	39,954,530.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	10,600	128.19	1,358,814.00	
JOHNSON & JOHNSON	473,700	168.25	79,700,025.00	
MERCK & CO INC	455,500	75.73	34,495,015.00	
PFIZER INC	1,009,000	58.71	59,238,390.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	63,000	40.25	2,535,750.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	195,000	8.46	1,649,700.00	
VIATRIS INC	215,000	13.63	2,930,450.00	
ZOETIS INC	84,800	242.51	20,564,848.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,363,000	44.42	60,544,460.00	
CITIGROUP	364,700	60.21	21,958,587.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	74,400	46.63	3,469,272.00	
FIFTH THIRD BANCORP	127,000	43.07	5,469,890.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	31,300	203.91	6,382,383.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	271,000	15.26	4,135,460.00	
JPMORGAN CHASE & CO	537,700	157.26	84,558,702.00	
KEYCORP	170,000	22.74	3,865,800.00	
M & T BANK CORP	23,200	150.95	3,502,040.00	
PNC FINANCIAL	76,900	197.93	15,220,817.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	172,000	21.52	3,701,440.00	
SIGNATURE BANK	10,800	319.73	3,453,084.00	
SVB FINANCIAL GROUP	10,570	674.76	7,132,213.20	
TRUIST FINANCIAL CORP	241,600	57.77	13,957,232.00	
US BANCORP	254,900	56.31	14,353,419.00	
WELLS FARGO CO	738,600	48.36	35,718,696.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	238,500	294.49	70,235,865.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	69,000	32.96	2,274,240.00	
AFLAC INC	113,000	57.69	6,518,970.00	
ALLEGHANY CORP	2,590	652.83	1,690,829.70	
ALLSTATE CORP	53,200	114.13	6,071,716.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	135.40	1,692,500.00	
AMERICAN INTL GROUP	153,600	56.57	8,689,152.00	

		AON PLC	40,300	292.41	11,784,123.00	
		ARCH CAPITAL GROUP LTD	71,000	43.48	3,087,080.00	
		ARTHUR J GALLAGHER & CO	36,800	166.45	6,125,360.00	
		ASSURANT INC	10,200	152.28	1,553,256.00	
		ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	24,500	85.21	2,087,645.00	
		BROWN & BROWN INC	42,700	68.03	2,904,881.00	
		CHUBB LTD	78,600	190.64	14,984,304.00	
		CINCINNATI FINANCIAL CORP	26,700	112.34	2,999,478.00	
		ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,400	190.16	836,704.00	
		EVEREST RE GROUP LTD	7,100	267.02	1,895,842.00	
		FNF GROUP	50,000	50.90	2,545,000.00	
		GLOBE LIFE INC	17,700	92.70	1,640,790.00	
		HARTFORD FINANCIAL SERVICES	62,200	68.27	4,246,394.00	
		LINCOLN NATIONAL CORP	33,200	67.87	2,253,284.00	
		LOEWS CORP	38,500	57.02	2,195,270.00	
		MARKEL CORP	2,500	1,208.69	3,021,725.00	
		MARSH & MCLENNAN COS	91,700	170.57	15,641,269.00	
		METLIFE INC	132,100	61.78	8,161,138.00	
		PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	48,000	71.58	3,435,840.00	
		PROGRESSIVE CO	106,200	101.25	10,752,750.00	
		PRUDENTIAL FINANCIAL INC	70,600	108.25	7,642,450.00	
		TRAVELERS COS INC/THE	45,400	154.65	7,021,110.00	
		WILLIS TOWERS WATSON PLC	22,800	236.46	5,391,288.00	
		WR BERKLEY CORP	26,600	80.17	2,132,522.00	
		ACCENTURE PLC-CL A	114,100	403.31	46,017,671.00	
		AFFIRM HOLDINGS INC	15,600	101.16	1,578,096.00	
		AKAMAI TECHNOLOGIES	29,200	116.20	3,393,040.00	
		AUTOMATIC DATA PROCESS	76,500	242.00	18,513,000.00	
		BLOCK INC	71,200	167.71	11,940,952.00	
		BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	20,600	180.29	3,713,974.00	
		CLOUDFLARE INC - CLASS A	42,700	137.27	5,861,429.00	
		COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	94,600	86.29	8,163,034.00	
		EPAM SYSTEMS INC	10,310	663.08	6,836,354.80	
		FIDELITY NATIONAL INFORMATION	111,900	109.05	12,202,695.00	
		FISERV INC	107,200	105.54	11,313,888.00	

		FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	14,200	223.69	3,176,398.00
		GARTNER INC	15,300	325.53	4,980,609.00
		GLOBAL PAYMENTS INC	53,500	135.37	7,242,295.00
		GODADDY INC - CLASS A	29,600	76.00	2,249,600.00
		INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	160,400	130.63	20,953,052.00
		JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12,700	165.43	2,100,961.00
		MASTERCARD INC	158,500	360.58	57,151,930.00
		MONGODB INC	10,510	551.11	5,792,166.10
		OKTA INC	22,300	228.31	5,091,313.00
		PAYCHEX INC	58,900	134.24	7,906,736.00
		PAYPAL HOLDINGS INC	200,900	192.01	38,574,809.00
		SNOWFLAKE INC-CLASS A	37,800	349.22	13,200,516.00
		TWILIO INC - A	30,000	267.17	8,015,100.00
		VERISIGN INC	18,500	249.64	4,618,340.00
		VISA INC-CLASS A SHARES	303,700	216.62	65,787,494.00
		WESTERN UNION CO	75,000	17.80	1,335,000.00
		WIX.COM LTD	10,200	162.87	1,661,274.00
		ADOBE INC	85,730	569.62	48,833,522.60
		ANSYS INC	15,800	403.59	6,376,722.00
		ASANA INC - CL A	11,900	77.90	927,010.00
		AUTODESK INC.	39,300	280.99	11,042,907.00
		AVALARA INC	15,300	133.73	2,046,069.00
		BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	33,000	49.81	1,643,730.00
		BILL.COM HOLDINGS INC	13,300	253.38	3,369,954.00
		BLACK KNIGHT INC	27,000	81.68	2,205,360.00
		CADENCE DESIGN SYS INC	50,300	187.48	9,430,244.00
		CERIDIAN HCM HOLDING INC	24,000	103.89	2,493,360.00
		CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	20,100	114.86	2,308,686.00
		CITRIX SYSTEMS INC	21,800	97.88	2,133,784.00
		COUPA SOFTWARE INC	12,700	159.44	2,024,888.00
		CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	33,600	211.52	7,107,072.00
		CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	7,100	171.35	1,216,585.00
		DATADOG INC - CLASS A	35,000	180.36	6,312,600.00
		DOCUSIGN INC	34,500	157.01	5,416,845.00

		DROPBOX INC-CLASS A	57,000	24.98	1,423,860.00	
		DYNATRACE INC	33,000	60.69	2,002,770.00	
		FAIR ISAAC CORP	5,120	435.10	2,227,712.00	
		FORTINET INC	25,200	349.02	8,795,304.00	
		GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	113.81	1,547,816.00	
		HUBSPOT INC	7,920	675.00	5,346,000.00	
		INTUIT INC	49,180	635.71	31,264,217.80	
		MICROSOFT CORP	1,284,800	334.69	430,009,712.00	
		NORTONLIFELOCK INC	102,000	25.87	2,638,740.00	
		NUANCE COMMUNICATIONS INC	53,200	55.30	2,941,960.00	
		ORACLE CORPORATION	301,500	89.72	27,050,580.00	
		PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	286,000	18.93	5,413,980.00	
		PALO ALTO NETWORKS INC	17,430	561.78	9,791,825.40	
		PAYCOM SOFTWARE INC	9,000	423.83	3,814,470.00	
		PTC INC	20,300	120.51	2,446,353.00	
		RINGCENTRAL INC-CLASS A	13,300	192.46	2,559,718.00	
		SALESFORCE.COM INC	176,140	253.14	44,588,079.60	
		SERVICENOW INC	35,650	648.57	23,121,520.50	
		SPLUNK INC	28,500	115.92	3,303,720.00	
		SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	40,300	81.66	3,290,898.00	
		SYNOPSYS INC	27,700	366.15	10,142,355.00	
		TRADE DESK INC/THE -CLASS A	76,900	96.05	7,386,245.00	
		TYLER TECHNOLOGIES INC	7,510	523.11	3,928,556.10	
		UNITY SOFTWARE INC	9,400	145.57	1,368,358.00	
		VMWARE INC - CLASS A	38,000	116.89	4,441,820.00	
		WORKDAY INC-CLASS A	34,300	278.05	9,537,115.00	
		ZENDESK INC	20,500	103.35	2,118,675.00	
		ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	39,000	191.65	7,474,350.00	
		ZSCALER INC	14,600	323.00	4,715,800.00	
		ARISTA NETWORKS INC	42,000	141.85	5,957,700.00	
		CISCO SYSTEMS	758,400	62.28	47,233,152.00	
		F5 INC	10,400	234.84	2,442,336.00	
		JUNIPER NETWORKS INC	60,000	34.13	2,047,800.00	
		MOTOROLA SOLUTIONS INC	30,800	262.90	8,097,320.00	
		APPLE INC	2,974,800	176.28	524,397,744.00	

		DELL TECHNOLOGIES-C	49,600	55.88	2,771,648.00	
		HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	233,000	15.76	3,672,080.00	
		HP INC	219,000	37.65	8,245,350.00	
		NETAPP INC	40,300	90.63	3,652,389.00	
		SEAGATE TECHNOLOGY	36,200	111.42	4,033,404.00	
		WESTERN DIGITAL CORP	54,900	61.20	3,359,880.00	
		AMPHENOL CORP-CL A	107,000	85.06	9,101,420.00	
		ARROW ELECTRS INC	13,700	130.88	1,793,056.00	
		CDW CORPORATION	25,000	202.76	5,069,000.00	
		COGNEX CORP	30,800	77.62	2,390,696.00	
		CORNING INC	144,000	36.75	5,292,000.00	
		IPG PHOTONICS CORP	6,900	168.90	1,165,410.00	
		KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	33,500	201.43	6,747,905.00	
		TE CONNECTIVITY LTD	58,600	158.45	9,285,170.00	
		TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8,600	428.73	3,687,078.00	
		TRIMBLE INC	44,600	86.11	3,840,506.00	
		ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	9,750	582.41	5,678,497.50	
		ADVANCED MICRO DEVICES	218,300	146.14	31,902,362.00	
		ANALOG DEVICES INC	96,200	172.66	16,609,892.00	
		APPLIED MATERIALS	162,500	155.49	25,267,125.00	
		BROADCOM INC	73,830	664.80	49,082,184.00	
		ENPHASE ENERGY INC	23,200	188.17	4,365,544.00	
		ENTEGRIS INC	24,200	136.78	3,310,076.00	
		INTEL CORP	730,300	51.31	37,471,693.00	
		KLA CORP	27,200	420.76	11,444,672.00	
		LAM RESEARCH	25,430	698.72	17,768,449.60	
		MARVELL TECHNOLOGY INC	149,200	87.68	13,081,856.00	
		MICROCHIP TECHNOLOGY	99,600	86.93	8,658,228.00	
		MICRON TECHNOLOGY	201,500	94.42	19,025,630.00	
		MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,000	495.60	3,964,800.00	
		NVIDIA CORP	449,940	296.40	133,362,216.00	
		NXP SEMICONDUCTORS NV	47,600	227.35	10,821,860.00	
		ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	78,000	66.76	5,207,280.00	
		QORVO INC	19,400	152.07	2,950,158.00	
		QUALCOMM INC	203,000	182.74	37,096,220.00	

		SKYWORKS SOLUTIONS INC	30,200	153.42	4,633,284.00	
		SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	9,200	283.29	2,606,268.00	
		TERADYNE INC	30,200	162.74	4,914,748.00	
		TEXAS INSTRUMENTS INC	166,100	187.40	31,127,140.00	
		XILINX INC	44,900	216.11	9,703,339.00	
		AT & T INC	1,285,000	24.87	31,957,950.00	
		LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	28.17	873,270.00	
		LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	28.41	1,818,240.00	
		LUMEN TECHNOLOGIES INC	165,000	12.84	2,118,600.00	
		VERIZON COMMUNICATIONS	744,700	52.68	39,230,796.00	
		T-MOBILE US INC	113,000	119.91	13,549,830.00	
		ALLIANT ENERGY CORP	44,700	59.55	2,661,885.00	
		AMERICAN ELECTRIC POWER	88,700	86.52	7,674,324.00	
		DUKE ENERGY CORP	139,200	102.97	14,333,424.00	
		EDISON INTERNATIONAL	69,600	67.67	4,709,832.00	
		ENTERGY CORP	35,500	110.09	3,908,195.00	
		EVERGY INC	39,900	66.75	2,663,325.00	
		EVERSOURCE ENERGY	61,900	89.44	5,536,336.00	
		EXELON CORPORATION	177,500	54.49	9,671,975.00	
		FIRSTENERGY CORP	99,000	40.53	4,012,470.00	
		NEXTERA ENERGY INC	353,000	90.70	32,017,100.00	
		NRG ENERGY INC	45,000	42.20	1,899,000.00	
		PG&E CORP	261,000	12.00	3,132,000.00	
		PPL CORPORATION	136,000	29.42	4,001,120.00	
		SOUTHERN CO.	189,000	66.54	12,576,060.00	
		XCEL ENERGY INC	96,700	66.61	6,441,187.00	
		ATMOS ENERGY CORP	24,400	102.73	2,506,612.00	
		UGI CORP	36,000	45.50	1,638,000.00	
		AMEREN CORPORATION	47,200	87.02	4,107,344.00	
		CENTERPOINT ENERGY INC	105,000	27.52	2,889,600.00	
		CMS ENERGY CORP	51,400	63.52	3,264,928.00	
		CONSOLIDATED EDISON INC	64,000	83.77	5,361,280.00	
		DOMINION ENERGY INC	144,100	77.34	11,144,694.00	
		DTE ENERGY COMPANY	34,600	116.82	4,041,972.00	
		NISOURCE INC	73,000	26.87	1,961,510.00	

		PUBLIC SVC ENTERPRISE	92,200	64.58	5,954,276.00	
		SEMPRA ENERGY	57,600	129.41	7,454,016.00	
		WEC ENERGY GROUP INC	56,000	94.65	5,300,400.00	
		AMERICAN WATER WORKS CO INC	33,100	182.08	6,026,848.00	
		ESSENTIAL UTILITIES INC	44,000	52.22	2,297,680.00	
		ALLY FINANCIAL INC	67,000	47.58	3,187,860.00	
		AMERICAN EXPRESS CO	122,000	164.19	20,031,180.00	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	79,800	145.10	11,578,980.00	
		DISCOVER FINANCIAL SERVICES	53,900	115.34	6,216,826.00	
		SOFI TECHNOLOGIES INC	92,000	15.09	1,388,280.00	
		SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	46.16	4,791,408.00	
		UPSTART HOLDINGS INC	3,500	148.14	518,490.00	
		AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,700	302.28	6,257,196.00	
		APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	31,300	74.27	2,324,651.00	
		BANK OF NEWYORK MELLON CORP	146,500	58.11	8,513,115.00	
		BLACKROCK INC	27,390	913.92	25,032,268.80	
		BLACKSTONE INC	122,800	135.00	16,578,000.00	
		CARLYLE GROUP INC/THE	29,000	55.49	1,609,210.00	
		CBOE GLOBAL MARKETS INC	19,500	129.00	2,515,500.00	
		CME GROUP INC	65,000	228.96	14,882,400.00	
		COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	6,700	268.15	1,796,605.00	
		FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,900	479.51	3,308,619.00	
		FRANKLIN RESOURCES INC	51,000	33.42	1,704,420.00	
		FUTU HOLDINGS LTD-ADR	8,200	40.90	335,380.00	
		GOLDMAN SACHS GROUP	61,100	385.04	23,525,944.00	
		INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	100,500	135.84	13,651,920.00	
		INVESCO LTD	65,000	23.34	1,517,100.00	
		KKR & CO INC-A	94,100	75.74	7,127,134.00	
		MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,700	410.67	2,751,489.00	
		MOODYS CORP	30,400	397.26	12,076,704.00	
		MORGAN STANLEY	246,300	99.34	24,467,442.00	
		MSCI INC	14,970	611.27	9,150,711.90	
		NASDAQ INC	21,200	205.42	4,354,904.00	
		NORTHERN TRUST CORP	36,300	118.21	4,291,023.00	
		RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	34,200	99.40	3,399,480.00	

		ROBINHOOD MARKETS INC -A	32,000	18.90	604,800.00	
		S&P GLOBAL INC	43,400	473.74	20,560,316.00	
		SCHWAB(CHARLES)CORP	260,400	85.13	22,167,852.00	
		SEI INVESTMENTS COMPANY	22,500	60.78	1,367,550.00	
		STATE STREET CORP	65,200	93.03	6,065,556.00	
		T ROWE PRICE GROUP INC	40,600	195.29	7,928,774.00	
		TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	18,700	98.89	1,849,243.00	
		AES CORP	118,000	23.55	2,778,900.00	
		VISTRA CORP	80,000	22.03	1,762,400.00	
		CERNER CORP	54,500	91.84	5,005,280.00	
		TELADOC HEALTH INC	25,000	95.09	2,377,250.00	
		VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	24,500	260.61	6,384,945.00	
		10X GENOMICS INC-CLASS A	14,400	146.09	2,103,696.00	
		AGILENT TECHNOLOGIES INC	55,100	157.80	8,694,780.00	
		AVANTOR INC	97,000	41.25	4,001,250.00	
		BIO TECHNE CORP	6,990	494.65	3,457,603.50	
		BIO-RAD LABORATORIES-A	3,980	746.26	2,970,114.80	
		CHARLES RIVER LABORATORIES	9,000	369.20	3,322,800.00	
		DANAHER CORP	115,600	320.79	37,083,324.00	
		ILLUMINA INC	26,100	382.29	9,977,769.00	
		IQVIA HOLDINGS INC	34,800	278.01	9,674,748.00	
		METTLER-TOLEDO INTL	4,110	1,626.23	6,683,805.30	
		PERKINELMER INC	20,000	193.77	3,875,400.00	
		THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	70,800	650.70	46,069,560.00	
		WATERS CORP	11,200	361.71	4,051,152.00	
		WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	13,500	459.84	6,207,840.00	
		BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	24,800	83.00	2,058,400.00	
		CLARIVATE PLC	65,000	24.74	1,608,100.00	
		COSTAR GROUP INC	72,100	79.94	5,763,674.00	
		EQUIFAX INC	21,600	287.03	6,199,848.00	
		IHS MARKIT LTD	67,800	132.90	9,010,620.00	
		JACOBS ENGINEERING GROUP INC	22,900	137.35	3,145,315.00	
		LEIDOS HOLDINGS INC	23,800	87.35	2,078,930.00	
		ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	109.21	2,216,963.00	
		TRUNSUNION	35,200	117.58	4,138,816.00	
		VERISK ANALYTICS INC	27,300	225.53	6,156,969.00	

CBRE GROUP INC	60,300	105.82	6,380,946.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	5.20	1,144,000.00	
ZILLOW GROUP INC - A	9,800	62.34	610,932.00	
ZILLOW GROUP INC - C	29,600	63.74	1,886,704.00	
CABLE ONE INC	980	1,738.13	1,703,367.40	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,050	648.30	14,943,315.00	
COMCAST CORP-CL A	824,100	50.03	41,229,723.00	
DISCOVERY INC - A	31,000	24.42	757,020.00	
DISCOVERY INC - C	58,000	23.57	1,367,060.00	
DISH NETWORK CORP-A	43,400	32.87	1,426,558.00	
FOX CORP-CLASS A	58,000	37.28	2,162,240.00	
FOX CORP-CLASS B	25,400	34.51	876,554.00	
INTERPUBRIC GROUP	73,000	36.85	2,690,050.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	157.51	630,040.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	26,400	158.85	4,193,640.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	29,900	49.89	1,491,711.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	50.10	646,290.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	67,000	22.33	1,496,110.00	
OMNICOM GROUP	37,600	72.19	2,714,344.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	6.43	1,125,250.00	
VIACOMCBS INC-CLASS B	108,000	30.58	3,302,640.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	141,400	65.16	9,213,624.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	91,000	28.52	2,595,320.00	
DISNEY (WALT) CO	327,000	153.63	50,237,010.00	
ELECTRONIC ARTS	51,600	132.54	6,839,064.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	34,000	61.39	2,087,260.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	29,100	118.54	3,449,514.00	
NETFLIX INC	79,650	614.09	48,912,268.50	
ROKU INC	20,700	233.52	4,833,864.00	
SEA LTD-ADR	24,800	222.05	5,506,840.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	20,600	177.96	3,665,976.00	
ALPHABET INC-CL A	54,180	2,938.33	159,198,719.40	
ALPHABET INC-CL C	51,860	2,942.85	152,616,201.00	
IAC/INTERACTIVECORP	13,600	131.81	1,792,616.00	
MATCH GROUP INC	48,000	133.44	6,405,120.00	

	META PLATFORMS INC	429,000	335.24	143,817,960.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	97,600	37.42	3,652,192.00	
	SNAP INC-A	191,000	48.68	9,297,880.00	
	TWITTER INC	142,800	44.16	6,306,048.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	40,100	65.72	2,635,372.00	
小計銘柄数：607				7,508,094,888.56 (859,076,217,149)	
組入時価比率：70.7%				73.8%	
カナダドル	CAMECO CORP	72,000	28.61	2,059,920.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	212,000	52.48	11,125,760.00	
	CENOVUS ENERGY INC	240,000	15.35	3,684,000.00	
	ENBRIDGE INC	367,000	48.75	17,891,250.00	
	IMPERIAL OIL	46,000	45.04	2,071,840.00	
	KEYERA CORP	41,000	28.21	1,156,610.00	
	PARKLAND CORP	28,000	34.39	962,920.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	96,000	38.54	3,699,840.00	
	SUNCOR ENERGY INC	263,000	31.45	8,271,350.00	
	TC ENERGY CORP	178,000	60.45	10,760,100.00	
	TOURMALINE OIL CORP	55,000	40.48	2,226,400.00	
	NUTRIEN LTD	102,300	96.24	9,845,352.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	28,200	66.62	1,878,684.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	44,600	66.45	2,963,670.00	
	BARRICK GOLD	325,000	23.81	7,738,250.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	103,000	30.45	3,136,350.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	33,700	174.03	5,864,811.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	103,000	10.12	1,042,360.00	
	KINROSS GOLD CORP	217,000	7.16	1,553,720.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	48,000	52.57	2,523,360.00	
	LUNDIN MINING CORP	118,000	9.54	1,125,720.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	35,300	32.14	1,134,542.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	87,000	36.10	3,140,700.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	80,000	54.26	4,340,800.00	
	WEST FRASER TIMBER	17,800	115.94	2,063,732.00	
	CAE INC	60,000	32.38	1,942,800.00	
	WSP GLOBAL INC	21,400	181.64	3,887,096.00	

		BALLARD POWER SYSTEMS INC	37,000	16.04	593,480.00	
		TOROMONT INDUSTRIES LTD	15,000	113.29	1,699,350.00	
		GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	30,000	49.01	1,470,300.00	
		RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	21,100	77.90	1,643,690.00	
		AIR CANADA	32,000	21.45	686,400.00	
		CANADIAN NATL RAILWAY CO	128,000	156.66	20,052,480.00	
		CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	120,000	92.25	11,070,000.00	
		TFI INTERNATIONAL INC	14,900	141.10	2,102,390.00	
		MAGNA INTERNATIONAL INC	50,500	102.05	5,153,525.00	
		GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	52.80	1,953,600.00	
		RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	52,400	75.36	3,948,864.00	
		CANADIAN TIRE CORP LTD A	10,200	180.89	1,845,078.00	
		DOLLARAMA INC	52,000	63.10	3,281,200.00	
		ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	147,000	52.45	7,710,150.00	
		EMPIRE CO LTD A	32,000	38.86	1,243,520.00	
		LOBLAW COMPANIES	31,400	103.58	3,252,412.00	
		METRO INC	43,500	67.52	2,937,120.00	
		WESTON(GEORGE)LTD	14,100	148.08	2,087,928.00	
		SAPUTO INC	41,000	28.87	1,183,670.00	
		BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	35.93	1,832,430.00	
		CANOPY GROWTH CORP	35,000	12.54	438,900.00	
		BANK OF MONTREAL	117,200	135.87	15,923,964.00	
		BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	217,800	89.76	19,549,728.00	
		CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	80,900	146.89	11,883,401.00	
		NATIONAL BANK OF CANADA	60,700	97.36	5,909,752.00	
		ROYAL BANK OF CANADA	256,500	133.99	34,368,435.00	
		TORONTO DOMINION BANK	328,000	96.30	31,586,400.00	
		FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,640	620.00	2,876,800.00	
		GREAT-WEST LIFECO INC	50,000	37.64	1,882,000.00	
		IA FINANCIAL CORP INC	18,300	72.18	1,320,894.00	
		INTACT FINANCIAL CORP	31,500	163.48	5,149,620.00	
		MANULIFE FINANCIAL CORP	348,000	23.89	8,313,720.00	
		POWER CORPORATION OF CANADA	103,000	42.30	4,356,900.00	
		SUN LIFE FINANCIAL INC	106,900	70.03	7,486,207.00	

		CGI INC	39,800	112.02	4,458,396.00	
		NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	10,700	81.87	876,009.00	
		SHOPIFY INC - CLASS A	20,380	1,813.55	36,960,149.00	
		BLACKBERRY LTD	94,000	12.29	1,155,260.00	
		CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,670	2,325.00	8,532,750.00	
		LIGHTSPEED COMMERCE INC	19,400	52.98	1,027,812.00	
		OPEN TEXT CORP	47,000	60.82	2,858,540.00	
		BCE INC	14,400	65.65	945,360.00	
		TELUS CORP	78,600	29.52	2,320,272.00	
		ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	62,900	59.81	3,762,049.00	
		EMERA INC	47,000	62.30	2,928,100.00	
		FORTIS INC	85,000	60.64	5,154,400.00	
		HYDRO ONE LTD	63,000	32.33	2,036,790.00	
		ALTAGAS LTD	52,000	27.08	1,408,160.00	
		ALGONQUIN POWER & UTILITIES	126,000	18.31	2,307,060.00	
		CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	36.32	737,296.00	
		BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	252,900	76.41	19,324,089.00	
		IGM FINANCIAL INC	15,000	46.54	698,100.00	
		ONEX CORPORATION	13,200	97.07	1,281,324.00	
		TMX GROUP LTD	9,500	127.59	1,212,105.00	
		BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	46.79	1,122,960.00	
		NORTHLAND POWER INC	40,000	37.82	1,512,800.00	
		THOMSON REUTERS CORP	30,500	149.83	4,569,815.00	
		FIRSTSERVICE CORP	7,200	244.31	1,759,032.00	
		QUEBECOR INC-CL B	27,000	28.10	758,700.00	
		SHAW COMMUNICATIONS INC-B	84,000	38.34	3,220,560.00	
	小計	銘柄数：87			457,814,133.00	
					(40,869,067,652)	
		組入時価比率：3.4%			3.5%	
	ユーロ	TENARIS SA	88,000	9.13	803,440.00	
		ENI SPA	460,000	12.24	5,630,400.00	
		GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	96,000	8.52	817,920.00	
		NESTE OYJ	74,600	43.71	3,260,766.00	
		OMV AG	25,000	49.62	1,240,500.00	
		REPSOL SA	262,000	10.37	2,717,988.00	

		TOTALENERGIES SE	451,000	44.77	20,193,525.00
		AIR LIQUIDE SA	84,900	150.48	12,775,752.00
		AKZO NOBEL	34,500	93.98	3,242,310.00
		ARKEMA	11,600	120.80	1,401,280.00
		BASF SE	166,500	60.83	10,128,195.00
		COVESTRO AG	34,400	52.66	1,811,504.00
		EVONIK INDUSTRIES AG	39,000	28.25	1,101,750.00
		FUCHS PETROLUB SE-PREF	10,500	38.76	406,980.00
		KONINKLIJKE DSM NV	31,100	195.30	6,073,830.00
		LANXESS	15,500	53.18	824,290.00
		SOLVAY SA	13,000	101.60	1,320,800.00
		SYMRISE AG	23,700	127.50	3,021,750.00
		UMICORE	34,300	35.62	1,221,766.00
		CRH PLC	141,000	46.12	6,502,920.00
		HEIDELBERGCEMENT AG	27,400	59.28	1,624,272.00
		SMURFIT KAPPA GROUP PLC	42,300	47.64	2,015,172.00
		ARCELORMITTAL	127,000	28.43	3,611,245.00
		VOESTALPINE AG	20,000	32.04	640,800.00
		STORA ENSO OYJ-R	108,000	15.90	1,717,200.00
		UPM-KYMMENE OYJ	97,000	33.00	3,201,000.00
		AIRBUS SE	106,800	111.68	11,927,424.00
		DASSAULT AVIATION SA	5,000	94.45	472,250.00
		MTU AERO ENGINES AG	9,200	181.00	1,665,200.00
		SAFRAN SA	61,200	106.70	6,530,040.00
		THALES SA	18,600	74.48	1,385,328.00
		COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	90,900	60.70	5,517,630.00
		KINGSPAN GROUP PLC	27,800	100.35	2,789,730.00
		ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	45,263	22.99	1,040,596.37
		BOUYGUES	40,000	31.00	1,240,000.00
		EIFFAGE SA	15,900	88.54	1,407,786.00
		FERROVIAL SA	88,000	26.93	2,369,840.00
		VINCI	96,700	89.80	8,683,660.00
		LEGRAND SA	48,800	101.30	4,943,440.00
		PRYSMIAN SPA	43,000	33.09	1,422,870.00
		SCHNEIDER ELECTRIC SE	96,800	170.50	16,504,400.00

		SIEMENS ENERGY AG	73,000	22.78	1,662,940.00	
		SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	45,000	21.17	952,650.00	
		SIEMENS AG	137,700	150.22	20,685,294.00	
		ALSTOM	55,300	30.56	1,689,968.00	
		CNH INDUSTRIAL NV	180,000	16.78	3,020,400.00	
		DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,900	32.40	2,459,160.00	
		GEA GROUP AG	29,000	47.43	1,375,470.00	
		KION GROUP AG	13,100	96.30	1,261,530.00	
		KNORR-BREMSE AG	12,700	87.14	1,106,678.00	
		KONE OYJ	60,400	62.72	3,788,288.00	
		RATIONAL AG	830	900.40	747,332.00	
		WARTSILA OYJ	82,000	12.32	1,010,240.00	
		BRENNTAG SE	26,800	77.52	2,077,536.00	
		IMCD NV	10,200	193.90	1,977,780.00	
		DEUTSCHE POST AG-REG	177,100	55.02	9,744,042.00	
		INPOST SA	34,000	10.38	352,920.00	
		DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	112,000	6.28	704,368.00	
		ADP	4,700	112.45	528,515.00	
		AENA SME SA	13,300	136.85	1,820,105.00	
		ATLANTIA SPA	89,000	17.25	1,535,695.00	
		GETLINK	83,000	14.24	1,181,920.00	
		CONTINENTAL AG	20,600	93.84	1,933,104.00	
		FAURECIA	20,688	40.98	847,794.24	
		MICHELIN (CGDE)	29,900	143.50	4,290,650.00	
		VALEO SA	44,000	26.68	1,173,920.00	
		BAYER MOTOREN WERK	59,800	89.17	5,332,366.00	
		BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	73.40	748,680.00	
		DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	155,000	70.09	10,863,950.00	
		FERRARI NV	22,300	223.70	4,988,510.00	
		PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	27,300	84.52	2,307,396.00	
		RENAULT SA	33,700	29.77	1,003,249.00	
		STELLANTIS NV	364,000	16.59	6,041,672.00	
		VOLKSWAGEN AG	5,800	264.00	1,531,200.00	
		VOLKSWAGEN AG-PREF	33,300	176.90	5,890,770.00	
		SEB SA	5,400	135.60	732,240.00	

ADIDAS AG	34,200	251.90	8,614,980.00	
ESSILORLUXOTTICA	51,600	184.90	9,540,840.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,670	1,530.50	8,677,935.00	
KERING SA	13,600	687.00	9,343,200.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	49,960	717.40	35,841,304.00	
MONCLER SPA	37,600	62.96	2,367,296.00	
PUMA SE	18,900	105.60	1,995,840.00	
ACCOR SA	32,000	28.24	903,680.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	29,500	135.20	3,988,400.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	15,400	38.70	595,980.00	
SODEXO	15,900	77.34	1,229,706.00	
DELIVERY HERO SE	29,000	98.42	2,854,180.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	32,900	47.86	1,574,758.50	
PROSUS NV	169,000	72.50	12,252,500.00	
ZALANDO SE	40,200	70.52	2,834,904.00	
INDITEX SA	199,000	28.15	5,601,850.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	107,000	15.64	1,674,015.00	
COLRUYT SA	8,700	37.15	323,205.00	
HELLOFRESH SE	29,000	68.42	1,984,180.00	
JERONIMO MARTINS	47,000	20.26	952,220.00	
KESKO OYJ-B SHS	50,000	29.17	1,458,500.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	188,000	29.91	5,624,020.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	136,500	53.24	7,267,260.00	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	12.74	1,159,340.00	
HEINEKEN HOLDING NV	20,000	80.65	1,613,000.00	
HEINEKEN NV	45,700	98.10	4,483,170.00	
PERNOD RICARD SA	38,000	211.10	8,021,800.00	
REMY COINTREAU	3,900	211.80	826,020.00	
DANONE	117,000	53.56	6,266,520.00	
JDE PEET'S BV	21,000	26.54	557,340.00	
KERRY GROUP PLC-A	29,300	113.65	3,329,945.00	
HENKEL AG & CO KGAA	18,000	68.10	1,225,800.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	31,000	70.64	2,189,840.00	
BEIERSDORF AG	17,900	90.02	1,611,358.00	
LOREAL-ORD	45,200	422.35	19,090,220.00	

BIOMERIEUX	6,900	124.25	857,325.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	183.25	1,319,400.00	
DIASORIN SPA	4,800	161.65	775,920.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	168,000	31.71	5,328,120.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	4,720	578.80	2,731,936.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	50,700	65.66	3,328,962.00	
AMPLIFON SPA	24,000	45.44	1,090,560.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	36,600	56.42	2,064,972.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	78,000	35.01	2,730,780.00	
ORPEA	9,300	87.00	809,100.00	
ARGENX SE	8,300	310.80	2,579,640.00	
GRIFOLS SA	54,000	16.20	875,070.00	
BAYER AG-REG	176,600	46.62	8,233,975.00	
IPSEN	7,300	79.00	576,700.00	
MERCK KGAA	23,300	225.20	5,247,160.00	
ORION OYJ	21,000	35.84	752,640.00	
RECORDATI SPA	19,900	55.76	1,109,624.00	
SANOFI	205,500	87.86	18,055,230.00	
UCB SA	22,700	99.30	2,254,110.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	12.71	890,120.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,214,000	5.17	6,276,380.00	
BANCO SANTANDER SA	3,150,000	2.90	9,139,725.00	
BNP PARIBAS	203,700	59.75	12,171,075.00	
CAIXABANK	760,000	2.35	1,792,840.00	
COMMERZBANK AG	188,000	6.70	1,260,916.00	
CREDIT AGRICOLE SA	226,000	12.49	2,822,740.00	
ERSTE GROUP BANK AG	61,000	40.76	2,486,360.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	111,000	15.08	1,673,880.00	
ING GROEP NV	709,000	12.21	8,656,890.00	
INTESA SANPAOLO	3,010,000	2.25	6,775,510.00	
KBC GROEP NV	46,000	74.74	3,438,040.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	9.88	1,057,802.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	29,000	26.12	757,480.00	
SOCIETE GENERALE	145,000	29.93	4,339,850.00	
UNICREDIT SPA	389,000	13.50	5,254,612.00	

EURAZEO SE	7,800	74.95	584,610.00	
EXOR NV	19,500	77.18	1,505,010.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	19,500	97.62	1,903,590.00	
SOFINA SA	2,900	424.00	1,229,600.00	
WENDEL	4,300	105.80	454,940.00	
AEGON NV	329,000	4.38	1,443,652.00	
AGEAS	32,000	45.00	1,440,000.00	
ALLIANZ SE-REG	73,800	207.00	15,276,600.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	198,000	18.63	3,689,730.00	
AXA SA	351,000	25.89	9,089,145.00	
CNP ASSURANCES	28,000	21.76	609,280.00	
HANNOVER RUECK SE	10,900	166.15	1,811,035.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	25,100	256.25	6,431,875.00	
NN GROUP NV	49,400	47.51	2,346,994.00	
POSTE ITALIANE SPA	88,000	11.36	999,680.00	
SAMPO OYJ-A SHS	91,000	43.70	3,976,700.00	
ADYEN NV	3,590	2,258.50	8,108,015.00	
AMADEUS IT GROUP SA	79,400	58.58	4,651,252.00	
BECHTLE AG	15,700	61.68	968,376.00	
CAPGEMINI SA	29,200	212.50	6,205,000.00	
EDENRED	42,400	40.38	1,712,112.00	
NEXI SPA	89,000	13.99	1,245,110.00	
WORLDLINE SA	41,300	49.37	2,038,981.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	119,800	52.69	6,312,262.00	
NEMETSCHEK SE	11,000	110.45	1,214,950.00	
SAP SE	187,900	123.52	23,209,408.00	
NOKIA OYJ	961,000	5.53	5,320,096.00	
ASM INTERNATIONAL NV	8,400	382.80	3,215,520.00	
ASML HOLDING NV	74,380	702.90	52,281,702.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	237,000	39.99	9,477,630.00	
STMICROELECTRONICS NV	123,000	43.52	5,352,960.00	
CELLNEX TELECOM SA	89,700	49.08	4,402,476.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	604,000	16.20	9,787,216.00	
ELISA OYJ	25,700	53.94	1,386,258.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	55,000	10.51	578,050.00	

KONINKLIJKE KPN NV	610,000	2.72	1,662,860.00	
ORANGE SA	367,000	9.38	3,443,928.00	
PROXIMUS	26,000	17.50	455,130.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.43	843,989.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.45	515,550.00	
TELEFONICA SA	955,384	3.90	3,727,430.67	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	34.80	584,640.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	79,000	10.14	801,060.00	
ELIA GROUP SA/NV	6,200	115.10	713,620.00	
ENDESA S.A.	57,000	20.30	1,157,100.00	
ENEL SPA	1,475,000	6.91	10,201,100.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	509,000	4.79	2,442,691.00	
FORTUM OYJ	79,000	27.49	2,171,710.00	
IBERDROLA SA	1,028,000	10.08	10,362,240.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	79,000	18.69	1,476,510.00	
TERNA SPA	251,000	7.14	1,792,140.00	
VERBUND AG	12,700	102.60	1,303,020.00	
ENAGAS SA	48,000	20.36	977,280.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	34,000	28.15	957,100.00	
SNAM SPA	351,158	5.20	1,828,830.86	
E.ON SE	410,000	12.06	4,944,600.00	
ENGIE	323,000	12.86	4,156,364.00	
RWE AG	114,000	35.06	3,996,840.00	
SUEZ	62,000	19.80	1,227,600.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	119,000	31.84	3,788,960.00	
AMUNDI SA	10,000	71.25	712,500.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	375,000	11.19	4,197,000.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	34,700	145.80	5,059,260.00	
EURONEXT NV	15,300	89.35	1,367,055.00	
EDP RENOVAVEIS SA	49,000	21.84	1,070,160.00	
UNIPER SE	15,100	42.10	635,710.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	23,700	108.70	2,576,190.00	
QIAGEN N.V.	39,400	48.79	1,922,326.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,950	467.70	2,315,115.00	
BUREAU VERITAS SA	54,000	29.07	1,569,780.00	

	RANDSTAD NV	21,400	58.52	1,252,328.00	
	TELEPERFORMANCE	10,800	382.50	4,131,000.00	
	WOLTERS KLUWER	48,400	101.40	4,907,760.00	
	AROUNDTOWN SA	173,000	5.25	909,288.00	
	LEG IMMOBILIEN SE	12,500	121.35	1,516,875.00	
	VONOVIA SE	131,355	47.99	6,303,726.45	
	PUBLICIS GROUPE	40,700	59.00	2,401,300.00	
	VIVENDI SE	145,000	11.95	1,732,750.00	
	BOLLORE	168,000	4.92	826,896.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	43.34	749,782.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	127,000	24.32	3,088,640.00	
	SCOUT24 SE	15,200	61.06	928,112.00	
小計	**銘柄数：228**			895,932,094.09	
				(115,969,450,259)	
	組入時価比率：9.5%			9.9%	
英ポンド	BP PLC	3,640,000	3.37	12,297,740.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	735,000	16.44	12,083,400.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	666,000	16.42	10,941,048.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	24,600	100.10	2,462,460.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	34,800	20.47	712,356.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	233,000	30.40	7,084,365.00	
	ANTOFAGASTA PLC	70,000	13.20	924,000.00	
	BHP GROUP PLC	378,000	21.79	8,236,620.00	
	EVRAZ PLC	101,000	6.05	611,858.00	
	GLENCORE PLC	1,790,000	3.73	6,676,700.00	
	RIO TINTO PLC-REG	203,400	48.66	9,898,461.00	
	MONDI PLC	84,000	18.13	1,523,340.00	
	BAE SYSTEMS PLC	573,000	5.45	3,123,996.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,520,000	1.21	1,848,624.00	
	DCC PLC	18,400	60.72	1,117,248.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	765,000	1.58	1,212,142.50	
	SMITHS GROUP PLC	71,000	15.79	1,121,090.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	13,100	157.05	2,057,355.00	
	ASHTEAD GROUP PLC	80,600	60.12	4,845,672.00	
	BUNZLE	61,000	29.01	1,769,610.00	
	FERGUSON PLC	40,500	131.00	5,305,500.00	

RENTOKIL INTIAL PLC	345,000	5.74	1,980,990.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	181,000	7.38	1,336,866.00	
PERSIMMON PLC	58,000	28.31	1,641,980.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	620,000	1.75	1,086,240.00	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	20,871	47.90	999,720.90	
BURBERRY GROUP PLC	73,000	17.81	1,300,495.00	
COMPASS GROUP PLC	325,000	16.46	5,351,125.00	
ENTAIN PLC	102,000	16.84	1,717,680.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	32,500	47.68	1,549,600.00	
WHITBREAD PLC	36,300	29.99	1,088,637.00	
NEXT PLC	23,800	79.44	1,890,672.00	
JD SPORTS FASHION PLC	465,000	2.11	983,010.00	
KINGFISHER PLC	390,000	3.42	1,335,750.00	
OCADO GROUP PLC	92,000	16.58	1,525,360.00	
SAINSBURY	299,000	2.74	821,951.00	
TESCO PLC	1,370,000	2.87	3,944,230.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	25.38	862,920.00	
DIAGEO PLC	420,000	40.15	16,863,000.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	62,000	19.90	1,233,800.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	391,000	27.50	10,752,500.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	172,000	16.12	2,772,640.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	127,500	62.74	7,999,350.00	
UNILEVER PLC	467,000	39.52	18,458,175.00	
SMITH & NEPHEW PLC	160,000	12.79	2,046,400.00	
NMC HEALTH PLC	13,300	0.08	1,064.00	
ASTRAZENECA PLC	278,780	86.11	24,005,745.80	
GLAXOSMITHKLINE PLC	909,000	16.14	14,671,260.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29,600	21.89	647,944.00	
BARCLAYS PLC	3,020,000	1.87	5,660,688.00	
HSBC HOLDINGS PLC	3,676,000	4.47	16,457,452.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,710,000	0.47	6,029,624.00	
NATWEST GROUP PLC	1,010,000	2.26	2,285,630.00	
STANDARD CHARTERED PLC	479,000	4.41	2,113,827.00	
M&G PLC	440,000	1.98	875,160.00	
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	30.95	1,083,250.00	

		AVIVA PLC	705,000	4.09	2,889,795.00	
		LEGAL & GENERAL	1,080,000	2.96	3,204,360.00	
		PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	122,000	6.49	792,024.00	
		PRUDENTIAL PLC	476,000	12.75	6,069,000.00	
		AVEVA GROUP PLC	19,911	34.12	679,363.32	
		SAGE GROUP PLC (THE)	197,000	8.47	1,669,772.00	
		HALMA PLC	70,000	31.42	2,199,400.00	
		BT GROUP PLC	1,620,000	1.70	2,764,530.00	
		VODAFONE GROUP PLC	4,960,000	1.12	5,581,984.00	
		SSE PLC	186,000	16.35	3,041,100.00	
		NATIONAL GRID PLC	651,000	10.82	7,043,820.00	
		SEVERN TRENT PLC	43,000	29.54	1,270,220.00	
		UNITED UTILITIES GROUP PLC	122,000	10.93	1,333,460.00	
		3I GROUP PLC	178,000	14.54	2,589,010.00	
		ABRDN PLC	366,000	2.42	885,720.00	
		HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	13.56	881,400.00	
		LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	58,500	69.84	4,085,640.00	
		SCHRODERS PLC	24,000	35.60	854,400.00	
		ST JAMES S PLACE PLC	95,000	16.72	1,588,875.00	
		EXPERIAN PLC	168,000	35.72	6,000,960.00	
		INTERTEK GROUP PLC	28,500	56.22	1,602,270.00	
		RELX PLC	351,000	23.72	8,325,720.00	
		INFORMA PLC	275,000	5.14	1,414,600.00	
		PEARSON	126,000	6.03	760,788.00	
		WPP PLC	218,000	11.20	2,441,600.00	
		AUTO TRADER GROUP PLC	171,000	7.24	1,238,724.00	
	小計	銘柄数：82			330,436,857.52	
					(50,629,535,309)	
		組入時価比率：4.2%			4.3%	
	スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	18.86	773,465.00	
		EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,150	1,007.00	1,158,050.00	
		GIVAUDAN-REG	1,639	4,717.00	7,731,163.00	
		SIKA AG-REG	25,700	371.80	9,555,260.00	
		HOLCIM LTD	91,800	46.03	4,225,554.00	
		GEBERIT AG-REG	6,580	733.00	4,823,140.00	

		ABB LTD	295,000	34.63	10,215,850.00	
		SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,700	245.20	907,240.00	
		SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,400	246.00	1,820,400.00	
		VAT GROUP AG	4,810	448.00	2,154,880.00	
		KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	9,300	290.10	2,697,930.00	
		CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	93,300	135.40	12,632,820.00	
		THE SWATCH GROUP AG-B	5,500	271.70	1,494,350.00	
		THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	52.10	547,050.00	
		BARRY CALLEBAUT AG	630	2,186.00	1,377,180.00	
		CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	195	12,370.00	2,412,150.00	
		CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	20	122,300.00	2,446,000.00	
		NESTLE SA-REG	506,600	127.04	64,358,464.00	
		ALCON INC	89,600	79.50	7,123,200.00	
		SONOVA HOLDING AG-REG	9,600	353.70	3,395,520.00	
		STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,900	1,943.00	3,691,700.00	
		NOVARTIS AG-REG	394,300	80.02	31,551,886.00	
		ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	126,400	376.45	47,583,280.00	
		ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,800	404.80	2,347,840.00	
		VIFOR PHARMA AG	9,100	163.00	1,483,300.00	
		BALOISE HOLDING AG	8,600	146.60	1,260,760.00	
		SWISS LIFE HOLDING AG	5,710	556.80	3,179,328.00	
		SWISS RE LTD	55,100	89.90	4,953,490.00	
		ZURICH INSURANCE GROUP AG	27,300	398.00	10,865,400.00	
		TEMENOS AG-REG	12,000	122.00	1,464,000.00	
		LOGITECH INTERNATIONAL-REG	31,600	77.80	2,458,480.00	
		SWISSCOM AG-REG	4,450	517.40	2,302,430.00	
		CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	481,000	8.94	4,301,102.00	
		JULIUS BAER GROUP LTD	39,400	60.76	2,393,944.00	
		PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,140	1,494.00	6,185,160.00	
		UBS GROUP AG	632,000	16.43	10,383,760.00	
		BACHEM HOLDING AG-REG B	1,100	675.00	742,500.00	
		LONZA AG-REG	13,310	749.40	9,974,514.00	
		ADECCO GROUP AG-REG	28,100	46.05	1,294,005.00	
		SGS SA-REG	1,060	2,999.00	3,178,940.00	
		SWISS PRIME SITE-REG	13,500	88.10	1,189,350.00	

小計	銘柄数：41 組入時価比率：3.0%			294,634,835.00 (36,667,305,215) 3.1%	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	37,000	325.40	12,039,800.00	
	BOLIDEN AB	49,000	353.30	17,311,700.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	112,000	156.25	17,500,000.00	
	ASSA ABLOY AB-B	183,000	275.80	50,471,400.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	256,000	131.15	33,574,400.00	
	SKANSKA AB-B SHS	60,000	229.90	13,794,000.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	351.40	9,136,400.00	
	LIFCO AB-B SHS	42,000	256.20	10,760,400.00	
	ALFA LAVAL AB	57,000	360.40	20,542,800.00	
	ATLAS COPCO AB-A	119,100	622.60	74,151,660.00	
	ATLAS COPCO AB-B	69,900	527.00	36,837,300.00	
	EPIROC AB - A	121,000	228.50	27,648,500.00	
	EPIROC AB - B	69,000	190.00	13,110,000.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	142.55	10,406,150.00	
	SANDVIK AB	204,000	251.90	51,387,600.00	
	SKF AB-B SHARES	68,000	211.00	14,348,000.00	
	VOLVO AB-A SHS	34,000	209.20	7,112,800.00	
	VOLVO AB-B SHS	261,000	207.80	54,235,800.00	
	SECURITAS AB-B SHS	54,000	123.30	6,658,200.00	
	ELECTROLUX AB-B	41,000	214.30	8,786,300.00	
	EVOLUTION AB	31,400	1,214.20	38,125,880.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	133,000	178.12	23,689,960.00	
	SWEDISH MATCH AB	285,000	70.70	20,149,500.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	110,000	287.10	31,581,000.00	
	GETINGE AB-B SHS	41,000	388.20	15,916,200.00	
	NORDEA BANK ABP	590,000	108.16	63,814,400.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	299,000	124.60	37,255,400.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	266,000	96.48	25,663,680.00	
	SWEDBANK AB	160,000	180.20	28,832,000.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	284.60	6,856,583.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	279.30	6,982,500.00	
	INVESTOR AB-A SHS	89,000	230.80	20,541,200.00	

	INVESTOR AB-B SHS	323,000	221.20	71,447,600.00	
	KINNEVIK AB - B	44,000	310.15	13,646,600.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	493.90	6,223,140.00	
	SINCH AB	92,000	112.45	10,345,400.00	
	ERICSSON LM-B	533,000	98.60	52,553,800.00	
	HEXAGON AB-B SHS	351,000	142.60	50,052,600.00	
	TELIA CO AB	480,000	35.15	16,874,400.00	
	TELE 2 AB-B SHS	92,000	125.40	11,536,800.00	
	EQT AB	53,000	492.00	26,076,000.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	18,700	638.00	11,930,600.00	
	SAGAX AB-B	29,000	296.00	8,584,000.00	
	EMBRACER GROUP AB	88,000	92.09	8,103,920.00	
小計	銘柄数：44			1,096,596,373.20 (13,751,318,519)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
ノルウェークローネ	AKER BP ASA	22,000	277.60	6,107,200.00	
	EQUINOR ASA	179,000	243.40	43,568,600.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	445.00	13,172,000.00	
	NORSK HYDRO	246,000	70.92	17,446,320.00	
	MOWI ASA	78,000	207.40	16,177,200.00	
	ORKLA ASA	133,000	86.96	11,565,680.00	
	DNB BANK ASA	167,000	197.45	32,974,150.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	210.30	6,519,300.00	
	TELENOR ASA	129,000	138.50	17,866,500.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	18,100	304.00	5,502,400.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	14,400	345.90	4,980,960.00	
	ADEVINTA ASA	45,000	120.65	5,429,250.00	
小計	銘柄数：12			181,309,560.00 (2,344,332,610)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	18,200	506.60	9,220,120.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	37,600	518.20	19,484,320.00	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS	1,700	2,817.00	4,788,900.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	184,000	196.00	36,064,000.00	

	DSV A/S	36,700	1,489.00	54,646,300.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	560	21,220.00	11,883,200.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	22,780.00	23,691,200.00	
	PANDORA A/S	17,700	802.80	14,209,560.00	
	CARLSBERG B	18,000	1,111.50	20,007,000.00	
	AMBU A/S-B	29,000	171.20	4,964,800.00	
	COLOPLAST-B	21,000	1,145.50	24,055,500.00	
	DEMANT A/S	20,100	330.90	6,651,090.00	
	GN STORE NORD A/S	21,200	401.30	8,507,560.00	
	GENMAB A/S	12,000	2,595.00	31,140,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	303,000	715.10	216,675,300.00	
	DANSKE BANK AS	122,000	111.45	13,596,900.00	
	TRYG A/S	68,000	158.75	10,795,000.00	
	ORSTED A/S	33,400	848.80	28,349,920.00	
小計	**銘柄数：18**			538,730,670.00	
				(9,379,300,964)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	28.90	1,156,000.00	
	SANTOS LTD.	567,625	6.40	3,632,800.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	38,000	30.10	1,143,800.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	174,000	21.80	3,793,200.00	
	ORICA LTD	79,000	13.63	1,076,770.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	79,000	55.08	4,351,320.00	
	BHP GROUP LIMITED	529,000	41.32	21,858,280.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	90,000	20.96	1,886,400.00	
	EVOLUTION MINING LTD	340,000	4.03	1,370,200.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	298,000	19.24	5,733,520.00	
	NEWCREST MINING	143,000	24.06	3,440,580.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	194,000	9.28	1,800,320.00	
	RIO TINTO LTD	68,000	99.10	6,738,800.00	
	SOUTH32 LTD	870,000	4.01	3,488,700.00	
	REECE LTD	49,000	26.19	1,283,310.00	
	BRAMBLES LTD	270,000	10.65	2,875,500.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	4.94	839,800.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	3.46	1,055,300.00	

		SYDNEY AIRPORT	244,000	8.69	2,120,360.00	
		TRANSURBAN GROUP	540,000	13.77	7,435,800.00	
		ARISTOCRAT LEISURE LTD	110,000	44.15	4,856,500.00	
		CROWN RESORTS LTD	77,000	11.83	910,910.00	
		DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	10,300	120.81	1,244,343.00	
		TABCORP HOLDINGS	420,000	5.09	2,137,800.00	
		WESFARMERS LIMITED	206,000	58.98	12,149,880.00	
		COLES GROUP LTD	243,000	17.68	4,296,240.00	
		ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	253,000	6.77	1,712,810.00	
		WOOLWORTHS GROUP LTD	225,000	37.71	8,484,750.00	
		TREASURY WINE ESTATES LTD	135,000	12.20	1,647,000.00	
		COCHLEAR LTD	11,500	216.13	2,485,495.00	
		RAMSAY HEALTH CARE LTD	33,000	70.06	2,311,980.00	
		SONIC HEALTHCARE LTD	84,000	46.25	3,885,000.00	
		CSL LIMITED	86,100	292.85	25,214,385.00	
		AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	509,000	27.46	13,977,140.00	
		COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	319,300	100.63	32,131,159.00	
		NATIONAL AUSTRALIA BANK	597,000	28.89	17,247,330.00	
		WESTPAC BANKING CORP	666,000	21.20	14,119,200.00	
		INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	430,000	4.27	1,836,100.00	
		MEDIBANK PRIVATE LTD	520,000	3.33	1,731,600.00	
		QBE INSURANCE	266,000	11.29	3,003,140.00	
		SUNCORP GROUP LTD	222,000	11.06	2,455,320.00	
		AFTERPAY LTD	39,400	86.65	3,414,010.00	
		COMPUTERSHARE LTD	101,000	19.75	1,994,750.00	
		WISETECH GLOBAL LTD	28,000	59.50	1,666,000.00	
		XERO LIMITED	23,300	142.00	3,308,600.00	
		TELSTRA CORP LTD	730,000	4.15	3,029,500.00	
		AUSNET SERVICES	330,000	2.53	834,900.00	
		ORIGIN ENERGY LTD	330,000	5.20	1,716,000.00	
		APA GROUP	205,000	10.25	2,101,250.00	
		ASX LTD	34,500	92.05	3,175,725.00	
		MACQUARIE GROUP LIMITED	63,000	204.25	12,867,750.00	
		MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	26,000	21.21	551,460.00	
		IDP EDUCATION LTD	37,000	34.98	1,294,260.00	

	REA GROUP LTD	8,800	168.87	1,486,056.00	
	SEEK LTD	60,000	33.75	2,025,000.00	
小計	銘柄数：55			274,384,103.00 (22,683,333,795)	
	組入時価比率：1.9%			1.9%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	7.60	1,694,800.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	100,000	32.85	3,285,000.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	74,000	12.20	902,800.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.55	1,398,385.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	6.08	832,960.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	250,000	4.92	1,230,000.00	
小計	銘柄数：6			9,343,945.00 (727,986,754)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	18.94	6,250,200.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	483,040	49.70	24,007,088.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	251,000	154.80	38,854,800.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	230,000	29.55	6,796,500.00	
	MTR CORP	272,000	41.35	11,247,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	379,000	41.05	15,557,950.00	
	SANDS CHINA LTD	432,000	18.14	7,836,480.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	320,000	14.00	4,480,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	290,000	21.00	6,090,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,538,306	4.92	7,568,465.52	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	670,000	25.05	16,783,500.00	
	HANG SENG BANK	140,000	143.80	20,132,000.00	
	AIA GROUP LTD	2,177,000	78.80	171,547,600.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	719,600	10.50	7,555,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	48.40	5,178,800.00	
	CLP HLDGS	299,000	78.20	23,381,800.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	254,000	48.70	12,369,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,070,383	11.98	24,803,188.34	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING	216,000	453.00	97,848,000.00	

	LTD				
	CK ASSET HOLDINGS LTD	355,040	47.75	16,953,160.00	
	ESR CAYMAN LTD	380,000	26.20	9,956,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	15.70	5,652,000.00	
	HENDERSON LAND	267,443	33.15	8,865,735.45	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	268,916	29.65	7,973,359.40	
	SINO LAND CO.LTD	620,000	9.42	5,840,400.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	235,000	93.50	21,972,500.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	43.80	4,555,200.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	19.12	4,397,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	311,000	39.95	12,424,450.00	
小計	銘柄数：29			606,879,576.71 (8,902,923,390)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
シンガポールドル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.74	931,260.00	
	KEPPEL CORP.	280,000	5.13	1,436,400.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	240,000	4.93	1,183,200.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.76	864,450.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	340,000	4.09	1,390,600.00	
	DBS GROUP HLDGS	329,000	32.61	10,728,690.00	
	OCBC-ORD	606,000	11.34	6,872,040.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	210,000	26.89	5,646,900.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	18.19	818,550.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,400,000	2.32	3,248,000.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	148,000	9.21	1,363,080.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	480,000	3.37	1,617,600.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	6.68	467,600.00	
	UOL GROUP LIMITED	87,000	7.02	610,740.00	
小計	銘柄数：14			37,179,110.00 (3,134,570,764)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
新シェケル	ICL GROUP LTD	125,000	30.06	3,757,500.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	535.70	2,678,500.00	
	BANK HAPOALIM BM	207,000	31.79	6,580,530.00	
		267,000	32.94	8,794,980.00	

		BANK LEUMI LE-ISRAEL				
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	213,000	20.77	4,424,010.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	117.00	2,691,000.00	
		NICE LTD	11,600	975.10	11,311,160.00	
		AZRIELI GROUP	6,500	295.00	1,917,500.00	
	小計	銘柄数：8			42,155,180.00	
					(1,529,448,947)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計					1,165,664,791,327	
					(1,165,664,791,327)	

(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12月27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	1,431,270.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26,200	5,701,906.00	
		AMERICAN TOWER CORP	81,900	22,828,806.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	267,000	2,186,730.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,100	6,168,827.00	
		BOSTON PROPERTIES	26,800	3,062,168.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	17,500	3,036,075.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	78,200	15,592,298.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	50,500	8,575,405.00	
		DUKE REALTY CORP	66,400	4,155,976.00	
		EQUINIX INC	16,250	13,304,850.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,100	2,724,327.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	65,000	5,731,700.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,400	3,906,438.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	23,900	5,210,200.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	94,000	3,307,860.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	123,000	2,134,050.00	
		INVITATION HOMES INC	105,000	4,614,750.00	
		IRON MOUNTAIN INC	54,000	2,770,200.00	

		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	108,000	2,447,280.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,400	4,510,236.00	
		PROLOGIS INC	132,300	21,399,525.00	
		PUBLIC STORAGE	28,200	10,221,090.00	
		REALTY INCOME CORP	99,400	6,880,468.00	
		REGENCY CENTERS CORP	25,900	1,887,074.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	19,900	7,448,172.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	59,700	9,280,962.00	
		SUN COMMUNITIES INC	21,300	4,377,576.00	
		UDR INC	54,800	3,215,664.00	
		VENTAS INC	69,800	3,434,160.00	
		VICI PROPERTIES INC	111,000	3,207,900.00	
		VORNADO REALTY TRUST	27,000	1,120,230.00	
		WELLTOWER INC	75,000	6,209,250.00	
		WEYERHAEUSER CO	133,000	5,139,120.00	
		WP CAREY INC	34,000	2,748,220.00	
	小計	銘柄数：35	2,276,950	209,970,763.00	
				(24,024,854,702)	
		組入時価比率：2.0%		85.8%	
	カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	875,077.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	634,480.00	
	小計	銘柄数：2	42,900	1,509,557.00	
				(134,758,153)	
		組入時価比率：0.0%		0.5%	
	ユーロ	COVIVIO	8,500	608,600.00	
		GECINA SA	8,100	981,720.00	
		KLEPIERRE	40,000	820,400.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,200	1,276,664.00	
	小計	銘柄数：4	77,800	3,687,384.00	
				(477,294,984)	
		組入時価比率：0.0%		1.7%	
	英ポンド	BRITISH LAND	159,000	837,294.00	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	132,000	1,007,688.00	
		SEGRO PLC	220,000	3,063,500.00	
	小計	銘柄数：3	511,000	4,908,482.00	
				(752,077,612)	

		組入時価比率：0.1%		2.7%	
	豪ドル	DEXUS/AU	196,000	2,185,400.00	
		GOODMAN GROUP	296,000	7,761,120.00	
		GPT GROUP	330,000	1,778,700.00	
		LENDLEASE GROUP	135,000	1,424,250.00	
		MIRVAC GROUP	750,000	2,212,500.00	
		SCENTRE GROUP	920,000	2,879,600.00	
		STOCKLAND TRUST GROUP	400,000	1,748,000.00	
		VICINITY CENTRES	670,000	1,135,650.00	
	小計	銘柄数：8	3,697,000	21,125,220.00	
				(1,746,421,937)	
		組入時価比率：0.1%		6.2%	
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,628,400.00	
		LINK REIT	370,000	25,104,500.00	
	小計	銘柄数：2	840,000	28,732,900.00	
				(421,511,643)	
		組入時価比率：0.0%		1.5%	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	620,040	1,816,717.20	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	904,221	1,799,399.79	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	736,300.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	570,329	1,060,811.94	
	小計	銘柄数：4	2,464,590	5,413,228.93	
				(456,389,331)	
		組入時価比率：0.0%		1.6%	
合計				28,013,308,362	
				(28,013,308,362)	

(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12月27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	20,207,426,667	－	20,492,806,388	285,379,721
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	543,915,448	－	544,755,044	839,596
米ドル	470,665,998	－	471,405,044	739,046
香港ドル	73,249,450	－	73,350,000	100,550
合計	－	－	－	286,219,317

（注）時価の算定方法

１先物取引

外国先物取引について

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

２為替予約取引

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

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

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

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2021年12月27日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	1,642,976,768
コール・ローン	82,533,190
株式	63,316,774,628
投資信託受益証券	3,162,017,181
投資証券	60,367,687
派生商品評価勘定	3,074,195
未収入金	1,301,460
未収配当金	65,642,586
差入委託証拠金	849,174,264

	(2021年12月27日現在)
流動資産合計	69,183,861,959
資産合計	69,183,861,959
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,570,120
未払金	11,473,811
未払解約金	7,107,803
未払利息	40
その他未払費用	2,143,600
流動負債合計	31,295,374
負債合計	31,295,374
純資産の部	
元本等	
元本	43,244,709,121
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	25,907,857,464
元本等合計	69,152,566,585
純資産合計	69,152,566,585
負債純資産合計	69,183,861,959

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
４.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

（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12月27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	1.5991円
(10,000口当たり純資産額)	(15,991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12月29日 至 2021年12月27日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考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12月27日現在
１．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２．時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）
元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年12月27日現在	
期首	2020年12月29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	36,764,031,794円
同期中における追加設定元本額	10,637,314,556円
同期中における一部解約元本額	4,156,637,229円
期末元本額	43,244,709,121円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド２０１５	20,984,301円
野村資産設計ファンド２０２０	20,979,313円
野村資産設計ファンド２０２５	37,922,828円
野村資産設計ファンド２０３０	53,826,999円
野村資産設計ファンド２０３５	46,043,425円
野村資産設計ファンド２０４０	87,338,110円
野村資産設計ファンド２０４５	16,056,398円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,536,349,681円
ネクストコア	11,620,340円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	376,713,016円
野村資産設計ファンド２０５０	21,441,090円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型	6,859,553円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型	3,681,860円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型	2,890,116円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型	2,389,996円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	926,397円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,174,660円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	8,803,199円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,632,185円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	11,490,963円

野村つみたて外国株投信	3,648,676,407円
野村外国株（含む新興国）インデックス　Ａコース（野村投資一任口座向け）	1,043,480,189円
野村外国株（含む新興国）インデックス　Ｂコース（野村投資一任口座向け）	1,785,796,768円
世界６資産分散ファンド	101,592,456円
野村資産設計ファンド２０６０	13,966,835円
ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　新興国株式・ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	1,051,259,054円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,106,757,784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）	4,735,242円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・新興国株式（適格機関投資家専用）	394,888,204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）	805,077円
野村新興国株式インデックスファンド（確定拠出年金向け）	29,413,258,919円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	290,401,431円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	22,453,340円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	14,030,927円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	12,175,221円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	9,640,603円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	6,864,628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）	53,801,606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12月27日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	20,300	13.13	266,539.00	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	31,430	85.78	2,696,065.40	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,000	223.00	1,561,000.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	450,700	9.14	4,122,102.20	
		ROSNEFT OJSC - GDR	83,900	7.74	649,889.40	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	103,000	5.15	530,965.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	19,100	39.25	749,675.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	12,100	21.64	261,844.00	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	9,779	50.13	490,221.27	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	9,600	7.40	71,040.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	10,300	28.88	297,464.00	
		PJSC ALROSA	176,000	1.56	275,712.80	

PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	48,600	29.58	1,437,588.00	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,710	87.55	412,360.50	
SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	21.28	336,224.00	
SOUTHERN COPPER CORP	6,300	60.20	379,260.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	34,600	27.40	948,040.00	
DIDI GLOBAL INC	18,200	5.60	101,920.00	
LI AUTO INC - ADR	43,200	30.42	1,314,144.00	
NIO INC ADR	102,300	30.52	3,122,196.00	
XPENG INC ADR	28,900	46.09	1,332,001.00	
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	14,300	37.25	532,675.00	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	39,200	23.79	932,568.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	31,200	48.24	1,505,088.00	
DADA NEXUS LTD-ADR	4,100	14.01	57,441.00	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	2,900	30.74	89,146.00	
PINDUODUO INC ADR	32,510	57.71	1,876,152.10	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	32,200	8.46	272,412.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	25,900	15.11	391,349.00	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	26.42	224,570.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	7,100	15.77	111,967.00	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	56,300	4.11	231,393.00	
BEIGENE, LTD ADR	3,560	268.63	956,322.80	
I-MAB-SPONSORED ADR	2,300	46.93	107,939.00	
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	4,500	48.72	219,240.00	
ZAI LAB LTD - ADR	5,420	65.84	356,852.80	
HUTCHMED CHINA-ADR	7,800	35.30	275,340.00	
BANCO DE CHILE-ADR	18,100	16.11	291,591.00	
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	16.24	224,112.00	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	10,030	31.39	314,841.70	
CREDICORP LTD	4,970	119.89	595,853.30	
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	811,000	3.99	3,235,914.33	
STATE BANK OF INDIA-GDR	13,800	60.40	833,520.00	
TCS GROUP HOLDING-REG S	9,300	81.30	756,090.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	1.25	110,038.28	
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	6,000	6.38	38,280.00	
GDS HOLDINGS LTD-ADR	6,500	47.09	306,085.00	

	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	4,000	15.54	62,160.00	
	VNET GROUP INC	7,200	9.15	65,880.00	
	AGORA INC-ADR	3,400	16.72	56,848.00	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	29,000	4.76	138,214.00	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,100	38.93	159,613.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	28,650	7.92	226,908.00	
	ENEL AMERICAS S.A-ADR	29,900	5.50	164,450.00	
	ENEL CHILE SA-ADR	42,900	1.90	81,510.00	
	INTER RAO UES PJSC	2,280,000	0.05	129,230.40	
	360 DIGITECH INC-ADR	6,000	21.99	131,940.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	133,000	2.03	270,673.62	
	NOAH HLDS LTD ADR	3,000	30.32	90,960.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	109,400	2.05	224,270.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	29,730	4.08	121,298.40	
	51JOB INC-ADR	2,210	47.60	105,196.00	
	KE HOLDINGS INC ADR	25,590	19.00	486,210.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.90	79,584.38	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	12,020	45.91	551,838.20	
	IQIYI INC-ADR	21,400	4.91	105,074.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	46,700	6.50	303,550.00	
	AUTOHOME INC-ADR	4,810	28.23	135,786.30	
	BAIDU INC - SPON ADR	20,890	144.12	3,010,666.80	
	HELLO GROUP INC-SPN ADR	11,500	9.05	104,075.00	
	JOYY INC	4,250	49.56	210,630.00	
	KANZHUN LTD	5,000	32.96	164,800.00	
	VK CO LTD GDR	7,000	11.76	82,320.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	4,500	29.75	133,875.00	
	YANDEX NV-A	22,740	59.99	1,364,172.60	
小計	銘柄数：75			44,964,766.58 (5,144,868,592)	
	組入時価比率：7.4%			8.1%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	93,958	51.41	4,830,380.78	
	CEMEX SAB - CPO	1,121,985	13.94	15,640,470.90	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	230,983	88.70	20,488,192.10	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	243.97	2,051,787.70	

		ALFA S.A.B.-A	218,000	15.17	3,307,060.00	
		GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	61.62	2,150,538.00	
		GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	408.95	5,847,985.00	
		GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	30,400	278.11	8,454,544.00	
		PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,400	147.24	2,414,736.00	
		WALMART DE MEXICO-SER V	408,000	77.41	31,583,280.00	
		ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	32,000	130.83	4,186,560.00	
		BECLE SAB DE CV	47,000	51.39	2,415,330.00	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	38,000	113.50	4,313,000.00	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	144,200	158.63	22,874,446.00	
		GRUMA S.A.B.-B	15,600	261.43	4,078,308.00	
		GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	114,000	62.81	7,160,340.00	
		KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	110,000	31.29	3,441,900.00	
		GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	192,000	130.03	24,965,760.00	
		GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	169,000	24.09	4,071,210.00	
		TELESITES SAB DE CV	111,000	20.20	2,242,200.00	
		AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,631,000	21.53	56,645,430.00	
		GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	178,000	39.65	7,057,700.00	
		MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	66.88	1,544,928.00	
	小計	銘柄数：23			241,766,086.48	
					(1,340,230,300)	
		組入時価比率：1.9%			2.1%	
	レアル	COSAN SA	86,800	21.15	1,835,820.00	
		PETROBRAS - PETROLEO BRAS	278,000	30.44	8,462,320.00	
		PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	354,000	28.33	10,028,820.00	
		ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	14.27	684,960.00	
		BRASKEM SA-PREF A	13,200	57.24	755,568.00	
		KLABIN SA-UNIT	61,000	26.01	1,586,610.00	
		CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	24.65	1,138,830.00	
		GERDAU SA PFD NPV	95,000	26.95	2,560,250.00	
		VALE SA	308,852	79.15	24,445,635.80	
		SUZANO SA	52,960	60.19	3,187,662.40	
		WEG SA	134,748	33.47	4,510,015.56	
		LOCALIZA RENT A CAR	45,660	54.75	2,499,885.00	
		RUMO SA	96,000	17.67	1,696,320.00	

CCR SA	75,600	11.92	901,152.00	
ALPARGATAS SA-PREF	12,000	36.54	438,480.00	
AMERICANAS SA	43,039	30.73	1,322,588.47	
LOJAS RENNER S.A.	69,074	24.17	1,669,518.58	
MAGAZINE LUIZA SA	230,000	6.20	1,426,000.00	
VIA S/A	92,000	4.50	414,000.00	
VIBRA ENERGIA SA	83,600	21.04	1,758,944.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	15.39	455,544.00	
RAIA DROGASIL SA	78,200	24.10	1,884,620.00	
AMBEV SA	355,956	15.55	5,535,115.80	
BRF SA	39,700	22.62	898,014.00	
JBS SA	74,600	37.72	2,813,912.00	
NATURA &CO HOLDING SA	62,500	25.68	1,605,000.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	102,000	10.59	1,080,180.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	37,300	61.45	2,292,085.00	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	29,800	42.66	1,271,268.00	
HYPERA SA	23,900	28.38	678,282.00	
BANCO BRADESCO S.A.	111,049	16.25	1,804,546.25	
BANCO BRADESCO SA - PREF	373,039	19.24	7,177,270.36	
BANCO DO BRASIL SA	72,800	29.22	2,127,216.00	
BANCO INTER SA-UNITS	27,300	28.58	780,234.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	30.46	743,224.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	358,991	21.34	7,660,867.94	
ITAUSA SA	352,817	8.99	3,171,824.83	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	20.62	909,342.00	
TOTVS SA	40,000	28.74	1,149,600.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	41,605	49.87	2,074,841.35	
TIM SA	82,952	12.87	1,067,592.24	
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	32.66	587,880.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,000	33.25	997,500.00	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	69,683	13.08	911,453.64	
ENERGISA SA-UNITS	10,200	44.14	450,228.00	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	70,000	22.65	1,585,500.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	39.89	849,657.00	

	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	475,799	11.38	5,414,592.62	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	90,000	21.45	1,930,500.00	
	ENGIE BRASIL SA	12,000	38.60	463,200.00	
小計	銘柄数：50			131,694,470.84	
				(2,655,237,090)	
	組入時価比率：3.8%			4.2%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	6,500.00	168,350,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,413.00	101,666,763.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,603.00	130,670,600.00	
	CENCOSUD SA	126,000	1,359.90	171,347,400.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,396	25,700.00	87,277,200.00	
小計	銘柄数：5			659,311,963.00	
				(87,431,359)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	33,380.00	530,742,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	29,410.00	382,330,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	22,190.00	750,022,000.00	
小計	銘柄数：3			1,663,094,000.00	
				(47,640,990)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ユーロ	FF GROUP	2,030	0.00	0.00	
	OPAP SA	13,190	12.61	166,325.90	
	JUMBO SA	6,732	12.48	84,015.36	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	206,500	1.06	220,335.50	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	180,800	0.89	161,996.80	
	HELLENIC TELECOM	18,000	16.45	296,190.00	
	PUBLIC POWER CORP	20,000	9.11	182,200.00	
小計	銘柄数：7			1,111,063.56	
				(143,816,067)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	27,800	12.92	359,176.00	
小計	銘柄数：1			359,176.00	
				(55,032,946)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	154.60	1,283,180.00	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	28.38	3,292,080.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	21.62	896,365.20	
	KOC HLDGS	53,000	29.44	1,560,320.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	88,000	13.80	1,214,400.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	6,200	243.10	1,507,220.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	30,000	65.40	1,962,000.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	7.62	1,562,100.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	11.72	1,666,115.20	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	7.77	713,286.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	117,000	19.33	2,261,610.00	
小計	銘柄数：11			17,918,676.40	
				(184,850,857)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	921.00	4,651,050.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	92.80	3,897,600.00	
	CEZ AS	9,500	838.00	7,961,000.00	
小計	銘柄数：3			16,509,650.00	
				(85,386,258)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	37,500	2,470.00	92,625,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	9,200	8,725.00	80,270,000.00	
	OTP BANK NYRT	16,200	16,040.00	259,848,000.00	
小計	銘柄数：3			432,743,000.00	
				(151,519,335)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	73.00	1,372,400.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	5.85	572,736.66	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	139.55	1,381,545.00	
	LPP SA	94	17,260.00	1,622,440.00	
	ALLEGRO.EU SA	29,400	38.78	1,140,132.00	
	DINO POLSKA SA	3,820	355.60	1,358,392.00	
	BANK PEKAO SA	15,700	119.30	1,873,010.00	
	MBANK	1,100	405.20	445,720.00	
	PKO BANK POLSKI SA	63,000	43.80	2,759,400.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,100	329.30	1,020,830.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,500	34.98	1,766,490.00	

	ORANGE POLSKA SA	39,150	8.23	322,204.50	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	7.93	410,425.82	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	34.70	655,830.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,960	194.58	965,116.80	
小計	銘柄数：15			17,666,672.78	
				(494,276,404)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	130,000	6.80	884,000.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	150,000	4.84	726,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,930,900	3.69	7,125,021.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	245,000	18.56	4,547,200.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	129,000	6.20	799,800.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,700,000	3.48	5,916,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	138,000	16.64	2,296,320.00	
	DONGYUE GROUP LTD	108,000	12.10	1,306,800.00	
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS	69,000	15.32	1,057,080.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	91,000	40.00	3,640,000.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	309,000	9.65	2,981,850.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	176,000	6.01	1,057,760.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280,000	4.52	1,265,600.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	160,000	8.37	1,339,200.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	240,000	4.17	1,000,800.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	22,600	116.50	2,632,900.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	12.80	1,254,400.00	
	MMG LTD	168,000	2.46	413,280.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LTD	36,000	12.76	459,360.00	
	UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL	279,000	7.44	2,075,760.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	431,000	9.50	4,094,500.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	5.58	435,240.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	118,000	8.28	977,040.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	5.23	1,056,460.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	10.80	993,600.00	

CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	3.74	652,256.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	134,000	38.35	5,138,900.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	290,000	4.11	1,191,900.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	9.45	1,448,212.50	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	55,984	15.46	865,512.64	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	45.10	1,637,130.00	
CITIC LTD	473,000	7.77	3,675,210.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	225,940	8.35	1,886,599.00	
CRRC CORP LTD-H	320,000	3.41	1,091,200.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	57,000	19.52	1,112,640.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	77,000	7.45	573,650.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	50,000	12.70	635,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	149,800	15.60	2,336,880.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	116,000	4.96	575,360.00	
BOC AVIATION LTD	15,000	57.90	868,500.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	6.39	1,795,590.00	
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	5.25	535,500.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	4.49	475,940.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	273,000	14.82	4,045,860.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	4.67	457,660.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	106,000	14.42	1,528,520.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	6.74	687,480.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	7.98	542,640.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	7.83	618,570.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	7.01	799,140.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	41.45	1,807,220.00	
MINTH GROUP LTD	54,000	33.85	1,827,900.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	6.40	1,395,200.00	
BYD CO LTD-H	58,500	262.20	15,338,700.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	6.53	1,201,520.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	454,000	21.95	9,965,300.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	248,000	27.00	6,696,000.00	

		GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	7.75	1,549,147.50	
		YADEA GROUP HOLDINGS LTD	86,000	14.90	1,281,400.00	
		HAIER SMART HOME CO LTD-H	167,000	31.55	5,268,850.00	
		ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	80,000	115.30	9,224,000.00	
		BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	4.84	987,360.00	
		LI NING CO LTD	174,000	81.55	14,189,700.00	
		SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	63,700	150.60	9,593,220.00	
		HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	74,000	17.02	1,259,480.00	
		JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	13.50	769,500.00	
		TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	70,800	14.54	1,029,432.00	
		ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,140,680	113.00	128,896,840.00	
		HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	192,000	2.31	443,520.00	
		JD HEALTH INTERNATIONAL INC	22,400	60.60	1,357,440.00	
		JD.COM, INC.	130,770	261.20	34,157,124.00	
		MEITUAN-CLASS B	307,200	226.00	69,427,200.00	
		CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	42,000	40.40	1,696,800.00	
		GOME RETAIL HODINGS LTD	1,100,360	0.66	726,237.60	
		TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	112,000	7.64	855,680.00	
		ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	43,000	60.55	2,603,650.00	
		SUN ART RETAIL GROUP LTD	149,000	2.94	438,060.00	
		ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	112.97	790,790.00	
		CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	107,333	64.30	6,901,511.90	
		NONGFU SPRING LTD	139,400	50.00	6,970,000.00	
		TSING TAO BREWERY CO-H	42,000	72.80	3,057,600.00	
		CHINA FEIHE LTD	292,000	10.58	3,089,360.00	
		CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
		CHINA MENGNIU DAIRY CO	244,000	44.70	10,906,800.00	
		DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.13	460,495.00	
		TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	168,000	15.64	2,627,520.00	
		UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	125,000	7.42	927,500.00	
		WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	349,000	7.08	2,470,920.00	
		YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	39.10	1,212,100.00	
		SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	133,000	39.35	5,233,550.00	

		VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	19.16	440,680.00	
		HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	41.40	1,842,300.00	
		MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	29.00	1,363,000.00	
		SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	180,000	9.39	1,690,200.00	
		VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,000	27.35	410,250.00	
		HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO	25,200	49.40	1,244,880.00	
		JINXIN FERTILITY GROUP LTD	86,000	8.86	761,960.00	
		PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	28.10	1,028,460.00	
		SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	13.74	699,366.00	
		SINOPHARM GROUP CO-H	96,400	16.66	1,606,024.00	
		3SBIO,INC	77,000	6.61	508,970.00	
		AKESO INC	20,000	33.90	678,000.00	
		INNOVENT BIOLOGICS INC	84,000	49.40	4,149,600.00	
		CANSINO BIOLOGICS INC	5,800	179.60	1,041,680.00	
		CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	98,000	13.20	1,293,600.00	
		CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	248,000	4.10	1,016,800.00	
		CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	707,520	8.19	5,794,588.80	
		HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	84,000	18.94	1,590,960.00	
		SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	33.90	1,169,550.00	
		SINO BIOPHARMACEUTICAL	747,500	5.45	4,073,875.00	
		AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,910,000	2.67	5,099,700.00	
		BANK OF CHINA LTD-H	5,890,000	2.76	16,256,400.00	
		BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	745,790	4.64	3,460,465.60	
		CHINA BOHAI BANK CO LTD	160,000	1.98	316,800.00	
		CHINA CITIC BANK-H	640,000	3.39	2,169,600.00	
		CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,226,000	5.36	38,731,360.00	
		CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	2.73	701,610.00	
		CHINA MERCHANTS BANK-H	293,192	61.65	18,075,286.80	
		CHINA MINSHENG BANKING-H	374,800	3.01	1,128,148.00	
		IND & COMM BK OF CHINA-H	4,240,000	4.38	18,571,200.00	
		POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	556,000	5.67	3,152,520.00	
		FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.85	1,054,900.00	
		CHINA LIFE INSURANCE CO-H	582,000	12.90	7,507,800.00	

		CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	198,000	21.60	4,276,800.00	
		CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	10.76	1,113,358.72	
		NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	21.05	1,244,055.00	
		PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.35	1,379,450.00	
		PICC PROPERTY & CASUALTY -H	550,420	6.40	3,522,688.00	
		PING AN INSURANCE GROUP CO-H	475,500	56.15	26,699,325.00	
		ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	35,800	26.70	955,860.00	
		CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED	194,000	9.71	1,883,740.00	
		TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	13.12	865,920.00	
		CHINA YOUZAN LIMITED	888,000	0.59	523,920.00	
		KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	187,000	24.50	4,581,500.00	
		MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	57,000	18.52	1,055,640.00	
		WEIMOB INC	125,000	7.51	938,750.00	
		BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	27.60	1,421,400.00	
		ZTE CORP-H	47,252	20.90	987,566.80	
		LENOVO GROUP LTD	520,000	8.93	4,643,600.00	
		XIAOMI CORPORATION	1,064,000	18.64	19,832,960.00	
		AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,000	30.90	1,606,800.00	
		KINGBOARD HOLDINGS LTD	60,000	36.95	2,217,000.00	
		KINGBOARD LAMINATES HOLDING	65,000	12.76	829,400.00	
		SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	54,700	252.60	13,817,220.00	
		FLAT GLASS GROUP CO LTD	28,000	34.15	956,200.00	
		HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	46,000	42.00	1,932,000.00	
		XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	398,000	13.10	5,213,800.00	
		CHINA TOWER CORP LTD	3,610,000	0.85	3,068,500.00	
		BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	27.20	979,200.00	
		CHINA GAS HOLDINGS LTD	247,000	16.10	3,976,700.00	
		CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	68,000	44.00	2,992,000.00	
		ENN ENERGY HOLDINGS LTD	61,500	147.30	9,058,950.00	
		KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	7.35	2,322,600.00	
		BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	2.99	1,210,950.00	
		GUANGDONG INVESTMENT	240,000	9.77	2,344,800.00	
		CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.30	806,000.00	

CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.41	1,173,060.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	0.90	532,800.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	102,800	21.05	2,163,940.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	162,000	20.00	3,240,000.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	14.78	1,220,828.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	6.80	1,180,480.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	12.76	1,301,520.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	65,000	12.60	819,000.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CO.LTD	108,000	2.72	293,760.00	
CGN POWER CO LTD-H	980,000	2.43	2,381,400.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	240,000	18.72	4,492,800.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	490,000	5.60	2,744,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	28.70	4,305,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	5.70	1,356,600.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	290,000	6.55	1,899,500.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	98,000	34.65	3,395,700.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	95.40	763,200.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD	9,600	119.50	1,147,200.00	
WUXI APPTEC CO LTD	24,100	128.10	3,087,210.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	266,500	87.15	23,225,475.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	55,000	14.00	770,000.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	4.16	391,040.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	410,000	2.47	1,012,700.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	286,000	18.46	5,279,560.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	8.14	691,900.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	238,444	33.20	7,916,340.80	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	52,200	35.10	1,832,220.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	128,000	18.32	2,344,960.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	46,000	12.02	552,920.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	247,800	4.55	1,127,490.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	574,380	7.04	4,043,635.20	

		COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	129,000	47.40	6,114,600.00	
		GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	12.48	698,880.00	
		GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.	128,000	7.00	896,000.00	
		GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	143,200	3.25	465,400.00	
		HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	52,800	15.98	843,744.00	
		KWG GROUP HOLDINGS LTD	92,000	5.04	463,680.00	
		LOGAN GROUP CO LTD	128,000	5.82	744,960.00	
		LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	135,000	37.00	4,995,000.00	
		POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	101,000	4.05	409,050.00	
		SEAZEN GROUP LTD	168,000	5.16	866,880.00	
		SEAZEN GROUP LTD-RIGHTS	8,000	0.00	0.00	
		SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	103,000	5.20	535,600.00	
		SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	5.75	235,750.00	
		SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	190,000	11.18	2,124,200.00	
		SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	43,000	7.78	334,540.00	
		WHARF(HOLDING)	117,000	23.60	2,761,200.00	
		YUEXIU PROPERTY CO LTD	100,000	6.82	682,000.00	
		CHINA LITERATURE LTD	28,400	49.05	1,393,020.00	
		ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	0.74	643,800.00	
		KINGSOFT CORP LTD	67,000	33.80	2,264,600.00	
		NETEASE, INC.	151,250	150.70	22,793,375.00	
		KUAISHOU TECHNOLOGY	39,800	75.55	3,006,890.00	
		TENCENT HOLDINGS LTD	432,800	460.20	199,174,560.00	
	小計	銘柄数：212			1,071,189,055.86	
					(15,714,343,449)	
		組入時価比率：22.7%			24.9%	
	リンギ	DIALOG GROUP BHD	313,044	2.45	766,957.80	
		PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	19.82	287,390.00	
		PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	190,000	8.77	1,666,300.00	
		PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	248,000	5.53	1,371,440.00	
		HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	7.55	255,190.00	
		SIME DARBY BERHAD	220,000	2.23	490,600.00	
		MISC BHD	99,960	6.94	693,722.40	
		MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	5.85	330,291.00	
		WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.93	202,002.00	

		GENTING BHD	187,000	4.67	873,290.00	
		GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.88	659,520.00	
		FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	24.98	192,346.00	
		IOI CORP	162,000	3.73	604,260.00	
		KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	21.42	565,488.00	
		NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	132.50	583,000.00	
		PPB GROUP BERHAD	51,740	16.66	861,988.40	
		QL RESOURCES BHD	60,000	4.60	276,000.00	
		SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	3.71	535,353.00	
		HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	5.53	647,010.00	
		TOP GLOVE CORP BHD	428,000	2.19	937,320.00	
		IHH HEALTHCARE BHD	156,000	6.57	1,024,920.00	
		AMMB HOLDING	125,000	3.17	396,250.00	
		CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	508,000	5.36	2,722,880.00	
		HONG LEONG BANK	60,960	18.50	1,127,760.00	
		HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	17.36	233,005.92	
		MALAYAN BANKING	379,000	8.25	3,126,750.00	
		PUBLIC BANK BHD	1,052,000	4.12	4,334,240.00	
		RHB BANK BHD	125,023	5.32	665,122.36	
		INARI AMERTRON BHD	271,000	3.89	1,054,190.00	
		TELEKOM MALAYSIA	62,000	5.34	331,080.00	
		AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.69	719,550.00	
		DIGI.COM BERHAD	286,000	3.90	1,115,400.00	
		MAXIS BHD	146,200	4.37	638,894.00	
		TENAGA NASIONAL	182,000	9.31	1,694,420.00	
		PETRONAS GAS BERHAD	63,000	17.30	1,089,900.00	
	小計	銘柄数：35			33,073,830.88	
					(901,589,322)	
		組入時価比率：1.3%			1.4%	
	バーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	113,000	117.50	13,277,500.00	
		PTT PCL-NVDR	764,000	38.00	29,032,000.00	
		THAI OIL PCL-NVDR	83,000	49.00	4,067,000.00	
		INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	43.00	4,771,581.00	
		PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	58.50	8,891,649.00	
		SIAM CEMENT PCL-NVDR	58,700	380.00	22,306,000.00	
		SCG PACKAGING PLC-NVDR	89,700	69.00	6,189,300.00	

BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	9.35	4,450,600.00	
AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	294,000	60.25	17,713,500.00	
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	8.45	3,777,995.00	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	700,000	4.66	3,262,000.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	270,978	28.25	7,655,128.50	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	33.75	5,232,093.75	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	14.40	5,106,196.80	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	258,000	26.00	6,708,000.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	30.00	2,211,000.00	
CP ALL PCL-NVDR	421,000	58.25	24,523,250.00	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	20,900	120.00	2,508,000.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	112,000	33.00	3,696,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	23.80	6,640,200.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	19.50	3,896,100.00	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	56,000	29.75	1,666,000.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	782,000	22.70	17,751,400.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	139.50	4,491,900.00	
KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	12.90	3,444,945.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	123.00	6,248,400.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	26,300	420.00	11,046,000.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	4.66	4,287,200.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	85,700	224.00	19,196,800.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	76.75	10,745,000.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	68,000	57.50	3,910,000.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	56.75	2,780,750.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	59.75	3,764,250.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	154,000	20.90	3,218,600.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	40.00	1,360,000.00	
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	174.00	3,010,200.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	93.50	8,882,500.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	86.25	5,088,750.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	261,000	43.75	11,418,750.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	45.00	1,935,000.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	185,000	55.75	10,313,750.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	8.70	5,394,000.00	

小計	銘柄数：42 組入時価比率：1.6%			325,869,289.05 (1,114,472,968) 1.8%	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	56.50	8,249,000.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	871.00	18,379,842.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	570.00	3,115,050.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	255,005	53.50	13,642,767.50	
	SM INVESTMENTS CORP	17,100	961.50	16,441,650.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	193.60	13,358,400.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	43,000	219.00	9,417,000.00	
	MONDE NISSIN CORP	330,000	15.86	5,233,800.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	129.40	8,669,800.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	145,999	90.90	13,271,309.10	
	BDO UNIBANK INC	168,998	123.00	20,786,754.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	54.60	6,972,147.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.96	2,961,288.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	3,360.00	6,955,200.00	
	PLDT INC	4,970	1,836.00	9,124,920.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	299.00	5,053,100.00	
	AC ENERGY CORP	570,000	11.26	6,418,200.00	
	AYALA LAND LTD	608,000	35.25	21,432,000.00	
	SM PRIME HLDGS	773,975	34.55	26,740,836.25	
小計	銘柄数：19 組入時価比率：0.7%			216,223,063.85 (494,588,636) 0.8%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	2,220.00	1,863,024,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	147,050	22,150.00	3,257,157,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,660,000	875.00	1,452,500,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	127,000	11,625.00	1,476,375,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	7,275.00	1,280,400,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	760,000	2,280.00	1,732,800,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,060,000	3,860.00	4,091,600,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	240,000	7,575.00	1,818,000,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,660,000	5,675.00	9,420,500,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	8,725.00	1,553,050,000.00	

		INDOFOOD SUKSES MAK TBK	420,000	6,400.00	2,688,000,000.00	
		PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	5,850.00	2,919,150,000.00	
		GUDANG GARAM TBK	29,200	30,525.00	891,330,000.00	
		UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	4,200.00	2,198,700,000.00	
		KALBE FARMA PT	1,540,000	1,575.00	2,425,500,000.00	
		BANK CENTRAL ASIA	4,115,000	7,300.00	30,039,500,000.00	
		BANK MANDIRI	1,330,000	7,050.00	9,376,500,000.00	
		BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	6,725.00	3,355,775,000.00	
		BANK RAKYAT INDONESIA	5,055,828	4,070.00	20,577,219,960.00	
		SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	1,150.00	1,700,850,000.00	
		TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,800,000	4,110.00	15,618,000,000.00	
		TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	553,000	3,000.00	1,659,000,000.00	
	小計	銘柄数：22			121,394,931,460.00	
					(983,298,944)	
		組入時価比率：1.4%			1.6%	
	ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	41,150.00	148,140,000.00	
		S-OIL CORPORATION	3,930	88,700.00	348,591,000.00	
		SK INNOVATION CO LTD	3,900	223,500.00	871,650,000.00	
		HANWHA SOLUTIONS CORP	10,300	35,950.00	370,285,000.00	
		KUMHO PETRO CHEMICAL CO	1,490	184,500.00	274,905,000.00	
		LG CHEM LTD - PREFERRED	630	296,000.00	186,480,000.00	
		LG CHEMICALS LTD	3,383	621,000.00	2,100,843,000.00	
		LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	228,500.00	239,925,000.00	
		SK CHEMICALS CO LTD/NEW	900	153,000.00	137,700,000.00	
		SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,060	162,000.00	171,720,000.00	
		SKC CO LTD	1,450	170,500.00	247,225,000.00	
		POSCO CHEMICAL CO LTD	2,241	144,000.00	322,704,000.00	
		HYUNDAI STEEL CO	7,399	42,600.00	315,197,400.00	
		KOREA ZINC CO LTD	592	535,000.00	316,720,000.00	
		POSCO	5,510	284,000.00	1,564,840,000.00	
		KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	31,750.00	143,510,000.00	
		GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	41,800.00	176,396,000.00	
		HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	6,900	45,350.00	312,915,000.00	
		SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,400	22,600.00	325,440,000.00	
		DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	23,000	20,250.00	465,750,000.00	

		ECOPRO BM CO LTD	810	502,000.00	406,620,000.00	
		CJ CORP	1,100	84,700.00	93,170,000.00	
		LG CORP	6,554	82,500.00	540,705,000.00	
		SAMSUNG C&T CORP	6,720	117,000.00	786,240,000.00	
		SK INC	3,370	255,000.00	859,350,000.00	
		DOOSAN BOBCAT INC	3,350	40,450.00	135,507,500.00	
		HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	2,985	58,100.00	173,428,500.00	
		KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	3,210	93,700.00	300,777,000.00	
		SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	40,863	5,610.00	229,241,430.00	
		S-1 CORPORATION	1,450	75,100.00	108,895,000.00	
		HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	171,500.00	195,510,000.00	
		KOREAN AIR LINES CO LTD	12,600	29,200.00	367,920,000.00	
		HMM COMPANY LIMITED	20,600	27,650.00	569,590,000.00	
		PAN OCEAN CO LTD	14,890	5,540.00	82,490,600.00	
		CJ LOGISTICS	780	129,500.00	101,010,000.00	
		HANKOOK TIRE & TECHNONOGY CO	5,320	40,800.00	217,056,000.00	
		HANON SYSTEMS	11,650	14,000.00	163,100,000.00	
		HYUNDAI MOBIS	4,950	263,000.00	1,301,850,000.00	
		HYUNDAI MOTOR CO LTD	10,260	215,500.00	2,211,030,000.00	
		HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	105,000.00	277,200,000.00	
		HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	102,000.00	149,940,000.00	
		KIA CORP	20,260	85,100.00	1,724,126,000.00	
		COWAY CO LTD	4,970	77,400.00	384,678,000.00	
		LG ELECTRONICS INC	8,280	136,500.00	1,130,220,000.00	
		HLB INC	7,400	33,550.00	248,270,000.00	
		F&F CO LTD / NEW	320	880,000.00	281,600,000.00	
		KANGWON LAND INC	7,900	24,100.00	190,390,000.00	
		CJ ENM CO LTD	657	140,900.00	92,571,300.00	
		LOTTE SHOPPING CO	800	88,900.00	71,120,000.00	
		HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	77,900.00	152,684,000.00	
		BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	147,000.00	71,295,000.00	
		E-MART CO	1,181	151,500.00	178,921,500.00	
		CJ CHEILJEDANG CORP	510	387,500.00	197,625,000.00	
		ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	105,000.00	189,000,000.00	

KT & G CORP	9,410	84,200.00	792,322,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,460	175,500.00	431,730,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	45,700.00	69,464,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	670	1,122,000.00	751,740,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	616,000.00	64,064,000.00	
SD BIOSENSOR INC	3,500	54,000.00	189,000,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,814	81,800.00	475,585,200.00	
ALTEOGEN INC	2,130	70,000.00	149,100,000.00	
CELLTRION INC	7,050	201,000.00	1,417,050,000.00	
GREEN CROSS CORP	410	218,500.00	89,585,000.00	
SEEGENE, INC.	2,720	61,400.00	167,008,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,950	239,000.00	466,050,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,050	128,400.00	134,820,000.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	490	277,000.00	135,730,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,330	31,200.00	72,696,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,770	98,100.00	173,637,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,801	64,600.00	245,544,600.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	23,700	44,450.00	1,053,465,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	11,150.00	167,696,000.00	
KAKAOBANK CORP	7,000	60,200.00	421,400,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	30,700	57,400.00	1,762,180,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	32,400	37,900.00	1,227,960,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	42,300	13,400.00	566,820,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	58,700.00	167,295,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	2,510	216,000.00	542,160,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	67,700.00	314,128,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,570	161,000.00	413,770,000.00	
DUZONBIZON CO., LTD.	1,240	73,600.00	91,264,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	358,870	80,500.00	28,889,035,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	60,990	72,800.00	4,440,072,000.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,150	126,500.00	271,975,000.00	
L&F CO LTD	1,660	210,800.00	349,928,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,260	361,000.00	454,860,000.00	
LG.DISPLAY CO LTD	16,200	23,150.00	375,030,000.00	
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	4,070	196,500.00	799,755,000.00	

		SAMSUNG SDI CO,LTD	4,140	651,000.00	2,695,140,000.00	
		SK HYNIX INC	41,020	128,000.00	5,250,560,000.00	
		SK SQUARE CO LTD	1,629	65,800.00	107,188,200.00	
		LG UPLUS CORP	13,300	14,150.00	188,195,000.00	
		SK TELECOM CO LTD	2,520	61,700.00	155,484,000.00	
		KOREA ELECTRIC POWER	19,600	21,500.00	421,400,000.00	
		KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	84,900.00	266,586,000.00	
		MERITZ SECURITIES	24,500	5,260.00	128,870,000.00	
		MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	24,737	8,970.00	221,890,890.00	
		NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	13,400.00	103,582,000.00	
		SAMSUNG SECURITIES	3,565	49,550.00	176,645,750.00	
		SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,309	885,000.00	1,158,465,000.00	
		CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	23,600.00	139,240,000.00	
		HYBE CO LTD	1,220	340,500.00	415,410,000.00	
		KAKAO GAMES CORP	2,810	90,700.00	254,867,000.00	
		KRAFTON INC	1,630	463,000.00	754,690,000.00	
		NCSOFT CORPORATION	1,296	656,000.00	850,176,000.00	
		NETMARBLE CORP	1,470	121,000.00	177,870,000.00	
		PEARL ABYSS CORP	2,860	126,500.00	361,790,000.00	
		KAKAO CORP	22,850	114,500.00	2,616,325,000.00	
		NAVER CORP	9,130	384,000.00	3,505,920,000.00	
	小計	銘柄数：110 組入時価比率：12.8%			91,308,281,870.00 (8,820,380,028) 13.9%	
	新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	96.80	8,553,248.00	
		FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	247,998	80.40	19,939,039.20	
		FORMOSA PLASTIC	273,424	104.00	28,436,096.00	
		NAN YA PLASTICS CORP	399,726	85.90	34,336,463.40	
		ASIA CEMENT	152,980	44.25	6,769,365.00	
		TAIWAN CEMENT	395,294	47.90	18,934,582.60	
		CHINA STEEL	914,544	35.55	32,512,039.20	
		VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	5,000	1,560.00	7,800,000.00	
		FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	234,454	28.90	6,775,720.60	
		AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10,464	984.00	10,296,576.00	

HIWIN TECHNOLOGIES CORP	18,591	297.00	5,521,527.00	
EVERGREEN MARINE	202,375	139.00	28,130,125.00	
WAN HAI LINES LIMITED	42,900	199.00	8,537,100.00	
YANG MING MARINE TRANSPORT	143,000	122.50	17,517,500.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	29.40	4,204,200.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	36.05	5,120,397.80	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	418.50	4,185,000.00	
GIANT MANUFACTURING	18,752	343.50	6,441,312.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	14,443	625.00	9,026,875.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,815	227.50	7,465,412.50	
POU CHEN CORP	175,468	32.95	5,781,670.60	
MOMO.COM INC	3,000	1,655.00	4,965,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	23,000	610.00	14,030,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	42,816	274.50	11,752,992.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	378,836	68.50	25,950,266.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	22,000	287.00	6,314,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	359,013	16.75	6,013,467.75	
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,400,212	25.85	36,195,480.20	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	871,063	27.95	24,346,210.85	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	769,943	24.20	18,632,620.60	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	686,374	20.95	14,379,535.30	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	858,380	35.50	30,472,490.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	759,549	15.95	12,114,806.55	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	711,051	18.75	13,332,206.25	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	743,020	25.05	18,612,651.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	291,574	47.40	13,820,607.60	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	96,571	255.00	24,625,605.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	759,152	25.00	18,978,800.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	586,035	61.10	35,806,738.50	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	1,089,789	16.85	18,362,944.65	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	587,775	75.20	44,200,680.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,030,113	10.70	11,022,209.10	
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	36,000	259.00	9,324,000.00	
ACER INC	256,767	29.85	7,664,494.95	

		ADVANTECH CO.,LTD.	26,750	397.00	10,619,750.00	
		ASUSTEK COMPUTER INC	49,805	370.00	18,427,850.00	
		CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	45,840	156.00	7,151,040.00	
		COMPAL ELECTRONICS	354,590	24.05	8,527,889.50	
		INVENTEC CO.,LTD	251,911	25.00	6,297,775.00	
		LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	62.70	9,147,741.90	
		MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	160.50	8,346,000.00	
		PEGATRON CORP	159,692	68.70	10,970,840.40	
		QUANTA COMPUTER INC	188,684	90.50	17,075,902.00	
		WISTRON CORP	212,457	29.10	6,182,498.70	
		WIWYNN CORP	5,000	1,110.00	5,550,000.00	
		AU OPTRONICS CORP	572,008	22.45	12,841,579.60	
		DELTA ELECTRONICS INC	143,681	270.50	38,865,710.50	
		FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	64.60	3,542,276.40	
		HON HAI PRECISION INDUSTRY	924,649	104.00	96,163,496.00	
		INNOLUX CORP	660,322	19.05	12,579,134.10	
		LARGAN PRECISION CO LTD	7,040	2,445.00	17,212,800.00	
		NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	16,000	567.00	9,072,000.00	
		SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	122,566	66.50	8,150,639.00	
		UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	239.00	23,900,000.00	
		WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	51.20	6,163,814.40	
		YAGEO CORPORATION	28,377	473.00	13,422,321.00	
		ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	64,410	101.00	6,505,410.00	
		ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	248,658	105.00	26,109,090.00	
		ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,795.00	3,590,000.00	
		EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,000	2,150.00	10,750,000.00	
		GLOBALWAFERS CO LTD	15,000	846.00	12,690,000.00	
		MEDIATEK INC	113,538	1,120.00	127,162,560.00	
		NANYA TECHNOLOGY CO	100,000	75.70	7,570,000.00	
		NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	43,058	530.00	22,820,740.00	
		PARADE TECHNOLOGIES LTD	6,000	2,055.00	12,330,000.00	
		REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,417	564.00	18,283,188.00	
		SILERGY CORP	6,000	4,800.00	28,800,000.00	
		TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,851,000	604.00	1,118,004,000.00	
		UNITED MICROELECTRONICS CORP	904,500	64.30	58,159,350.00	

	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	156.00	10,764,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	24,000	370.00	8,880,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	31.65	7,659,300.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	287,065	115.50	33,156,007.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	63.90	6,709,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	128,200	99.80	12,794,360.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	65,112	63.30	4,121,589.60	
小計	銘柄数：86			2,584,272,209.80	
				(10,661,156,574)	
	組入時価比率：15.4%			16.9%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	70,000	372.15	26,050,500.00	
	COAL INDIA LTD	142,000	145.90	20,717,800.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	291.65	10,026,927.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	110.25	12,458,250.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	157,000	138.50	21,744,500.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	216.05	7,557,429.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	214,300	2,372.80	508,491,040.00	
	ASIAN PAINTS LTD	29,800	3,284.80	97,887,040.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	740.90	14,077,100.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,000	2,902.90	20,320,300.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,400	2,410.20	29,886,480.00	
	SRF LTD	11,000	2,315.95	25,475,450.00	
	UPL LTD	32,100	746.85	23,973,885.00	
	ACC LIMITED	6,000	2,126.05	12,756,300.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	367.90	20,970,300.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	1,610.90	28,512,930.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	880	26,310.95	23,153,636.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	8,130	7,224.80	58,737,624.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	458.90	53,691,300.00	
	JSW STEEL LTD	66,000	651.30	42,985,800.00	
	TATA STEEL LIMITED	56,200	1,115.45	62,688,290.00	
	VEDANTA LTD	82,000	345.80	28,355,600.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	84,800	204.05	17,303,440.00	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	53,700	1,859.40	99,849,780.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	1,361.05	24,090,585.00	

SIEMENS LIMITED	7,000	2,374.35	16,620,450.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	19,100	1,698.20	32,435,620.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,200	837.20	18,585,840.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,967.60	9,857,676.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	602.25	7,455,855.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	722.40	30,774,240.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	2,202.50	15,417,500.00	
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	690.90	8,774,430.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	106,000	214.75	22,763,500.00	
MRF LTD	200	70,090.70	14,018,140.00	
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,152.05	17,619,959.50	
EICHER MOTORS LTD	11,600	2,437.90	28,279,640.00	
HERO MOTOCORP LTD	9,300	2,392.45	22,249,785.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	62,200	812.65	50,546,830.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,660	7,317.10	70,683,186.00	
TATA MOTORS LTD	134,000	467.60	62,658,400.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	340	39,294.85	13,360,249.00	
TITAN CO LTD	26,900	2,319.45	62,393,205.00	
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	4,700	3,434.25	16,140,975.00	
ZOMATO LTD	143,000	131.45	18,797,350.00	
TRENT LTD	15,000	1,041.00	15,615,000.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	11,500	4,628.90	53,232,350.00	
UNITED SPIRITS LTD	22,600	886.35	20,031,510.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	7,600	3,541.30	26,913,880.00	
NESTLE INDIA LIMITED	2,360	19,224.20	45,369,112.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,300	718.95	32,568,435.00	
ITC LTD	221,100	218.00	48,199,800.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	61,000	2,296.95	140,113,950.00	
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,457.65	14,868,030.00	
DABUR INDIA LTD	45,900	563.70	25,873,830.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	966.25	26,282,000.00	
MARICO LIMITED	46,000	505.60	23,257,600.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	7,000	4,842.50	33,897,500.00	
BIOCON LTD	31,000	354.45	10,987,950.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	708.45	13,248,015.00	

CIPLA LIMITED	34,500	908.30	31,336,350.00	
DR.REDDYS LABORATORIES	9,140	4,638.65	42,397,261.00	
LUPIN LTD	14,900	897.75	13,376,475.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	61,700	785.40	48,459,180.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,270	3,046.20	9,961,074.00	
AXIS BANK LIMITED	176,200	667.50	117,613,500.00	
BANDHAN BANK LTD	56,000	255.05	14,282,800.00	
ICICI BANK LTD	385,300	727.10	280,151,630.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	43,500	1,748.40	76,055,400.00	
YES BANK LTD	839,000	13.25	11,116,750.00	
BAJAJ FINSERV LTD	3,160	15,920.55	50,308,938.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	2,576.80	20,426,293.60	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	61,700	637.35	39,324,495.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	16,000	1,340.35	21,445,600.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,200	564.35	18,736,420.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	36,500	1,148.20	41,909,300.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	84,900	1,265.20	107,415,480.00	
INFOSYS LTD	256,000	1,863.50	477,056,000.00	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,000	7,166.55	28,666,200.00	
MINDTREE LIMITED	4,880	4,621.05	22,550,724.00	
MPHASIS LTD	6,200	3,218.00	19,951,600.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	69,600	3,670.90	255,494,640.00	
TECH MAHINDRA LTD	49,700	1,723.80	85,672,860.00	
WIPRO LTD	106,000	698.45	74,035,700.00	
INDUS TOWERS LTD	61,000	249.80	15,237,800.00	
BHARTI AIRTEL LIMITED	191,500	677.05	129,655,075.00	
ADANI TRANSMISSION LTD	19,100	1,768.40	33,776,440.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	218,666	205.40	44,913,996.40	
TATA POWER COMPANY LIMITED	106,000	216.80	22,980,800.00	
ADANI TOTAL GAS LTD	19,000	1,712.40	32,535,600.00	
GAIL INDIA LTD	94,600	130.85	12,378,410.00	
INDRAPRASTHA GAS LTD	13,500	494.25	6,672,375.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	127,000	2,534.55	321,887,850.00	
BAJAJ FINANCE LTD	20,040	6,852.00	137,314,080.00	

	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	28,600	520.05	14,873,430.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,472.85	14,728,500.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	13,100	907.25	11,884,975.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,700	1,177.55	18,487,535.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,800	2,349.10	11,275,680.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	28,000	1,385.40	38,791,200.00	
	NTPC LIMITED	396,000	121.25	48,015,000.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	9,700	4,447.25	43,138,325.00	
	DLF LIMITED	58,000	379.60	22,016,800.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,300	1,828.70	17,006,910.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	4,860	5,399.55	26,241,813.00	
小計	銘柄数：105			5,293,211,343.50	
				(8,151,545,468)	
	組入時価比率：11.8%			12.9%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	17.68	613,496.00	
	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	220,000	3.29	724,460.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.18	664,900.00	
	INDUSTRIES QATAR	143,000	15.40	2,202,200.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	6.69	788,751.00	
	MASRAF AL RAYAN	381,000	4.84	1,844,040.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	9.40	441,800.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	83,900	18.23	1,529,497.00	
	QATAR NATIONAL BANK	347,000	20.04	6,953,880.00	
	OOREDOO QSC	43,100	6.82	294,157.50	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	16.42	564,848.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	113,000	3.18	359,340.00	
小計	銘柄数：12			16,981,369.50	
				(530,497,983)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
エジプトポンド	EASTERN TOBACCO	51,525	10.69	550,802.25	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	121,733	52.50	6,390,982.50	
	FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	37,000	12.80	473,600.00	
小計	銘柄数：3			7,415,384.75	
				(54,027,751)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	15,000	152.50	2,287,500.00	

		SASOL LTD	43,800	252.78	11,071,764.00	
		AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	227.11	1,589,770.00	
		ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,781.05	7,320,115.50	
		ANGLOGOLD ASHANTI LTD	31,000	313.22	9,709,820.00	
		GOLD FIELDS LTD	71,600	165.59	11,856,244.00	
		HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	62.38	2,545,104.00	
		IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	65,200	216.84	14,137,968.00	
		KUMBA IRON ORE LTD	3,900	455.22	1,775,358.00	
		NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	26,700	203.69	5,438,523.00	
		SIBANYE STILLWATER LTD	205,000	48.65	9,973,250.00	
		BIDVEST GROUP LTD	25,500	186.07	4,744,785.00	
		NASPERS LTD-N SHS	16,130	2,445.10	39,439,463.00	
		WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	51.44	3,169,218.40	
		MR PRICE GROUP LTD	16,700	195.00	3,256,500.00	
		PEPKOR HOLDINGS LTD	96,000	21.51	2,064,960.00	
		BID CORP LTD	27,300	318.03	8,682,219.00	
		CLICKS GROUP LTD	18,300	307.90	5,634,570.00	
		SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,600	204.38	8,093,448.00	
		SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	163.60	2,503,080.00	
		TIGER BRANDS LTD	12,800	179.00	2,291,200.00	
		ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	31,500	221.00	6,961,500.00	
		ABSA GROUP LTD	55,200	149.31	8,241,912.00	
		CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,490	1,985.36	12,884,986.40	
		NEDBANK GROUP LTD	35,779	172.62	6,176,170.98	
		STANDARD BANK GROUP LTD	91,100	136.60	12,444,260.00	
		FIRSTRAND LTD	377,000	59.22	22,325,940.00	
		REMGRO LTD	33,200	128.99	4,282,468.00	
		DISCOVERY LTD	38,500	141.00	5,428,500.00	
		OLD MUTUAL LTD	294,000	12.70	3,733,800.00	
		RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	44.14	1,781,049.00	
		SANLAM LIMITED	149,000	58.10	8,656,900.00	
		MTN GROUP LTD	133,000	168.96	22,471,680.00	
		VODACOM GROUP	51,700	132.52	6,851,284.00	
		REINET INVESTMENTS SCA	8,790	286.01	2,514,027.90	
		NEPI ROCKCASTLE PLC	26,281	105.40	2,770,017.40	

	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	120.20	3,204,532.00	
小計	銘柄数：37			288,313,887.58	
				(2,119,107,073)	
	組入時価比率：3.1%			3.3%	
ＵＡＥディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	179,000	4.20	751,800.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	173,870	8.42	1,463,985.40	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	128,000	6.72	860,160.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	214,029	5.38	1,151,476.02	
	EMIRATES NBD PJSC	197,000	13.55	2,669,350.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	336,000	19.00	6,384,000.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	257,400	31.00	7,979,400.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	3.96	1,096,920.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	290,000	4.76	1,380,400.00	
小計	銘柄数：9			23,737,491.42	
				(740,609,732)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
クウェートディナール	AGILITY	79,200	0.94	75,002.40	
	BOUBYAN BANK K.S.C	71,400	0.78	55,977.60	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	343,200	0.83	287,601.60	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	529,000	0.99	523,710.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	189,000	0.59	112,455.00	
	MABANEE CO SAKC	38,160	0.80	30,756.96	
小計	銘柄数：6			1,085,503.56	
				(410,863,097)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
サウジアラビアリヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	20.52	196,992.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	169,000	35.50	5,999,500.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,020	68.20	615,164.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	19.86	556,080.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	16,600	179.80	2,984,680.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	42.30	1,239,390.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	66,500	114.60	7,620,900.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	18,700	31.10	581,570.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	47,000	17.08	802,760.00	

		SAUDI NATIONAL PETROCHEMICAL COMPANY	8,400	40.30	338,520.00	
		YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,900	68.00	1,353,200.00	
		SAUDI CEMENT	6,400	55.60	355,840.00	
		SAUDI ARABIAN MINING CO	35,100	76.60	2,688,660.00	
		JARIR MARKETING CO	3,730	196.00	731,080.00	
		ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,700	109.20	404,040.00	
		ALMARAI CO	18,000	48.20	867,600.00	
		SAVOLA	16,600	32.05	532,030.00	
		DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	5,100	159.60	813,960.00	
		MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,400	175.80	597,720.00	
		AL RAJHI BANK	92,700	140.00	12,978,000.00	
		ALINMA BANK	81,000	23.70	1,919,700.00	
		ARAB NATIONAL BANK	47,800	22.48	1,074,544.00	
		BANK AL - JAZIRA	34,100	19.04	649,264.00	
		BANK ALBILAD	32,000	45.25	1,448,000.00	
		BANQUE SAUDI FRANSI	49,200	45.70	2,248,440.00	
		RIYAD BANK	97,500	27.60	2,691,000.00	
		SAUDI BRITISH BANK	61,100	31.70	1,936,870.00	
		THE SAUDI NATIONAL BANK	161,900	63.00	10,199,700.00	
		BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	3,900	134.40	524,160.00	
		CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	75.10	202,770.00	
		SAUDI TELECOM CO	43,600	110.40	4,813,440.00	
		ETIHAD ETISALAT CO	23,900	30.65	732,535.00	
		MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	11.94	346,260.00	
		SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	24.12	1,403,784.00	
		DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	23,000	9.80	225,400.00	
		EMAAR ECONOMIC CITY	35,000	11.24	393,400.00	
	小計	銘柄数：36 組入時価比率：3.2%			73,066,953.00 (2,230,003,405) 3.5%	
合計					63,316,774,628 (63,316,774,628)	

(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12月27日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	4,261,400	27,635,179.00	
	小計	銘柄数：1	4,261,400	27,635,179.00	
				(3,162,017,181)	
		組入時価比率：4.6%		98.1%	
	合計			3,162,017,181	
				(3,162,017,181)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	234,000	5,002,920.00	
	小計	銘柄数：1	234,000	5,002,920.00	
				(27,733,687)	
		組入時価比率：0.0%		0.9%	
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	300,000	4,440,000.00	
	小計	銘柄数：1	300,000	4,440,000.00	
				(32,634,000)	
		組入時価比率：0.0%		1.0%	
	合計			60,367,687	
				(60,367,687)	
合計				3,222,384,868	
				(3,222,384,868)	

(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12月27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	2,561,097,186	－	2,553,552,903	△7,544,283

市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	54,872,254	－	54,920,612	48,358
米ドル	54,872,254	－	54,920,612	48,358
合計	－	－	－	△7,495,925

（注）時価の算定方法

１先物取引

外国先物取引について

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

２為替予約取引

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

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

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

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2021年12月27日現在)
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,743,400,537
国債証券	667,996,321,350
地方債証券	57,504,631,814
特殊債券	65,497,561,318
社債券	38,793,043,050
未収利息	1,012,269,014
前払費用	21,871,577
流動資産合計	836,569,098,660
資産合計	836,569,098,660
負債の部	
流動負債	
未払金	99,460,000
未払解約金	220,960,649
未払利息	2,811
流動負債合計	320,423,460

	(2021年12月27日現在)
負債合計	320,423,460
純資産の部	
元本等	
元本	628,554,162,177
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	207,694,513,023
元本等合計	836,248,675,200
純資産合計	836,248,675,200
負債純資産合計	836,569,098,660

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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12月27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	1.3304円
(10,000口当たり純資産額)	(13,304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12月29日 至 2021年12月27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12月27日現在
１．貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 ２．時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）
元本の移動及び期末元本額の内訳

2021年12月27日現在	
期首	2020年12月29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	532,981,539,158円
同期中における追加設定元本額	149,786,862,930円
同期中における一部解約元本額	54,214,239,911円
期末元本額	628,554,162,177円
期末元本額の内訳＊	
野村国内債券インデックスファンド	399,427,582円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	42,052,699,637円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	18,085,464,962円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	3,487,037,697円
野村資産設計ファンド２０１５	349,048,325円
野村資産設計ファンド２０２０	348,991,344円
野村資産設計ファンド２０２５	361,498,813円
野村資産設計ファンド２０３０	293,099,979円
野村資産設計ファンド２０３５	157,667,896円
野村資産設計ファンド２０４０	210,246,722円
野村日本債券インデックスファンド	811,404,699円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	162,301,424,009円
のむラップ・ファンド（保守型）	15,045,585,655円
のむラップ・ファンド（普通型）	17,245,499,166円

のむラップ・ファンド（積極型）	2,542,437,457円
野村日本債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	10,249,324,911円
野村資産設計ファンド２０４５	24,900,165円
野村円債投資インデックスファンド	737,763,762円
野村インデックスファンド・国内債券	2,072,669,585円
マイ・ロード	34,545,624,244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	1,444,910,912円
野村日本債券インデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	20,974,655,239円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,990,830,699円
野村資産設計ファンド２０５０	24,432,263円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型	29,798,474円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型	8,290,793円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型	4,318,789円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型	2,758,515円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	1,289,017,237円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	492,764,213円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	61,267,879円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	28,839,449円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	122,881,660円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	16,460,769円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	15,209,389円
野村６資産均等バランス	3,881,266,674円
世界６資産分散ファンド	121,115,825円
野村資産設計ファンド２０６０	11,175,091円
ＮＥＸＴ　ＦＵＮＤＳ　国内債券・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合連動型上場投信	34,337,109,521円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	27,977,405,232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）	548,446,313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）	88,383,047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）	1,754,166,180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）	898,806,067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）	16,112,223円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡバランス型（適格機関投資家専用）	11,271,133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）	694,936円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,638,307,329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）	7,400,409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）	63,774,429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）	45,175,937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）	375,034,814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）	301,622,438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）	940,628,287円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	144,461,470円
ノムラ日本債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	1,838,251,690円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	327,274,364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）	15,355,542円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	38,483,827,250円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	51,494,330,468円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	19,928,792,888円

野村国内債券インデックスファンド・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合（確定拠出年金向け）	51,305,795,701円
マイバランスＤＣ３０	14,075,750,374円
マイバランスＤＣ５０	11,657,957,930円
マイバランスＤＣ７０	4,113,633,846円
野村ＤＣ国内債券インデックスファンド・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合	13,259,356,077円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	1,287,511,243円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	3,312,821,281円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	1,500,552,314円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	212,110,709円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	31,765,419円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	37,044,429円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	76,391,305円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	29,309,070円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	10,986,212円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	996,237,666円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	513,417,594円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	193,540,675円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	260,195,752円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	5,492,500円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	60,744,069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）	534,507,053円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	598,511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12月27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12月27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４２０回	300,000,000	300,621,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２１回	2,500,000,000	2,505,600,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２２回	1,400,000,000	1,403,360,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２３回	5,200,000,000	5,207,176,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２４回	2,600,000,000	2,603,822,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２６回	1,500,000,000	1,502,490,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２７回	6,800,000,000	6,811,900,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２８回	2,400,000,000	2,404,416,000	
		国庫債券　利付（２年）第４２９回	1,500,000,000	1,502,895,000	

		国庫債券　利付（５年）第１３５回	8,500,000,000	8,520,825,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３６回	4,300,000,000	4,313,029,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３７回	6,600,000,000	6,623,430,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３８回	7,100,000,000	7,129,536,000	
		国庫債券　利付（５年）第１３９回	5,200,000,000	5,223,764,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４０回	5,100,000,000	5,125,296,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４１回	7,100,000,000	7,138,837,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４２回	1,200,000,000	1,207,164,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４３回	6,070,000,000	6,109,272,900	
		国庫債券　利付（５年）第１４４回	4,400,000,000	4,431,460,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４５回	4,400,000,000	4,432,912,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４６回	2,100,000,000	2,116,338,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４７回	3,600,000,000	3,614,472,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４８回	6,300,000,000	6,326,901,000	
		国庫債券　利付（５年）第１４９回	7,100,000,000	7,130,317,000	
		国庫債券　利付（４０年）第１回	2,360,000,000	3,383,886,000	
		国庫債券　利付（４０年）第２回	900,000,000	1,251,630,000	
		国庫債券　利付（４０年）第３回	900,000,000	1,261,269,000	
		国庫債券　利付（４０年）第４回	1,130,000,000	1,591,424,200	
		国庫債券　利付（４０年）第５回	1,200,000,000	1,634,004,000	
		国庫債券　利付（４０年）第６回	1,300,000,000	1,746,719,000	
		国庫債券　利付（４０年）第７回	1,400,000,000	1,810,956,000	
		国庫債券　利付（４０年）第８回	1,500,000,000	1,817,310,000	
		国庫債券　利付（４０年）第９回	2,050,000,000	1,869,866,500	
		国庫債券　利付（４０年）第１０回	2,010,000,000	2,141,735,400	
		国庫債券　利付（４０年）第１１回	1,750,000,000	1,808,397,500	
		国庫債券　利付（４０年）第１２回	2,070,000,000	1,936,298,700	
		国庫債券　利付（４０年）第１３回	7,020,000,000	6,547,203,000	
		国庫債券　利付（４０年）第１４回	4,460,000,000	4,425,925,600	
		国庫債券　利付（１０年）第３２８回	5,250,000,000	5,295,045,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	6,079,860,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,859,204,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,923,028,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	5,982,423,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３３回	3,600,000,000	3,656,160,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	6,714,708,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３５回	4,600,000,000	4,675,486,000	
			2,750,000,000	2,799,280,000	

		国庫債券　利付（１０年）第３３６回			
		国庫債券　利付（１０年）第３３７回	3,000,000,000	3,035,820,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３８回	5,000,000,000	5,080,850,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３３９回	5,000,000,000	5,087,200,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４０回	4,200,000,000	4,278,582,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４１回	7,300,000,000	7,415,121,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４２回	8,550,000,000	8,618,827,500	
		国庫債券　利付（１０年）第３４３回	9,500,000,000	9,581,130,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４４回	6,400,000,000	6,456,192,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４５回	6,000,000,000	6,055,440,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４６回	5,100,000,000	5,149,470,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４７回	5,400,000,000	5,454,918,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４８回	5,800,000,000	5,861,770,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３４９回	2,800,000,000	2,831,108,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５０回	7,150,000,000	7,230,509,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５１回	8,500,000,000	8,599,535,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５２回	6,900,000,000	6,983,973,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５３回	4,700,000,000	4,759,361,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５４回	4,350,000,000	4,406,854,500	
		国庫債券　利付（１０年）第３５５回	5,100,000,000	5,167,065,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５６回	4,800,000,000	4,861,488,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５７回	1,900,000,000	1,923,598,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３５８回	5,470,000,000	5,533,178,500	
		国庫債券　利付（１０年）第３５９回	5,600,000,000	5,661,824,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３６０回	7,900,000,000	7,979,395,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３６１回	7,400,000,000	7,466,378,000	
			9,800,000,000	9,872,128,000	

		国庫債券　利付（１０年）第３６２回			
		国庫債券　利付（１０年）第３６３回	7,450,000,000	7,492,167,000	
		国庫債券　利付（１０年）第３６４回	7,650,000,000	7,679,529,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１回	500,000,000	610,560,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２回	500,000,000	599,975,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３回	160,000,000	191,443,200	
		国庫債券　利付（３０年）第４回	1,400,000,000	1,761,956,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５回	150,000,000	180,483,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６回	600,000,000	737,754,000	
		国庫債券　利付（３０年）第７回	600,000,000	736,518,000	
		国庫債券　利付（３０年）第８回	100,000,000	118,205,000	
		国庫債券　利付（３０年）第９回	265,000,000	301,914,500	
		国庫債券　利付（３０年）第１０回	250,000,000	276,827,500	
		国庫債券　利付（３０年）第１１回	160,000,000	188,299,200	
		国庫債券　利付（３０年）第１２回	220,000,000	269,601,200	
		国庫債券　利付（３０年）第１３回	290,000,000	352,918,400	
		国庫債券　利付（３０年）第１４回	800,000,000	1,014,856,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,156,194,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,179,883,350	
		国庫債券　利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,536,864,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１８回	2,200,000,000	2,797,036,000	
		国庫債券　利付（３０年）第１９回	2,050,000,000	2,613,217,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２０回	1,270,000,000	1,658,073,900	
		国庫債券　利付（３０年）第２１回	300,000,000	384,618,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２２回	600,000,000	787,602,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,106,364,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２４回	700,000,000	924,392,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２５回	500,000,000	647,515,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,115,574,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２７回	1,550,000,000	2,068,382,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,609,692,000	
		国庫債券　利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	1,996,995,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,245,819,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３１回	1,200,000,000	1,570,572,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３２回	1,200,000,000	1,596,780,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３３回	2,400,000,000	3,077,088,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３４回	3,800,000,000	5,025,538,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	2,964,769,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３６回	2,000,000,000	2,586,640,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	2,940,665,000	
		国庫債券　利付（３０年）第３８回	1,600,000,000	2,020,432,000	

		国庫債券　利付（３０年）第３９回	1,400,000,000	1,799,308,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４０回	1,300,000,000	1,647,373,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	1,871,250,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４２回	1,600,000,000	1,998,016,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,625,052,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,751,806,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	2,056,728,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,179,080,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	2,097,290,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,262,710,000	
		国庫債券　利付（３０年）第４９回	2,900,000,000	3,455,118,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５０回	1,900,000,000	2,005,811,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５１回	2,650,000,000	2,493,623,500	
		国庫債券　利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	1,871,158,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,711,135,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,788,196,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,576,740,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	1,993,575,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５７回	1,600,000,000	1,677,568,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５８回	2,100,000,000	2,197,650,000	
		国庫債券　利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,634,688,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６０回	1,150,000,000	1,228,050,500	
		国庫債券　利付（３０年）第６１回	1,000,000,000	1,017,310,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６２回	700,000,000	675,710,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６３回	1,400,000,000	1,313,802,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６４回	1,500,000,000	1,405,290,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６５回	1,200,000,000	1,122,336,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６６回	2,600,000,000	2,433,366,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６７回	1,300,000,000	1,279,759,000	
		国庫債券　利付（３０年）第６８回	1,950,000,000	1,921,744,500	
		国庫債券　利付（３０年）第６９回	2,200,000,000	2,226,818,000	
		国庫債券　利付（３０年）第７０回	1,610,000,000	1,625,761,900	
		国庫債券　利付（３０年）第７１回	2,400,000,000	2,420,688,000	
		国庫債券　利付（３０年）第７２回	1,300,000,000	1,309,659,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６１回	300,000,000	304,044,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６２回	440,000,000	445,856,400	
		国庫債券　利付（２０年）第６３回	300,000,000	308,427,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６４回	400,000,000	413,852,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６５回	455,000,000	473,081,700	
		国庫債券　利付（２０年）第６６回	300,000,000	311,328,000	
		国庫債券　利付（２０年）第６７回	310,000,000	323,785,700	
		国庫債券　利付（２０年）第６８回	290,000,000	304,836,400	

		国庫債券　利付（２０年）第６９回	560,000,000	587,400,800	
		国庫債券　利付（２０年）第７０回	540,000,000	573,442,200	
		国庫債券　利付（２０年）第７１回	200,000,000	211,394,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７２回	1,470,000,000	1,558,273,500	
		国庫債券　利付（２０年）第７３回	1,200,000,000	1,275,072,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７４回	800,000,000	852,440,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７５回	600,000,000	642,594,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７６回	910,000,000	968,713,200	
		国庫債券　利付（２０年）第７７回	700,000,000	747,432,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７８回	800,000,000	855,672,000	
		国庫債券　利付（２０年）第７９回	860,000,000	922,840,200	
		国庫債券　利付（２０年）第８０回	1,400,000,000	1,507,184,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８１回	360,000,000	388,148,400	
		国庫債券　利付（２０年）第８２回	820,000,000	887,182,600	
		国庫債券　利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,489,779,100	
		国庫債券　利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,300,128,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８５回	400,000,000	437,056,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８６回	1,700,000,000	1,871,904,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８７回	500,000,000	548,440,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,217,887,000	
		国庫債券　利付（２０年）第８９回	470,000,000	518,259,600	
		国庫債券　利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,662,720,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９１回	250,000,000	278,307,500	
		国庫債券　利付（２０年）第９２回	650,000,000	720,999,500	
		国庫債券　利付（２０年）第９３回	300,000,000	332,826,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９４回	200,000,000	222,932,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９５回	100,000,000	113,123,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９６回	400,000,000	448,088,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９７回	300,000,000	339,363,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９８回	300,000,000	337,638,000	
		国庫債券　利付（２０年）第９９回	1,100,000,000	1,244,034,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１００回	820,000,000	936,661,400	
		国庫債券　利付（２０年）第１０１回	250,000,000	288,695,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０２回	1,500,000,000	1,741,620,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０３回	600,000,000	692,742,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０４回	400,000,000	456,620,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,179,471,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０６回	400,000,000	461,540,000	

		国庫債券　利付（２０年）第１０７回	300,000,000	345,771,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,821,664,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,029,114,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,273,789,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１１回	800,000,000	936,488,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,093,562,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,335,420,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１４回	1,700,000,000	1,992,757,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,180,220,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,303,324,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,647,212,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１８回	500,000,000	586,255,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１１９回	800,000,000	924,408,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２０回	800,000,000	910,816,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２１回	1,200,000,000	1,400,844,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２２回	900,000,000	1,042,767,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２３回	500,000,000	594,265,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,179,560,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２５回	1,400,000,000	1,681,008,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２６回	1,200,000,000	1,418,772,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２７回	500,000,000	586,550,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２８回	1,800,000,000	2,117,070,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１２９回	1,300,000,000	1,516,723,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３０回	1,700,000,000	1,987,062,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３１回	800,000,000	927,344,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,509,963,000	
			2,400,000,000	2,811,408,000	

		国庫債券　利付（２０年）第１３３回			
		国庫債券　利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,643,376,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３５回	700,000,000	814,590,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３６回	700,000,000	807,492,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,166,490,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３８回	800,000,000	916,592,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１３９回	1,000,000,000	1,156,120,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４０回	2,300,000,000	2,689,183,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	3,046,758,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,123,536,500	
		国庫債券　利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,512,251,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４４回	1,300,000,000	1,497,860,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,706,801,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,830,392,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４７回	4,000,000,000	4,679,680,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,435,937,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１４９回	3,850,000,000	4,472,853,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５０回	3,330,000,000	3,833,129,700	
		国庫債券　利付（２０年）第１５１回	2,500,000,000	2,818,025,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５２回	2,650,000,000	2,989,491,500	
		国庫債券　利付（２０年）第１５３回	1,600,000,000	1,827,360,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５４回	2,120,000,000	2,395,260,800	
		国庫債券　利付（２０年）第１５５回	5,350,000,000	5,903,885,500	
		国庫債券　利付（２０年）第１５６回	6,150,000,000	6,272,385,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１５７回	6,540,000,000	6,480,682,200	
		国庫債券　利付（２０年）第１５８回	3,470,000,000	3,583,052,600	
			4,010,000,000	4,194,460,000	

		国庫債券　利付（２０年）第１５９回			
		国庫債券　利付（２０年）第１６０回	2,300,000,000	2,437,494,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６１回	2,100,000,000	2,193,177,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,773,933,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６３回	2,600,000,000	2,710,656,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,666,014,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,253,152,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６６回	2,300,000,000	2,427,213,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６７回	2,600,000,000	2,656,108,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６８回	2,700,000,000	2,710,908,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１６９回	2,530,000,000	2,492,733,100	
		国庫債券　利付（２０年）第１７０回	2,000,000,000	1,966,880,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７１回	1,500,000,000	1,472,370,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７２回	3,840,000,000	3,830,208,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７３回	3,250,000,000	3,236,057,500	
		国庫債券　利付（２０年）第１７４回	3,970,000,000	3,945,902,100	
		国庫債券　利付（２０年）第１７５回	5,500,000,000	5,557,750,000	
		国庫債券　利付（２０年）第１７６回	6,020,000,000	6,073,216,800	
		国庫債券　利付（２０年）第１７７回	5,070,000,000	5,015,598,900	
		国庫債券　利付（２０年）第１７８回	3,750,000,000	3,773,700,000	
		メキシコ合衆国　第２５回円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,385,000	
	小計	銘柄数：266 組入時価比率：79.9%	629,445,000,000	667,996,321,350 80.5%	
	合計			667,996,321,350	
地方債証券	日本円	東京都　公募第７３１回	100,000,000	101,401,000	
		東京都　公募第７３６回	100,000,000	101,365,000	
		東京都　公募第７４５回	300,000,000	305,457,000	
		東京都　公募第７６０回	100,000,000	100,165,000	
		東京都　公募第７６１回	100,000,000	100,307,000	
		東京都　公募第７６９回	500,000,000	505,470,000	

		東京都　公募第７７８回	100,000,000	100,837,000	
		東京都　公募第８１３回	200,000,000	201,584,000	
		東京都　公募（３０年）第７回	100,000,000	133,482,000	
		東京都　公募第１０回	200,000,000	262,794,000	
		東京都　公募第１回	300,000,000	306,813,000	
		東京都　公募（２０年）第３回	200,000,000	210,032,000	
		東京都　公募第７回	100,000,000	108,014,000	
		東京都　公募（２０年）第１３回	100,000,000	112,724,000	
		東京都　公募（２０年）第１６回	200,000,000	227,582,000	
		東京都　公募（２０年）第１７回	200,000,000	228,696,000	
		東京都　公募（２０年）第２０回	180,000,000	208,035,000	
		東京都　公募第２３回	100,000,000	118,028,000	
		東京都　公募（２０年）第２６回	100,000,000	116,215,000	
		東京都　公募（２０年）第２９回	200,000,000	230,870,000	
		東京都　公募（５年）第３１回	300,000,000	300,000,000	
		北海道　公募平成２５年度第１回	300,000,000	302,268,000	
		北海道　公募平成２６年度第１３回	100,000,000	101,350,000	
		北海道　公募平成２７年度第７回	100,000,000	101,884,000	
		北海道　公募平成２９年度第５回	200,000,000	201,648,000	
		北海道　公募平成２９年度第７回	100,000,000	101,019,000	
		北海道　公募平成２９年度第９回	100,000,000	101,018,000	
		北海道　公募平成３０年度第１５回	261,600,000	263,590,776	
		北海道　公募平成３０年度第１８回	200,000,000	201,444,000	
		北海道　公募令和２年度第４回	300,000,000	302,277,000	
		宮城県　公募第３１回１号	300,000,000	305,688,000	
		宮城県　公募第３２回２号	100,000,000	100,451,000	
		神奈川県　公募第１９６回	100,000,000	100,825,000	
		神奈川県　公募第２００回	100,000,000	101,420,000	
		神奈川県　公募第２０５回	100,000,000	101,466,000	
		神奈川県　公募第２０６回	100,000,000	101,610,000	
		神奈川県　公募第２１０回	200,000,000	202,660,000	
		神奈川県　公募第２１２回	100,000,000	101,322,000	
		神奈川県　公募第２３１回	200,000,000	202,388,000	
		神奈川県　公募第２４３回	200,000,000	200,158,000	
		神奈川県　公募第２４７回	200,000,000	200,926,000	
		神奈川県　公募（３０年）第３回	100,000,000	133,187,000	
		神奈川県　公募第７回	300,000,000	334,620,000	
		神奈川県　公募（２０年）第１４回	100,000,000	116,203,000	
		神奈川県　公募（２０年）第１７回	200,000,000	234,982,000	
		神奈川県　公募（２０年）第２６回	100,000,000	114,915,000	
		大阪府　公募第３７８回	104,000,000	105,376,960	
		大阪府　公募第３８１回	100,000,000	101,460,000	

		大阪府　公募第３８２回	100,000,000	101,493,000	
		大阪府　公募第３８３回	100,000,000	101,595,000	
		大阪府　公募第３８４回	100,000,000	101,596,000	
		大阪府　公募第３８７回	300,000,000	304,089,000	
		大阪府　公募第３８９回	100,000,000	101,477,000	
		大阪府　公募第３９６回	200,000,000	203,680,000	
		大阪府　公募第４１７回	102,000,000	103,193,400	
		大阪府　公募第４２３回	100,000,000	100,877,000	
		大阪府　公募第４２９回	179,000,000	180,727,350	
		大阪府　公募第４５２回	100,000,000	99,895,000	
		大阪府　公募第４６７回	140,000,000	140,568,400	
		大阪府　公募第４６９回	150,000,000	150,042,000	
		大阪府　公募第５回	100,000,000	117,435,000	
		大阪府　公募第８回	100,000,000	116,477,000	
		大阪府　公募（５年）第１７３回	200,000,000	199,898,000	
		大阪府　公募（５年）第１７４回	200,000,000	199,896,000	
		大阪府　公募（５年）第１７８回	400,000,000	399,776,000	
		大阪府　公募（５年）第１８４回	400,000,000	399,744,000	
		京都府　公募平成２５年度第１５回	200,000,000	202,914,000	
		京都府　公募平成２６年度第５回	100,000,000	114,737,000	
		京都府　公募平成２６年度第７回	200,000,000	203,050,000	
		京都府　公募（２０年）平成２７年度第５回	200,000,000	224,806,000	
		京都府　公募（１５年）平成２７年度第８回	100,000,000	106,015,000	
		京都府　公募（１５年）平成２８年度第２回	200,000,000	201,844,000	
		京都府　公募（２０年）平成２８年度第５回	100,000,000	99,820,000	
		京都府　公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,986,000	
		兵庫県　公募平成２６年度第１７回	100,000,000	101,428,000	
		兵庫県　公募平成２９年度第２２回	100,000,000	100,969,000	
		兵庫県　公募（３０年）第２回	200,000,000	266,114,000	
		兵庫県　公募（１５年）第１回	300,000,000	322,692,000	
		兵庫県　公募（１５年）第３回	200,000,000	214,748,000	
		兵庫県　公募（１２年）第３回	300,000,000	305,445,000	
		兵庫県　公募（１５年）第１１回	100,000,000	105,433,000	
		兵庫県　公募第２回	100,000,000	113,435,000	
		兵庫県　公募第９回	100,000,000	117,115,000	
		兵庫県　公募（２０年）第１１回	200,000,000	230,280,000	
		兵庫県　公募（２０年）第１４回	100,000,000	115,890,000	
		兵庫県　公募（２０年）第２２回	100,000,000	114,080,000	
		静岡県　公募平成２４年度第１０回	100,000,000	100,828,000	
		静岡県　公募平成２５年度第５回	101,000,000	102,465,510	

		静岡県　公募平成２６年度第３回	165,000,000	167,684,550	
		静岡県　公募平成２６年度第８回	100,000,000	101,534,000	
		静岡県　公募平成２６年度第９回	200,000,000	203,102,000	
		静岡県　公募平成２７年度第１１回	115,400,000	115,886,988	
		静岡県　公募平成２８年度第２回	300,000,000	300,885,000	
		静岡県　公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,835,000	
		静岡県　公募（３１年）第１回	174,000,000	174,751,680	
		静岡県　公募（５年）令和３年度第２回	100,000,000	99,999,000	
		静岡県　公募（５年）令和３年度第５回	300,000,000	299,931,000	
		静岡県　公募（１５年）第２回	200,000,000	215,328,000	
		静岡県　公募（１５年）第５回	200,000,000	214,528,000	
		静岡県　公募（１５年）第９回	100,000,000	105,667,000	
		静岡県　公募（２０年）第１１回	100,000,000	115,349,000	
		静岡県　公募（２０年）第１４回	200,000,000	232,348,000	
		静岡県　公募（２０年）第１８回	100,000,000	114,930,000	
		静岡県　公募（２０年）第３０回	200,000,000	199,284,000	
		愛知県　公募平成２０年度第８回	100,000,000	113,999,000	
		愛知県　公募（２０年）平成２２年度第８回	200,000,000	231,330,000	
		愛知県　公募（２０年）平成２４年度第４回	100,000,000	115,636,000	
		愛知県　公募（１５年）平成２４年度第１４回	400,000,000	430,820,000	
		愛知県　公募平成２４年度第１７回	100,000,000	117,844,000	
		愛知県　公募（３０年）平成２５年度第８回	120,000,000	155,156,400	
		愛知県　公募平成２６年度第８回	100,000,000	125,682,000	
		愛知県　公募平成２６年度第１３回	100,000,000	113,745,000	
		愛知県　公募平成２６年度第１７回	300,000,000	304,314,000	
		愛知県　公募（１５年）平成２７年度第２回	300,000,000	316,770,000	
		愛知県　公募平成２７年度第１５回	100,000,000	101,805,000	
		愛知県　公募平成２９年度第８回	100,000,000	101,020,000	
		愛知県　公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,742,000	
		愛知県　公募平成３０年度第７回	200,000,000	201,972,000	
		広島県　公募平成２５年度第３回	200,000,000	202,774,000	
		広島県　公募平成２６年度第５回	109,650,000	110,741,017	
		広島県　公募平成２６年度第７回	200,000,000	202,916,000	
		広島県　公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,746,000	
		広島県　公募平成２９年度第４回	211,300,000	213,793,340	
		広島県　公募平成３０年度第６回	300,000,000	300,096,000	
		広島県　公募令和２年度第２回	100,000,000	100,851,000	
		広島県　公募令和２年度第７回	300,000,000	303,126,000	

		埼玉県　公募平成２５年度第４回	100,000,000	101,441,000	
		埼玉県　公募平成２５年度第６回	148,000,000	150,074,960	
		埼玉県　公募平成２５年度第１０回	100,000,000	101,441,000	
		埼玉県　公募平成２５年度第１１回	100,000,000	101,458,000	
		埼玉県　公募平成２６年度第３回	100,000,000	101,592,000	
		埼玉県　公募平成２６年度第６回	200,000,000	203,018,000	
		埼玉県　公募平成２６年度第７回	400,000,000	405,636,000	
		埼玉県　公募平成２６年度第９回	100,000,000	101,329,000	
		埼玉県　公募平成２７年度第９回	100,000,000	100,936,000	
		埼玉県　公募平成２８年度第５回	100,000,000	100,183,000	
		埼玉県　公募平成３０年度第４回	200,000,000	202,268,000	
		埼玉県　公募平成３０年度第７回	200,000,000	200,054,000	
		埼玉県　公募令和２年度第４回	300,000,000	302,019,000	
		埼玉県　公募（１５年）第１回	100,000,000	106,765,000	
		埼玉県　公募（１５年）第２回	200,000,000	213,430,000	
		埼玉県　公募（１５年）第３回	100,000,000	102,684,000	
		埼玉県　公募（２５年）第２回	200,000,000	208,836,000	
		埼玉県　公募（３０年）第９回	200,000,000	208,050,000	
		埼玉県　公募（２０年）第６回	100,000,000	114,987,000	
		埼玉県　公募（２０年）第１６回	100,000,000	112,212,000	
		埼玉県　公募（２０年）第２０回	100,000,000	103,877,000	
		福岡県　公募平成２６年度第１回	100,000,000	101,620,000	
		福岡県　公募平成２７年度第１回	300,000,000	305,955,000	
		福岡県　公募平成２９年度第１回	100,000,000	101,042,000	
		福岡県　公募平成２３年度第１回	100,000,000	107,281,000	
		福岡県　公募（１５年）平成２７年度第１回	200,000,000	212,174,000	
		福岡県　公募（１５年）令和元年度第１回	100,000,000	99,928,000	
		福岡県　公募（３０年）平成１９年度第１回	100,000,000	133,925,000	
		福岡県　公募（３０年）平成２６年度第１回	100,000,000	125,942,000	
		福岡県　公募（３０年・定時償還）平成２９年度第２回	100,000,000	106,502,000	
		福岡県　公募（２０年）平成２０年度第１回	300,000,000	344,340,000	
		福岡県　公募（２０年）平成２０年度第２回	100,000,000	114,069,000	
		福岡県　公募（２０年）平成２２年度第１回	300,000,000	343,662,000	
		福岡県　公募（２０年）平成２２年度第２回	300,000,000	354,903,000	
		福岡県　公募（２０年）平成２４年度第２回	100,000,000	115,249,000	
		千葉県　公募平成２４年度第８回	100,000,000	100,902,000	
		千葉県　公募平成２５年度第３回	100,000,000	101,317,000	

		千葉県　公募平成２５年度第４回	100,000,000	101,442,000	
		千葉県　公募平成２６年度第１回	100,000,000	101,568,000	
		千葉県　公募平成２６年度第３回	200,000,000	203,122,000	
		千葉県　公募平成２７年度第６回	200,000,000	203,666,000	
		千葉県　公募平成２８年度第４回	200,000,000	200,710,000	
		千葉県　公募平成２９年度第４回	100,000,000	100,745,000	
		千葉県　公募平成２９年度第８回	100,000,000	101,058,000	
		千葉県　公募令和元年度第６回	300,000,000	301,686,000	
		千葉県　公募（２０年）第１回	400,000,000	432,612,000	
		千葉県　公募（２０年）第８回	100,000,000	117,477,000	
		千葉県　公募（２０年）第１３回	200,000,000	232,236,000	
		千葉県　公募（２０年）第１６回	200,000,000	231,542,000	
		千葉県　公募（２０年）第１７回	100,000,000	114,220,000	
		新潟県　公募平成３０年度第２回	200,000,000	203,218,000	
		長野県　公募令和３年度第１回	300,000,000	302,208,000	
		茨城県　公募令和３年度第３回	200,000,000	199,952,000	
		群馬県　公募第１２回	100,000,000	101,848,000	
		群馬県　公募（５年）第１３回	300,000,000	299,928,000	
		群馬県　公募（２０年）第３回	100,000,000	115,639,000	
		岐阜県　公募平成２６年度第１回	186,670,000	189,498,050	
		共同発行市場地方債　公募第１１８回	100,000,000	100,902,000	
		共同発行市場地方債　公募第１１９回	200,000,000	201,846,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２０回	300,000,000	302,505,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２１回	100,000,000	100,749,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２２回	400,000,000	403,460,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２４回	300,000,000	304,278,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２６回	100,000,000	101,406,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２８回	700,000,000	708,750,000	
		共同発行市場地方債　公募第１２９回	100,000,000	101,406,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３０回	100,000,000	101,570,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３２回	100,000,000	101,468,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３６回	200,000,000	203,122,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３７回	500,000,000	507,445,000	
		共同発行市場地方債　公募第１３９回	155,000,000	157,360,650	

		共同発行市場地方債　公募第１４３回	540,000,000	547,500,600	
		共同発行市場地方債　公募第１４５回	1,000,000,000	1,013,160,000	
		共同発行市場地方債　公募第１５２回	400,000,000	407,600,000	
		共同発行市場地方債　公募第１５４回	300,000,000	304,824,000	
		共同発行市場地方債　公募第１５６回	200,000,000	200,762,000	
		共同発行市場地方債　公募第１５７回	300,000,000	300,906,000	
		共同発行市場地方債　公募第１６１回	300,000,000	300,696,000	
		共同発行市場地方債　公募第１７２回	600,000,000	606,840,000	
		共同発行市場地方債　公募第１８４回	100,000,000	100,951,000	
		共同発行市場地方債　公募第１８６回	400,000,000	405,928,000	
		共同発行市場地方債　公募第１８８回	300,000,000	304,809,000	
		共同発行市場地方債　公募第１９０回	610,000,000	615,380,200	
		共同発行市場地方債　公募第１９１回	100,000,000	100,749,000	
		共同発行市場地方債　公募第１９４回	200,000,000	200,958,000	
		共同発行市場地方債　公募第１９６回	400,000,000	400,300,000	
		共同発行市場地方債　公募第１９７回	300,000,000	300,114,000	
		共同発行市場地方債　公募第２００回	100,000,000	100,039,000	
		共同発行市場地方債　公募第２０６回	300,000,000	301,653,000	
		共同発行市場地方債　公募第２１３回	300,000,000	300,795,000	
		共同発行市場地方債　公募第２１５回	400,000,000	401,680,000	
		堺市　公募平成２２年度第１回	100,000,000	116,485,000	
		堺市　公募平成２６年度第１回	100,000,000	122,503,000	
		長崎県　公募令和元年度第３回	100,000,000	100,037,000	
		島根県　公募（３０年）平成２９年度第１回	100,000,000	106,116,000	
		佐賀県　公募平成２８年度第１回	100,000,000	100,344,000	
		福島県　公募平成２６年度第１回	200,000,000	202,862,000	
		滋賀県　公募平成２５年度第１回	100,000,000	101,241,000	
		滋賀県　公募平成２６年度第１回	142,000,000	144,032,020	
		栃木県　公募平成２５年度第１回	100,000,000	101,241,000	
		熊本市　公募平成２９年度第１回	100,000,000	101,006,000	

		新潟市　公募平成２５年度第１回	233,200,000	236,530,096	
		新潟市　公募平成２９年度第１回	100,000,000	101,137,000	
		浜松市　公募平成２６年度第１回	100,000,000	101,008,000	
		大阪市　公募平成２５年度第６回	100,000,000	101,312,000	
		大阪市　公募平成２６年度第５回	100,000,000	101,618,000	
		大阪市　公募平成２７年度第６回	100,000,000	101,803,000	
		大阪市　公募令和２年度第２回	300,000,000	301,653,000	
		大阪市　公募令和３年度第２回	300,000,000	301,254,000	
		大阪市　公募（１５年）第１回	100,000,000	107,934,000	
		大阪市　公募（２０年）第１回	300,000,000	340,206,000	
		大阪市　公募（２０年）第５回	100,000,000	116,398,000	
		大阪市　公募（２０年）第６回	100,000,000	115,184,000	
		大阪市　公募（２０年）第１７回	100,000,000	116,468,000	
		大阪市　公募（２０年）第２６回	100,000,000	103,883,000	
		名古屋市　公募第４８８回	300,000,000	304,860,000	
		名古屋市　公募第４８９回	100,000,000	101,359,000	
		名古屋市　公募第５０１回	200,000,000	201,782,000	
		名古屋市　公募第５０３回	100,000,000	101,089,000	
		名古屋市　公募第５０４回	200,000,000	202,262,000	
		名古屋市　公募第５１１回	200,000,000	200,164,000	
		名古屋市　公募第５１２回	300,000,000	302,148,000	
		名古屋市　公募（１２年）第１回	200,000,000	207,116,000	
		名古屋市　公募（１５年）第２回	100,000,000	106,548,000	
		京都市　公募平成２９年度第１回	100,000,000	101,074,000	
		京都市　公募平成２９年度第４回	101,280,000	102,542,961	
		京都市　公募（２０年）第２回	100,000,000	107,866,000	
		京都市　公募（２０年）第５回	200,000,000	223,378,000	
		京都市　公募（２０年）第６回	100,000,000	113,491,000	
		京都市　公募（２０年）第１３回	100,000,000	113,723,000	
		京都市　公募（２０年）第１５回	200,000,000	204,176,000	
		神戸市　公募平成２６年度第１７回	300,000,000	302,523,000	
		神戸市　公募平成２８年度第１回	200,000,000	200,602,000	
		神戸市　公募平成３０年度第２回	200,000,000	208,050,000	
		横浜市　公募公債平成２５年度１回	200,000,000	201,832,000	
		横浜市　公募公債平成２５年度５回	200,000,000	202,458,000	
		横浜市　公募公債平成２６年度５回	200,000,000	202,760,000	
		横浜市　公募平成２８年度第５回	300,000,000	303,369,000	
		横浜市　公募平成２９年度第３回	100,000,000	101,124,000	
		横浜市　公募２０１９年度第３回	200,000,000	199,844,000	
		横浜市　公募（３０年）第２回	200,000,000	256,882,000	
		横浜市　公募（２０年）第１８回	100,000,000	115,940,000	
		横浜市　公募（２０年）第２６回	100,000,000	117,220,000	

		横浜市　公募（２０年）第３０回	100,000,000	113,906,000	
		札幌市　公募（１５年）平成２３年度第９回	200,000,000	215,184,000	
		札幌市　公募（２０年）平成２４年度第１回	100,000,000	116,512,000	
		札幌市　公募（２０年）平成２４年度第１１回	100,000,000	117,484,000	
		札幌市　公募平成２６年度第４回	100,000,000	101,326,000	
		札幌市　公募平成２６年度第９回	200,000,000	202,532,000	
		川崎市　公募（２０年）第１７回	100,000,000	114,681,000	
		川崎市　公募（２０年）第１９回	100,000,000	113,647,000	
		川崎市　公募（３０年）第１１回	100,000,000	103,401,000	
		北九州市　公募（１０年）令和２年度第２回	200,000,000	200,352,000	
		北九州市　公募（２０年）第３回	200,000,000	226,332,000	
		北九州市　公募（２０年）第１４回	100,000,000	116,371,000	
		福岡市　公募（２０年）平成２１年度第３回	200,000,000	231,896,000	
		福岡市　公募（２０年）平成２３年度第４回	100,000,000	116,818,000	
		福岡市　公募平成２６年度第２回	100,000,000	115,072,000	
		福岡市　公募平成２６年度第５回	100,000,000	101,514,000	
		福岡市　公募平成２６年度第８回	160,000,000	162,358,400	
		福岡市　公募（５年）２０２０年度第９回	300,000,000	299,997,000	
		広島市　公募平成２６年度第２回	100,000,000	101,349,000	
		広島市　公募平成２７年度第２回	500,000,000	509,065,000	
		広島市　公募（１０年）平成３０年度第６回	241,000,000	242,908,720	
		千葉市　公募平成２６年度第２回	200,000,000	202,918,000	
		三重県　公募平成２８年度第１回	155,000,000	156,201,250	
		福井県　公募平成２４年度第４回	100,000,000	100,604,000	
		福井県　公募平成２７年度第４回	200,000,000	200,648,000	
		福井県　公募令和元年度第３回	200,000,000	199,844,000	
		徳島県　公募平成２９年度第２回	200,000,000	202,012,000	
		徳島県　公募平成３０年度第２回	300,000,000	304,821,000	
		山梨県　公募令和元年度第１回	100,000,000	99,922,000	
		岡山県　公募平成２８年度第２回	168,900,000	170,629,536	
		岡山県　公募令和２年度第３回	300,000,000	303,273,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券　第９６回	100,000,000	114,731,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券　第１０２回	300,000,000	349,569,000	
		福岡北九州高速道路債券　第１１７回	100,000,000	114,259,000	
		福岡北九州高速道路債券　第１３６回	100,000,000	105,163,000	

	小計	銘柄数：304 組入時価比率：6.9%	55,054,000,000	57,504,631,814 6.9%	
	合計			57,504,631,814	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫　第４回円貨債券（２０１４）	100,000,000	101,475,000	
		新関西国際空港債券　政府保証第２回	191,000,000	193,580,410	
		新関西国際空港債券　政府保証第５回	117,000,000	117,829,530	
		新関西国際空港社債　財投機関債第６回	300,000,000	327,033,000	
		新関西国際空港社債　財投機関債第９回	100,000,000	107,839,000	
		新関西国際空港社債　財投機関債第１２回	100,000,000	107,376,000	
		新関西国際空港社債　財投機関債第２２回	200,000,000	200,118,000	
		原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券　政府保証第１６回	700,000,000	700,280,000	
		日本政策投資銀行債券　政府保証第２２回	100,000,000	103,278,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第４７回	100,000,000	107,234,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第６６回	400,000,000	401,116,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第７８回	200,000,000	201,794,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第８２回	100,000,000	101,159,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第８６回	300,000,000	302,943,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第９６回	200,000,000	201,560,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第１０１回	300,000,000	304,665,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第１３７回	400,000,000	400,084,000	
		日本政策投資銀行社債　財投機関債第１３８回	400,000,000	400,840,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第１９回	159,000,000	160,324,470	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第３７回	400,000,000	401,588,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第３８回	1,500,000,000	1,500,345,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第４２回	300,000,000	302,592,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第５２回	300,000,000	300,081,000	
		日本政策投資銀行社債　政府保証第５５回	300,000,000	301,947,000	

		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第４回	100,000,000	130,282,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第８回	200,000,000	220,470,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１７回	100,000,000	110,976,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第２３回	300,000,000	338,745,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第３３回	200,000,000	303,624,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第３９回	300,000,000	345,996,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第４７回	100,000,000	116,893,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第８９回	100,000,000	115,382,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１０２回	100,000,000	100,804,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１０３回	350,000,000	405,464,500	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１０５回	100,000,000	117,628,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１０７回	100,000,000	101,368,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１１６回	400,000,000	404,928,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１２２回	100,000,000	101,521,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１２３回	100,000,000	101,489,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１３０回	200,000,000	202,676,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１３４回	200,000,000	202,522,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１３６回	200,000,000	203,072,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１４５回	300,000,000	354,552,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１４９回	100,000,000	119,970,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１５７回	100,000,000	106,363,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１６４回	100,000,000	110,683,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１７３回	100,000,000	93,748,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第１８８回	100,000,000	103,014,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第２６０回	200,000,000	195,112,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第９０回	100,000,000	115,964,000	
			200,000,000	232,208,000	

		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第９２回			
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第９７回	200,000,000	232,952,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第９９回	200,000,000	234,948,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１０６回	200,000,000	234,140,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１１４回	200,000,000	231,548,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１２３回	100,000,000	128,993,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１６５回	100,000,000	124,775,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１６９回	100,000,000	115,232,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１７１回	100,000,000	114,582,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１７２回	300,000,000	380,154,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１８２回	900,000,000	908,415,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１８３回	100,000,000	116,690,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１８９回	196,000,000	197,464,120	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１９０回	400,000,000	403,560,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１９３回	1,000,000,000	1,013,590,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第１９７回	272,000,000	275,897,760	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２０７回	300,000,000	304,221,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１１回	137,000,000	138,993,350	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１３回	145,000,000	147,137,300	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１６回	100,000,000	114,956,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１７回	100,000,000	123,739,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２１９回	100,000,000	115,002,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２２０回	300,000,000	304,905,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２２４回	100,000,000	123,838,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２２５回	190,000,000	192,874,700	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２２９回	630,000,000	639,834,300	
			100,000,000	101,427,000	

		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２３４回			
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２３９回	500,000,000	556,645,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２４１回	200,000,000	202,964,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２４５回	300,000,000	331,248,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２５８回	400,000,000	405,932,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２６１回	401,000,000	406,986,930	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２７１回	151,000,000	151,095,130	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２９６回	200,000,000	205,316,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第２９７回	100,000,000	100,377,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３０６回	403,000,000	405,857,270	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３１５回	100,000,000	100,660,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３２１回	600,000,000	604,932,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３２４回	100,000,000	100,460,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３３５回	100,000,000	104,231,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３３９回	500,000,000	505,550,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３４２回	131,000,000	132,063,720	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３５１回	100,000,000	100,812,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３５４回	200,000,000	201,448,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第３５７回	100,000,000	101,260,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継　財投機関債第２８回	400,000,000	519,712,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継　財投機関債第３３回	100,000,000	131,784,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継　財投機関債第３８回	1,000,000,000	1,061,160,000	
		公営企業債券　３０年第４回財投機関債	100,000,000	131,976,000	
		地方公営企業等金融機構債券（２０年）　第１回	100,000,000	113,812,000	
		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第１回	300,000,000	348,762,000	
		地方公共団体金融機構債券　２０年第４回	100,000,000	116,172,000	
			100,000,000	110,001,000	

		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１６回			
		地方公共団体金融機構債券　２０年第６回	300,000,000	352,854,000	
		地方公共団体金融機構債券　２０年第７回	300,000,000	352,221,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ２４回	100,000,000	102,037,000	
		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第１０回	300,000,000	342,582,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１０４回	100,000,000	104,146,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１０６回	100,000,000	102,778,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１２２回	100,000,000	107,405,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１２４回	100,000,000	107,386,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１３２回	500,000,000	519,280,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１４２回	100,000,000	102,937,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１４５回	200,000,000	206,730,000	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１４７回	100,000,000	106,466,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第４４回	145,000,000	146,319,500	
		地方公共団体金融機構債券　第４４回	100,000,000	100,847,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第４５回	223,000,000	225,125,190	
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ１６０回	100,000,000	106,267,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第４８回	500,000,000	504,320,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第４９回	13,000,000	13,172,120	
		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第２９回	100,000,000	116,617,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第５０回	100,000,000	101,438,000	
		地方公共団体金融機構債券　第５１回	600,000,000	608,316,000	
		地方公共団体金融機構債券　第５２回	300,000,000	304,230,000	
		地方公共団体金融機構債券（１５年）　第２回	200,000,000	214,978,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第５６回	591,000,000	600,225,510	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第５９回	116,000,000	117,803,800	
			100,000,000	114,598,000	

		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第３８回			
		地方公共団体金融機構債券　Ｆ２４０回	300,000,000	323,823,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第６４回	100,000,000	101,502,000	
		地方公共団体金融機構債券　第６４回	100,000,000	101,551,000	
		地方公共団体金融機構債券（２０年）　第３９回	100,000,000	113,955,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第６５回	400,000,000	406,152,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第６９回	320,000,000	324,230,400	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第７２回	189,000,000	192,303,720	
		地方公共団体金融機構債券　第７４回	300,000,000	305,415,000	
		地方公共団体金融機構債券　第７７回	100,000,000	101,824,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第７８回	509,000,000	516,548,470	
		地方公共団体金融機構債券　第７９回	400,000,000	407,492,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券（８年）　第５回	500,000,000	501,910,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第８３回	116,000,000	116,074,240	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第９１回	300,000,000	301,191,000	
		地方公共団体金融機構債券　第９５回	200,000,000	201,594,000	
		地方公共団体金融機構債券　第１０１回	400,000,000	404,068,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第１０８回	157,000,000	158,303,100	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第１１０回	100,000,000	100,720,000	
		政保　地方公共団体金融機構債券　第１１３回	110,000,000	111,497,100	
		公営企業債券（２０年）　第５回財投機関債	200,000,000	207,272,000	
		公営企業債券（２０年）　第１９回財投機関債	100,000,000	111,710,000	
		公営企業債券（２０年）　第２０回財投機関債	100,000,000	111,494,000	
		公営企業債券（２０年）　第２４回財投機関債	100,000,000	113,981,000	
		公営企業債券（２０年）　第２５回財投機関債	100,000,000	115,636,000	
		都市再生債券　財投機関債第９６回	200,000,000	203,160,000	
		都市再生債券　財投機関債第９７回	100,000,000	107,157,000	
			100,000,000	106,626,000	

		都市再生債券　財投機関債第１０１回			
		都市再生債券　財投機関債第１０９回	100,000,000	106,876,000	
		都市再生債券　財投機関債第１１３回	300,000,000	319,359,000	
		都市再生債券　財投機関債第１２１回	200,000,000	206,488,000	
		都市再生債券　財投機関債第１２７回	100,000,000	100,236,000	
		本州四国連絡橋債券　財投機関債第７回	100,000,000	107,695,000	
		民間都市開発推進機構　政府保証第１６回	360,000,000	364,694,400	
		民間都市開発推進機構　政府保証第１７回	400,000,000	402,332,000	
		東京交通債券　第３４７回	157,000,000	163,774,550	
		関西国際空港債券　政府保証第５４回	300,000,000	346,377,000	
		中部国際空港債券　政府保証第１８回	368,000,000	371,116,960	
		中部国際空港債券　政府保証第２２回	300,000,000	300,069,000	
		預金保険機構債券　政府保証第２３０回	600,000,000	601,716,000	
		預金保険機構債券　政府保証第２３１回	300,000,000	300,912,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第３回	400,000,000	445,948,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第６回	200,000,000	226,188,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１８回	100,000,000	103,705,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第４２回	100,000,000	106,170,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第４９回	100,000,000	116,886,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第５９回	100,000,000	116,068,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第７５回	100,000,000	117,927,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第７７回	300,000,000	323,157,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第７８回	100,000,000	117,865,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第８５回	200,000,000	232,122,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第９０回	200,000,000	215,604,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１１５回	100,000,000	116,662,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１２０回	100,000,000	117,104,000	

		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１２３回	100,000,000	116,570,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１２８回	100,000,000	131,829,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１３２回	200,000,000	212,656,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１３７回	100,000,000	107,963,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１４３回	100,000,000	107,547,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１７７回	450,000,000	458,208,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１８８回	300,000,000	300,855,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第１９８回	300,000,000	301,938,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第２２３回	100,000,000	101,788,000	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第２４４回	130,000,000	131,708,200	
		住宅金融支援機構債券　財投機関債第３０１回	300,000,000	300,177,000	
		成田国際空港　第１３回一般担保付	200,000,000	201,746,000	
		成田国際空港　第１７回	400,000,000	405,604,000	
		成田国際空港　第１９回	100,000,000	100,951,000	
		沖縄振興開発金融公庫債券　財投機関債第６回	200,000,000	214,010,000	
		商工債券　利付第８１５回い号	100,000,000	100,178,000	
		商工債券　利付第８１８回い号	100,000,000	100,205,000	
		商工債券　利付第８１９回い号	300,000,000	300,669,000	
		商工債券　利付第８２９回い号	200,000,000	200,374,000	
		商工債券　利付第８３１回い号	200,000,000	200,132,000	
		商工債券　利付第８３３回い号	100,000,000	99,971,000	
		商工債券　利付第８４５回い号	300,000,000	300,399,000	
		商工債券　利付第８５４回い号	400,000,000	399,724,000	
		しんきん中金債券　利付第３７４回	300,000,000	299,997,000	
		しんきん中金債券　利付第３７９回	400,000,000	399,640,000	
		商工債券　利付（３年）第２５８回	100,000,000	99,961,000	
		商工債券　利付（１０年）第１５回	200,000,000	202,936,000	
		国際協力機構債券　第６回財投機関債	200,000,000	235,276,000	
		東日本高速道路　第６１回	200,000,000	200,602,000	
		東日本高速道路　第８３回	200,000,000	199,998,000	
		中日本高速道路　第６３回	100,000,000	102,056,000	
		中日本高速道路　第７９回	300,000,000	300,000,000	
		中日本高速道路　第９０回	300,000,000	299,997,000	
		西日本高速道路　第２０回	200,000,000	202,558,000	
		西日本高速道路　第２２回	400,000,000	406,304,000	

		西日本高速道路　第２３回	100,000,000	101,392,000	
		西日本高速道路　第３０回	300,000,000	301,644,000	
		西日本高速道路　第５０回	200,000,000	200,000,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第５７回	300,000,000	303,660,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第６２回	100,000,000	101,394,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第６８回	200,000,000	202,948,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第６９回	100,000,000	113,922,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第７１回	500,000,000	507,360,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第９０回	300,000,000	301,392,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第１３５回	300,000,000	300,363,000	
		貸付債権担保第１９回住宅金融公庫債券	49,840,000	50,007,960	
		貸付債権担保第４２回住宅金融公庫債券	32,352,000	32,836,956	
		貸付債権担保第７回Ｓ種住宅金融公庫債券	10,123,000	10,173,108	
		貸付債権担保第３９回住宅金融公庫債券	22,362,000	22,722,475	
		貸付債権担保第４０回住宅金融公庫債券	25,626,000	26,413,999	
		貸付債権担保第３２回住宅金融公庫債券	46,156,000	46,820,646	
		貸付債権担保第２０回住宅金融公庫債券	49,545,000	49,756,557	
		貸付債権担保第４４回住宅金融公庫債券	43,840,000	44,464,281	
		貸付債権担保第８回住宅金融支援機構債券	70,536,000	72,016,550	
		貸付債権担保第７回住宅金融支援機構債券	12,243,000	12,565,113	
		貸付債権担保第２５回住宅金融支援機構債券	18,748,000	19,979,931	
		貸付債権担保第２８回住宅金融支援機構債券	62,022,000	65,791,697	
		貸付債権担保Ｓ種第１６回住宅金融支援機構債券	9,213,000	9,243,310	
		貸付債権担保第４２回住宅金融支援機構債券	57,294,000	60,156,981	
		貸付債権担保Ｓ種第１７回住宅金融支援機構債券	18,496,000	18,561,475	
		貸付債権担保第４５回住宅金融支援機構債券	68,709,000	72,409,666	
		貸付債権担保第５２回住宅金融支援機構債券	51,874,000	54,378,476	
			33,754,000	35,739,747	

		貸付債権担保第２４回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第４８回住宅金融支援機構債券	63,963,000	67,339,606	
		貸付債権担保第４０回住宅金融支援機構債券	72,858,000	75,940,621	
		貸付債権担保第６２回住宅金融支援機構債券	115,257,000	120,734,012	
		貸付債権担保第６０回住宅金融支援機構債券	109,710,000	115,345,802	
		貸付債権担保第６１回住宅金融支援機構債券	71,348,000	74,798,389	
		貸付債権担保第５１回住宅金融支援機構債券	23,864,000	25,022,358	
		貸付債権担保第４３回住宅金融支援機構債券	56,180,000	59,394,057	
		貸付債権担保第７９回住宅金融支援機構債券	37,109,000	38,677,226	
		貸付債権担保第８１回住宅金融支援機構債券	81,424,000	84,931,745	
		貸付債権担保第７２回住宅金融支援機構債券	36,043,000	37,569,421	
		貸付債権担保第２２回住宅金融公庫債券	20,126,000	20,205,095	
		貸付債権担保第７０回住宅金融支援機構債券	109,833,000	115,298,290	
		貸付債権担保第３３回住宅金融支援機構債券	23,213,000	24,659,866	
		貸付債権担保第３４回住宅金融支援機構債券	24,631,000	26,185,708	
		貸付債権担保第３５回住宅金融支援機構債券	22,872,000	24,257,814	
		貸付債権担保第４６回住宅金融支援機構債券	22,568,000	23,821,426	
		貸付債権担保第５５回住宅金融支援機構債券	66,790,000	70,187,607	
		貸付債権担保第５６回住宅金融支援機構債券	97,137,000	102,033,676	
		貸付債権担保第５７回住宅金融支援機構債券	32,854,000	34,571,607	
		貸付債権担保第７６回住宅金融支援機構債券	70,858,000	74,230,840	
		貸付債権担保第２３回住宅金融支援機構債券	66,596,000	70,273,431	
		貸付債権担保第３２回住宅金融支援機構債券	67,443,000	71,383,694	
		貸付債権担保第３９回住宅金融支援機構債券	120,130,000	125,784,519	
		貸付債権担保第５８回住宅金融支援機構債券	73,634,000	77,613,181	
		貸付債権担保第６４回住宅金融支援機構債券	122,517,000	128,285,100	
			105,831,000	110,246,269	

		貸付債権担保第７１回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第７３回住宅金融支援機構債券	83,240,000	87,811,540	
		貸付債権担保第７５回住宅金融支援機構債券	69,818,000	73,292,143	
		貸付債権担保第８３回住宅金融支援機構債券	172,152,000	179,440,915	
		貸付債権担保第８４回住宅金融支援機構債券	296,275,000	308,389,684	
		貸付債権担保第８８回住宅金融支援機構債券	45,721,000	47,421,363	
		貸付債権担保第８９回住宅金融支援機構債券	46,882,000	48,689,769	
		貸付債権担保第９０回住宅金融支援機構債券	48,310,000	49,980,076	
		貸付債権担保第９２回住宅金融支援機構債券	101,468,000	104,309,104	
		貸付債権担保第９３回住宅金融支援機構債券	107,472,000	109,678,400	
		貸付債権担保第９４回住宅金融支援機構債券	56,409,000	58,179,114	
		貸付債権担保第９６回住宅金融支援機構債券	60,188,000	61,913,589	
		貸付債権担保第９７回住宅金融支援機構債券	179,340,000	185,369,410	
		貸付債権担保第９８回住宅金融支援機構債券	185,442,000	192,418,328	
		貸付債権担保第９９回住宅金融支援機構債券	124,628,000	129,198,108	
		貸付債権担保第１００回住宅金融支援機構債券	60,438,000	62,523,111	
		貸付債権担保第１０１回住宅金融支援機構債券	61,458,000	63,752,227	
		貸付債権担保第１１５回住宅金融支援機構債券	231,597,000	233,801,803	
		貸付債権担保第１１６回住宅金融支援機構債券	155,230,000	157,384,592	
		貸付債権担保第１１７回住宅金融支援機構債券	156,726,000	158,663,133	
		貸付債権担保第１１８回住宅金融支援機構債券	78,002,000	79,048,006	
		貸付債権担保第１１９回住宅金融支援機構債券	156,032,000	158,022,968	
		貸付債権担保第１２０回住宅金融支援機構債券	78,679,000	79,438,252	
		貸付債権担保第１２１回住宅金融支援機構債券	79,309,000	80,218,674	
		貸付債権担保第１２３回住宅金融支援機構債券	80,495,000	81,560,753	
		貸付債権担保第１２５回住宅金融支援機構債券	322,064,000	325,458,554	
			243,477,000	246,174,725	

		貸付債権担保第１２６回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第１２８回住宅金融支援機構債券	162,328,000	164,017,834	
		貸付債権担保第１２９回住宅金融支援機構債券	165,564,000	167,691,497	
		貸付債権担保第１３４回住宅金融支援機構債券	167,980,000	169,448,145	
		貸付債権担保第１３５回住宅金融支援機構債券	84,562,000	85,292,615	
		貸付債権担保第１３６回住宅金融支援機構債券	85,098,000	86,122,579	
		貸付債権担保第１４０回住宅金融支援機構債券	85,545,000	86,237,059	
		貸付債権担保第１４２回住宅金融支援機構債券	263,364,000	264,409,555	
		貸付債権担保第１４４回住宅金融支援機構債券	263,034,000	264,209,761	
		貸付債権担保第１５０回住宅金融支援機構債券	455,540,000	453,622,176	
		貸付債権担保第１５２回住宅金融支援機構債券	184,020,000	184,883,053	
		貸付債権担保第１５４回住宅金融支援機構債券	185,670,000	186,143,458	
		貸付債権担保第１６４回住宅金融支援機構債券	290,118,000	291,440,938	
		貸付債権担保第１６５回住宅金融支援機構債券	193,636,000	195,003,070	
		貸付債権担保第１６６回住宅金融支援機構債券	290,985,000	294,220,753	
		貸付債権担保第１６７回住宅金融支援機構債券	195,070,000	197,213,819	
		貸付債権担保第１６８回住宅金融支援機構債券	195,230,000	197,209,632	
		貸付債権担保第１６９回住宅金融支援機構債券	294,489,000	297,204,188	
		貸付債権担保第１７０回住宅金融支援機構債券	492,630,000	495,935,547	
		貸付債権担保第１７４回住宅金融支援機構債券	299,544,000	302,000,260	
		貸付債権担保第１７５回住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,923,000	
		貸付債権担保第１７６回住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,819,000	
	小計	銘柄数：318 組入時価比率：7.8%	62,759,781,000	65,497,561,318 7.9%	
	合計			65,497,561,318	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）　第２９回円貨社債	200,000,000	199,660,000	
		フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）　第３１回円貨社債	100,000,000	100,029,000	

		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー　第１４回円貨社債	100,000,000	100,099,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー　第６回円貨社債（２０１４）	100,000,000	101,612,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー　第１５回円貨社債（２０１８	100,000,000	99,917,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー　第１６回円貨社債（２０１８	100,000,000	100,041,000	
		スタンダード・チャータード　第３回円貨社債（２０１５）	100,000,000	100,740,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー　第２回円	100,000,000	100,866,000	
		エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー　第３回円	100,000,000	102,484,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー　第６回円貨社債	100,000,000	100,441,000	
		ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー　第７回円貨社債	100,000,000	100,730,000	
		サンタンデール銀行　第１回円貨社債	100,000,000	100,221,000	
		フランス電力　第４回円貨社債（２０１７）	100,000,000	102,547,000	
		現代キャピタル・サービシズ・インク　第１５回円貨社債	200,000,000	198,870,000	
		ビー・エヌ・ピー・パリバ　第１回円貨社債（２０１７）	100,000,000	100,895,000	
		ウエストパック・バンキング・コーポレーション　第１２回円貨社	200,000,000	200,236,000	
		オーストラリア・ニュージーランド銀行　第１０回円貨社債	200,000,000	200,352,000	
		ＩＮＰＥＸ　第１回社債間限定同順位特約付	500,000,000	500,635,000	
		長谷工コーポレーション　第１４回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,666,000	
		大和ハウス工業　第９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,458,000	
		大和ハウス工業　第２５回特定社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,419,000	
		日揮ホールディングス　第６回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,774,000	
		明治ホールディングス　第１０回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,272,000	
		アサヒグループホールディングス第１６回特定社債間限定同順位	300,000,000	299,250,000	
		味の素　第２４回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,240,000	
		日本たばこ産業　第１３回	100,000,000	100,824,000	
		三越伊勢丹ホールディングス　第６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,859,000	
		トヨタ紡織　第２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,916,000	
		森ヒルズリート投資法人　第１７回特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	199,954,000	

		森ビル　第２３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,872,000	
		セブン&アイ・ホールディングス第１３回社債間限定同順位特約	100,000,000	99,944,000	
		セブン&アイ・ホールディングス第１４回社債間限定同順位特約	600,000,000	601,314,000	
		セブン&アイ・ホールディングス第１５回社債間限定同順位特約	200,000,000	200,880,000	
		東レ　第３０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,711,000	
		東レ　第３３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,643,000	
		日本土地建物　第４回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,852,000	
		王子ホールディングス　第３４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,046,000	
		王子ホールディングス　第４２回社債間限定同順位特約付	600,000,000	599,628,000	
		住友化学　第５６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,532,000	
		イビデン　第１１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,942,000	
		三井化学　第４８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,505,000	
		三菱ケミカルホールディングス　第２９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,693,000	
		三菱ケミカルホールディングス　第３３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,248,000	
		三菱ケミカルホールディングス　第３７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,725,000	
		ダイセル　第１７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,620,000	
		電通　第３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,064,000	
		電通　第６回社債間限定同順位特約付	300,000,000	304,503,000	
		武田薬品工業　第１６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,250,000	
		ツムラ　第１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,010,000	
		オリエンタルランド　第１６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,076,000	
		オリエンタルランド　第１８回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,696,000	
		ヤフー　第６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,091,000	
		ヤフー　第１２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,910,000	
		楽天　第１３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,501,000	
		ブリヂストン　第１１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,472,000	
			300,000,000	301,422,000	

		新日鐵住金　第９回社債間限定同順位特約付			
		ジェイ　エフ　イー　ホールディングス　第２８回社債間限定同順	100,000,000	99,979,000	
		ジェイ　エフ　イー　ホールディングス　第３４回社債間限定同順	100,000,000	100,160,000	
		三菱マテリアル　第３６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,187,000	
		住友金属鉱山　第３３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,860,000	
		住友電気工業　第２６回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,946,000	
		ＬＩＸＩＬグループ　第１１回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,613,000	
		日立建機　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,547,000	
		荏原製作所　第１０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,907,000	
		日立製作所　第１７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,702,000	
		パナソニック　第１７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,670,000	
		パナソニック　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,944,000	
		パナソニック　第２１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,180,000	
		パナソニック　第２２回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,000,000	
		パナソニック　第２３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,840,000	
		ソニー　第３２回	100,000,000	100,311,000	
		東海理化電機製作所　第１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,626,000	
		三菱重工業　第３５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,306,000	
		三菱重工業　第３８回社債間限定同順位特約付（第２回グリーンボ	300,000,000	299,439,000	
		ＪＡ三井リース　第８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,398,000	
		三井住友トラスト・パナソニックファイナンス　第９回社債間限定	100,000,000	100,133,000	
		トヨタ自動車　第１４回社債間限定同等特約付	100,000,000	101,131,000	
		トヨタ自動車　第２６回社債間限定同順位特約付	700,000,000	699,993,000	
		トヨタ自動車　第２７回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,884,000	
		楽天カード　第３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,966,000	
		ドンキホーテホールディングス　第１２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,613,000	
		ニコン　第２２回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,865,000	

		丸紅　第１１３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,055,000	
		豊田通商　第１８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,406,000	
		豊田通商　第１９回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,102,000	
		三井物産　第７１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,935,000	
		住友商事　第４９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,955,000	
		住友商事　第５３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,576,000	
		クレディセゾン　第５０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,804,000	
		クレディセゾン　第６５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,742,000	
		イオン　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,603,000	
		三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ　第１回劣後特約付	100,000,000	101,470,000	
		りそなホールディングス　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,321,000	
		三井住友トラスト・ホールディングス　第２回劣後特約付	200,000,000	202,946,000	
		みずほコーポレート銀行　第８回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,975,000	
		三井住友フィナンシャルグループ第１回劣後特約付	300,000,000	303,630,000	
		三井住友フィナンシャルグループ第３回劣後特約付	100,000,000	101,498,000	
		三井住友フィナンシャルグループ第４回劣後特約付	100,000,000	105,417,000	
		三井住友信託銀行　第１８回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,206,000	
		セブン銀行　第１０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,921,000	
		セブン銀行　第１１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,298,000	
		セブン銀行　第１２回社債間限定同順位特約付	300,000,000	303,906,000	
		みずほフィナンシャルグループ　第１回劣後特約付	200,000,000	202,796,000	
		みずほ銀行　第７回劣後特約付	100,000,000	111,113,000	
		芙蓉総合リース　第２６回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,626,000	
		みずほリース　第３回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,693,000	
		みずほリース　第７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,292,000	
		ＮＴＴファイナンス　第２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,543,000	
		ＮＴＴファイナンス　第１６回日本電信電話保証付	100,000,000	100,278,000	

		ＮＴＴファイナンス　第１７回日本電信電話保証付	200,000,000	201,058,000	
		ＮＴＴファイナンス　第１８回日本電信電話保証付	200,000,000	201,890,000	
		ホンダファイナンス　第６９回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,046,000	
		トヨタファイナンス　第８１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,576,000	
		トヨタファイナンス　第９６回社債間限定同順位特約付	800,000,000	799,992,000	
		リコーリース　第２８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,492,000	
		アコム　第７７回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,168,000	
		ジャックス　第１９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,127,000	
		日立キャピタル　第６１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,555,000	
		日立キャピタル　第８０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,735,000	
		三井住友ファイナンス&リース　第２７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,095,000	
		三菱ＵＦＪリース　第５２回社債間限定同順位特約付	300,000,000	302,376,000	
		三菱ＵＦＪリース　第５６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,221,000	
		三菱ＵＦＪリース　第７６回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,074,000	
		大和証券グループ本社　第２３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,112,000	
		大和証券グループ本社　第３６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,023,000	
		三井不動産　第７１回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,984,000	
		三菱地所　第９３回担保提供制限等財務上特約無	200,000,000	230,900,000	
		三菱地所　第１２０回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,351,000	
		東京建物　第２５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,536,000	
		ダイビル　第１９回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,811,000	
		エヌ・ティ・ティ都市開発　第１５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,865,000	
		日本ビルファンド投資法人　第１３回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	101,469,000	
		野村不動産オフィスファンド投資法人　第７回特定投資法人債間限	100,000,000	114,715,000	
		積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人　第５回特定投資法人債	100,000,000	101,590,000	
		東武鉄道　第１２４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,766,000	
			200,000,000	202,120,000	

		相鉄ホールディングス　第３２回相模鉄道株式会社保証付			
		東京急行電鉄　第８２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,512,000	
		東京急行電鉄　第８３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,642,000	
		小田急電鉄　第６８回社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,058,000	
		小田急電鉄　第７４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,435,000	
		京成電鉄　第５８回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,486,000	
		東日本旅客鉄道　第５７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	230,728,000	
		東日本旅客鉄道　第７１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,907,000	
		東日本旅客鉄道　第１０６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,365,000	
		東日本旅客鉄道　第１０７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,996,000	
		東日本旅客鉄道　第１１９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,338,000	
		東日本旅客鉄道　第１３３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,339,000	
		東日本旅客鉄道　第１４５回社債間限定同順位特約付	200,000,000	187,376,000	
		東日本旅客鉄道　第１４７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,820,000	
		東日本旅客鉄道　第１５３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,506,000	
		東日本旅客鉄道　第１６４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,502,000	
		西日本旅客鉄道　第１３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,321,000	
		西日本旅客鉄道　第１５回社債間限定同順位特約付	300,000,000	337,620,000	
		西日本旅客鉄道　第６０回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,406,000	
		西日本旅客鉄道　第６５回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,110,000	
		西日本旅客鉄道　第６６回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,648,000	
		西日本旅客鉄道　第７７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,308,000	
		東海旅客鉄道　第１７回社債間限定同順位特約付	200,000,000	211,524,000	
		東海旅客鉄道　第５１回社債間限定同順位特約付	200,000,000	233,118,000	
		東海旅客鉄道　第７０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,294,000	
		東海旅客鉄道　第７３回社債間限定同順位特約付	300,000,000	321,714,000	
			100,000,000	119,296,000	

		東海旅客鉄道　第７４回社債間限定同順位特約付			
		東京地下鉄　第２２回	100,000,000	100,435,000	
		東京地下鉄　第２３回	100,000,000	102,683,000	
		東京地下鉄　第２４回	100,000,000	106,103,000	
		西武ホールディングス　第１回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,232,000	
		西日本鉄道　第４５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,690,000	
		阪急阪神ホールディングス　第４７回	400,000,000	428,880,000	
		阪急阪神ホールディングス　第４９回	100,000,000	103,352,000	
		名古屋鉄道　第５０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,442,000	
		日本通運　第１１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,000,000	
		日本通運　第１２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,082,000	
		日本郵船　第３２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,839,000	
		横浜高速鉄道　第２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,017,000	
		九州旅客鉄道　第２回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,452,000	
		九州旅客鉄道　第４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,608,000	
		ＡＮＡホールディングス　第３２回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,431,000	
		澁澤倉庫　第８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,683,000	
		ＫＤＤＩ　第２０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,393,000	
		ＫＤＤＩ　第２５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,084,000	
		ソフトバンク　第１２回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,806,000	
		東京電力　第５４８回	100,000,000	111,782,000	
		東京電力　第５６０回	100,000,000	111,491,000	
		中部電力　第５００回	200,000,000	203,744,000	
		中部電力　第５２４回	100,000,000	101,178,000	
		中部電力　第５３０回	200,000,000	200,278,000	
		関西電力　第５０９回	100,000,000	101,444,000	
		関西電力　第５１１回	300,000,000	303,393,000	
		関西電力　第５２７回	200,000,000	200,742,000	
		関西電力　第５３５回	200,000,000	200,236,000	
		中国電力　第３７７回	100,000,000	101,717,000	
		中国電力　第４００回	100,000,000	100,766,000	
		中国電力　第４０２回	100,000,000	100,394,000	

		中国電力　第４１６回	100,000,000	100,763,000	
		中国電力　第４２２回	600,000,000	603,906,000	
		中国電力　第４２５回	100,000,000	100,746,000	
		北陸電力　第３０１回	100,000,000	101,313,000	
		北陸電力　第３０７回	100,000,000	103,993,000	
		北陸電力　第３０８回	100,000,000	101,789,000	
		北陸電力　第３２６回	100,000,000	102,074,000	
		東北電力　第４７５回	100,000,000	101,857,000	
		東北電力　第４８１回	200,000,000	204,644,000	
		東北電力　第４８４回	100,000,000	103,052,000	
		東北電力　第４９１回	100,000,000	101,195,000	
		東北電力　第５０８回	100,000,000	101,546,000	
		東北電力　第５２１回	300,000,000	304,311,000	
		東北電力　第５２９回	200,000,000	199,184,000	
		四国電力　第２８１回	100,000,000	101,743,000	
		九州電力　第４２４回	100,000,000	102,140,000	
		九州電力　第４２８回	105,000,000	107,185,050	
		九州電力　第４４９回	200,000,000	202,154,000	
		九州電力　第４５１回	100,000,000	101,202,000	
		九州電力　第４７６回	100,000,000	101,052,000	
		九州電力　第４８１回	300,000,000	300,756,000	
		九州電力　第４８４回	200,000,000	201,158,000	
		九州電力　第４９３回	300,000,000	299,079,000	
		北海道電力　第３２１回	100,000,000	102,193,000	
		北海道電力　第３２３回	100,000,000	108,164,000	
		北海道電力　第３３８回	100,000,000	103,926,000	
		北海道電力　第３４５回	300,000,000	301,107,000	
		電源開発　第４０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,924,000	
		電源開発　第４１回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,768,000	
		電源開発　第５０回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,042,000	
		電源開発　第５９回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,016,000	
		電源開発　第７３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,656,000	
		東京電力パワーグリッド　第６回	100,000,000	102,781,000	
		東京電力パワーグリッド　第１１回	300,000,000	307,482,000	
		東京電力パワーグリッド　第１４回	100,000,000	100,426,000	
		東京電力パワーグリッド　第１５回	300,000,000	308,493,000	
		東京電力パワーグリッド　第２８回	100,000,000	103,930,000	
		東京電力パワーグリッド　第３５回	100,000,000	105,386,000	
		東京電力パワーグリッド　第３８回	400,000,000	404,580,000	
		東京電力パワーグリッド　第４０回	400,000,000	427,660,000	

		東京電力パワーグリッド　第４５回	300,000,000	305,190,000	
		東京瓦斯　第３８回社債間限定同順位特約付	100,000,000	125,884,000	
		東京瓦斯　第５５回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,339,000	
		大阪瓦斯　第３６回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,594,000	
		大阪瓦斯　第４３回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,006,000	
		北海道瓦斯　第１７回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,122,000	
		北海道瓦斯　第２３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,992,000	
		広島ガス　第１３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,788,000	
		東京都競馬　第３回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,889,000	
		ファーストリテイリング　第７回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,236,000	
		ソフトバンクグループ　第５４回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,770,000	
	小計	銘柄数：244 組入時価比率：4.6%	38,105,000,000	38,793,043,050 4.7%	
	合計			38,793,043,050	
合計				829,791,557,532	

(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。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2021年12月27日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	91,322,514
コール・ローン	582,205,656
国債証券	88,210,256,011
派生商品評価勘定	679,328
未収入金	7,505,928
未収利息	493,782,880
前払費用	33,784,600
差入委託証拠金	226,051
流動資産合計	89,419,762,968
資産合計	89,419,762,968
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	668,275,316
未払金	3,607,697

	(2021年12月27日現在)
未払解約金	20,996,481
未払利息	285
その他未払費用	533,300
流動負債合計	693,413,079
負債合計	693,413,079
純資産の部	
元本等	
元本	72,748,893,031
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,977,456,858
元本等合計	88,726,349,889
純資産合計	88,726,349,889
負債純資産合計	89,419,762,968

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（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12月27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	1.2196円
(10,000口当たり純資産額)	(12,196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12月29日 至 2021年12月27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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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12月27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12月27日現在	
期首	2020年12月29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	62,722,104,478円
同期中における追加設定元本額	25,091,133,792円
同期中における一部解約元本額	15,064,345,239円
期末元本額	72,748,893,031円

期末元本額の内訳＊	
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	1,569,543,243円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	832,796,826円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型	32,368,774円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型	9,008,538円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型	4,692,678円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型	2,997,313円
野村外国債券インデックス　Ａコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	9,250,258,817円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	7,201,128円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,402,618円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	15,861,243円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	3,388,378円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	6,613,927円
野村外国債券インデックス　Ａコース（野村投資一任口座向け）	38,604,626,668円
野村外国債券（含む新興国）インデックス　Ａコース（野村投資一任口座向け）	8,951,284,974円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	5,056,710,345円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	156,913,471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）	1,059,835,091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）	553,018,901円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	6,047,758,615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）	580,611,483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12月27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12月27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	70,000.00	76,461.32	
		US TREASURY BOND	1,500,000.00	1,557,773.40	
		US TREASURY BOND	610,000.00	729,545.72	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	2,290,851.54	
		US TREASURY BOND	20,000.00	25,079.68	
		US TREASURY BOND	510,000.00	593,273.46	
		US TREASURY BOND	2,250,000.00	2,978,964.90	
		US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,299,903.23	

US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,416,324.28	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,014,746.10	
US TREASURY N/B	700,000.00	715,175.79	
US TREASURY N/B	4,110,000.00	4,183,691.06	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,025,644.50	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,501,123.00	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,126,865.30	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,050,742.30	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,088,351.51	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,030,859.40	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,493,349.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	993,320.30	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	992,773.40	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,535,956.90	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,267,117.16	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,074,872.95	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,036,855.60	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,622,773.35	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,964,765.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,063,086.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,961,093.60	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,729,650.38	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,596,582.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,081,738.30	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,645,331.90	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,061,015.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	987,460.90	
US TREASURY N/B	500,000.00	515,566.40	
US TREASURY N/B	400,000.00	416,890.64	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,137,812.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,059,140.60	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,969,882.70	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,054,687.60	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,598,144.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,055,390.60	

US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,112,812.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,044,062.60	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,962,382.70	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,095,976.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,051,093.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,027,070.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,065,859.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,073,281.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,507.80	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,147,187.60	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,480,250.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,046,171.80	
US TREASURY N/B	800,000.00	830,218.72	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,045,546.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,060,234.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,003,203.10	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,627,148.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	488,769.55	
US TREASURY N/B	800,000.00	828,000.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,120,937.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,228,593.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,124,687.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,939,531.20	
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,867,200.81	
US TREASURY N/B	600,000.00	635,109.36	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,206,484.30	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,452,070.35	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,865,937.60	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,708,226.62	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,645,019.50	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,386,386.85	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,237,984.32	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,686,621.05	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,130,898.40	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,272,679.74	

		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,637,812.50
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,086,367.30
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,572,851.50
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,732,484.51
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,026,093.60
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,069,843.60
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,913,867.00
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,692,015.56
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,053,085.90
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,621,484.50
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,985,937.60
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,013,453.22
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,915,937.60
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,435,957.05
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,361,125.12
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,682,062.56
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,446,093.75
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,463,249.92
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,968,906.40
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,819,101.65
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	974,765.60
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,391,351.64
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,968,828.20
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,496,250.00
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,567,187.50
		US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,848,453.26
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,417,249.92
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,556,875.00
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,744,359.46
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,381,445.25
		US TREASURY N/B	500,000.00	691,367.20
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,088,851.48
		US TREASURY N/B	5,500,000.00	5,136,054.55
		US TREASURY N/B	500,000.00	670,390.65
		US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,375,195.20

		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,637,984.44	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,645,156.25	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,472,851.50	
		US TREASURY N/B	340,000.00	496,479.69	
		US TREASURY N/B	1,760,000.00	2,469,362.54	
		US TREASURY N/B	400,000.00	503,250.00	
		US TREASURY N/B	800,000.00	1,099,500.00	
		US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,655,820.37	
		US TREASURY N/B	340,000.00	449,384.39	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,048,031.28	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,876,687.64	
		US TREASURY N/B	300,000.00	441,937.50	
		US TREASURY N/B	500,000.00	601,445.30	
		US TREASURY N/B	500,000.00	570,585.95	
		US TREASURY N/B	800,000.00	965,062.48	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,948,125.00	
		US TREASURY N/B	700,000.00	911,914.08	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,038,867.25	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,910,124.96	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,871,992.23	
		US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,041,848.37	
		US TREASURY N/B	2,760,000.00	3,244,725.00	
		US TREASURY N/B	920,000.00	1,106,156.29	
		US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,797,428.84	
		US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,761,250.00	
		US TREASURY N/B	4,030,000.00	4,263,929.00	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,724,242.13	
		US TREASURY N/B	500,000.00	606,015.65	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,215,078.10	
		US TREASURY N/B	3,520,000.00	4,101,900.00	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	3,031,843.88	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,711,062.50	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,252,531.34	
		US TREASURY N/B	900,000.00	1,102,710.96	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,077,148.50	

		US TREASURY N/B	500,000.00	603,007.80	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,393,031.25	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,540,218.82	
		US TREASURY N/B	300,000.00	305,015.64	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,123,632.75	
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,717,101.64	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,490,500.00	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,187,437.56	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,547,656.32	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,529,765.70	
	小計	銘柄数：158	351,740,000.00	369,029,938.18	
				(42,224,405,526)	
		組入時価比率：47.6%		47.9%	
	カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,010,904.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,008,826.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	152,646.30	
		CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	615,588.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,095,812.10	
		CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,031,746.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,002,549.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	575,871.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,011,317.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	985,476.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	417,017.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,338,568.44	
		CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	745,414.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	791,891.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	498,861.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	857,211.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	579,200.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	1,070,659.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,540,000.00	1,867,616.52	
		CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	421,739.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	691,775.00	
	小計	銘柄数：21	18,250,000.00	19,770,690.66	

				(1,764,929,555)	
		組入時価比率：2.0%		2.0%	
	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,100,000.00	13,340,778.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	11,801,790.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	13,236,160.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	20,100,000.00	20,229,243.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	16,700,000.00	16,931,462.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	3,134,906.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	7,249,680.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,200,000.00	10,776,912.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,866,700.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,272,609.00	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	9,447,033.00	
	小計	銘柄数：11	112,800,000.00	115,287,273.00	
				(639,094,997)	
		組入時価比率：0.7%		0.7%	
	ユーロ	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	208,768.10	
		BELGIUM KINGDOM	600,000.00	609,262.80	
		BELGIUM KINGDOM	230,000.00	248,705.21	
		BELGIUM KINGDOM	300,000.00	309,611.40	
		BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,256,939.16	
		BELGIUM KINGDOM	1,100,000.00	1,172,287.38	
		BELGIUM KINGDOM	950,000.00	1,011,445.05	
		BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,019,665.00	
		BELGIUM KINGDOM	300,000.00	321,229.02	
		BELGIUM KINGDOM	400,000.00	432,059.12	
		BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,310,544.00	
		BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	989,164.80	
		BELGIUM KINGDOM	550,000.00	772,889.70	
		BELGIUM KINGDOM	500,000.00	574,447.50	
		BELGIUM KINGDOM	720,000.00	884,020.32	
		BELGIUM KINGDOM	300,000.00	499,645.20	
		BELGIUM KINGDOM	650,000.00	1,078,330.50	
		BELGIUM KINGDOM	500,000.00	591,780.00	
		BELGIUM KINGDOM	700,000.00	849,608.34	
		BELGIUM KINGDOM	370,000.00	525,104.00	

		BELGIUM KINGDOM GOVT	370,000.00	598,015.12	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	959,683.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	604,932.54	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	304,525.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,920,000.00	2,117,289.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,010,803.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,141,195.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,530,498.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,013,024.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	853,552.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,180,660.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	766,472.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,008,396.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,020,000.00	1,115,739.24	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	512,653.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,072,145.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	542,847.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	836,813.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,410,431.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,394,467.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,735,466.88	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	978,812.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	444,008.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	822,993.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,138,492.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	646,456.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,505,860.70	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	910,508.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	672,402.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	512,110.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,662,062.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,640,392.20	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	1,302,286.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	1,068,348.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,388,443.50	

		BUNDESOBLIGATION	1,100,000.00	1,114,679.50	
		BUNDESOBLIGATION	1,000,000.00	1,016,617.00	
		BUNDESOBLIGATION	1,500,000.00	1,532,103.00	
		BUNDESOBLIGATION	1,000,000.00	1,024,487.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	1,350,604.76	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	731,595.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	457,474.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	642,514.83	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	737,340.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	459,840.92	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,037,311.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,118,910.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	940,686.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	307,779.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,270,000.00	2,359,601.44	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,957,369.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	898,233.25	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,121,384.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,350,523.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,442,247.38	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	774,018.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,300,000.00	2,369,115.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,029,154.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,034,424.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,697,221.90	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	2,295,174.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	101,167.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	705,648.16	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,800,000.00	2,944,782.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	1,262,540.46	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	114,890.22	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	1,267,695.15	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,736,496.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,410,000.00	2,282,527.45	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	1,050,788.00	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,600,000.00	1,558,689.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,809,909.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,134,792.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,150,000.00	1,227,113.25	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,016,846.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	210,804.48	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,422,318.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,652,445.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	729,356.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,609,425.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	504,950.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,350,000.00	1,562,592.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	523,077.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	838,576.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,060,320.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,309,144.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,530,000.00	1,639,554.12	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,021,800.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,178,727.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	582,269.05	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,148,924.70	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,642,555.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	538,156.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,957,572.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	979,407.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	594,625.74	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,040,000.00	2,590,834.68	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,166,189.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,344,876.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	969,864.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,076,398.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,105,022.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,797,167.24	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	1,016,206.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	526,667.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,479,847.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,211,799.61	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,610,000.00	2,302,940.78	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	990,607.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	302,494.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	110,959.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000.00	2,122,508.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	483,656.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	534,335.90	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	464,892.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	815,473.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,280,000.00	1,999,569.92	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	860,000.00	1,102,530.32	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	586,381.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	1,063,284.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	1,279,209.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	569,881.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	354,535.84	
		FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	154,338.13	
		FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	212,529.80	
		FINNISH GOVERNMENT	810,000.00	844,742.52	
		FINNISH GOVERNMENT	740,000.00	889,133.68	
		FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	301,840.11	
		FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	560,787.50	
		FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	392,887.60	
		FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	234,714.88	
		FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	250,488.80	
		FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	504,033.00	
		FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	310,231.80	
		FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,028,002.00	
		FRANCE (GOVT OF)	2,010,000.00	2,150,734.17	
		FRANCE (GOVT OF)	1,900,000.00	1,932,097.46	
		FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	620,772.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,144,292.60	
		FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	1,082,292.75	

		FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,016,840.00	
		FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,145,580.00	
		FRANCE (GOVT OF)	2,300,000.00	2,446,993.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,065,847.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,571,473.50	
		FRANCE (GOVT OF)	2,200,000.00	2,214,108.60	
		FRANCE (GOVT OF)	2,720,000.00	3,311,600.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,497,393.00	
		FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,976,497.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	1,339,866.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,550,000.00	1,735,508.96	
		FRANCE (GOVT OF)	1,260,000.00	1,539,297.90	
		FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	692,631.10	
		FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	291,116.40	
		FRANCE (GOVT OF)	1,510,000.00	1,970,412.59	
		FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	1,061,595.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,400,000.00	1,363,142.06	
		FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	866,842.20	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	1,963,242.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,100,000.00	2,242,991.10	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,378,276.90	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,100,000.00	2,220,512.70	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,017,951.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,410,000.00	2,824,493.49	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	1,063,512.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,704,412.80	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,140,000.00	2,431,720.52	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	482,684.40	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,290,000.00	3,632,970.50	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	633,641.60	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	720,000.00	1,245,206.88	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	2,813,851.80	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	764,960.80	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	1,808,430.30	
		IRISH GOVERNMENT	800,000.00	855,138.40	

		IRISH TSY 0.2%	1,000,000.00	1,024,645.00	
		IRISH TSY 0.2% 2030	1,100,000.00	1,112,217.70	
		IRISH TSY 1.5% 2050	200,000.00	233,359.80	
		IRISH TSY 1.7% 2037	550,000.00	649,543.95	
		IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	690,161.29	
		IRISH TSY 2% 2045	450,000.00	580,696.65	
		IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	545,101.15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	630,000.00	671,580.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	329,970.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	311,627.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,067,411.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	719,389.72	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	418,452.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	1,172,774.13	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,015,882.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,150,000.00	1,477,218.70	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	638,442.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	294,458.31	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	322,993.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	610,000.00	1,053,459.63	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,050,000.00	1,728,249.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	372,203.96	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	276,217.83	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	125,414.02	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,598,376.75	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	316,836.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	418,381.60	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	744,679.11	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,572,205.50	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	499,199.25	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	677,823.36	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	365,886.76	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	278,190.90	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	641,399.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	496,522.80	

		REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	419,745.04	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	693,134.97	
		REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	84,482.63	
		SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	127,738.26	
		SPANISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,698,054.60	
		SPANISH GOVERNMENT	710,000.00	1,054,024.11	
	小計	銘柄数：236	225,140,000.00	261,480,142.21	
				(33,845,989,607)	
		組入時価比率：38.1%		38.4%	
	英ポンド	UK TREASURY	600,000.00	597,763.20	
		UK TREASURY	1,100,000.00	1,104,053.06	
		UK TREASURY	950,000.00	976,664.22	
		UK TREASURY	500,000.00	504,607.20	
		UK TREASURY	400,000.00	422,228.96	
		UK TREASURY	1,000,000.00	999,748.40	
		UK TREASURY	1,370,000.00	1,419,782.92	
		UK TREASURY	1,000,000.00	1,029,194.00	
		UK TREASURY	300,000.00	360,844.20	
		UK TREASURY	400,000.00	423,244.48	
		UK TREASURY	90,000.00	121,733.82	
		UK TREASURY	1,200,000.00	1,206,268.80	
		UK TREASURY	1,400,000.00	1,342,182.80	
		UK TREASURY	600,000.00	800,990.40	
		UK TREASURY	600,000.00	796,640.10	
		UK TREASURY	300,000.00	296,106.96	
		UK TREASURY	200,000.00	282,665.28	
		UK TREASURY	1,160,000.00	1,645,941.63	
		UK TREASURY	1,170,000.00	1,273,890.85	
		UK TREASURY	300,000.00	298,682.67	
		UK TREASURY	400,000.00	601,327.20	
		UK TREASURY	700,000.00	710,787.84	
		UK TREASURY	850,000.00	1,382,294.99	
		UK TREASURY	1,000,000.00	1,472,420.70	
		UK TREASURY	1,580,000.00	2,634,931.08	
		UK TREASURY	1,400,000.00	1,510,018.30	

		UK TREASURY	1,150,000.00	1,318,951.44	
		UK TREASURY	1,240,000.00	2,171,049.53	
		UK TREASURY	500,000.00	516,156.60	
		UK TREASURY	860,000.00	1,449,717.48	
		UK TREASURY	300,000.00	345,379.80	
		UK TREASURY	300,000.00	363,381.48	
		UK TREASURY	200,000.00	390,418.40	
		UK TREASURY	530,000.00	1,043,265.78	
		UK TSY 0 5/8% 2050	500,000.00	442,692.45	
		UK TSY 3 1/4% 2044	300,000.00	421,764.81	
		UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	780,000.00	1,487,135.83	
	小計	銘柄数：37	27,230,000.00	34,164,927.66	
				(5,234,750,216)	
		組入時価比率：5.9%		5.9%	
	スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,097,339.80	
		SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	272,026.57	
		SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,829,519.00	
		SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,170,060.00	
		SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,672,532.50	
		SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,966,195.60	
		SWEDISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,420,555.04	
	小計	銘柄数：7	19,050,000.00	20,428,228.51	
				(256,169,985)	
		組入時価比率：0.3%		0.3%	
	ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,923,370.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2,750,000.00	2,847,597.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,016,460.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,697,116.12	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1,750,000.00	1,763,912.50	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,536,021.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,957,880.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,893,950.00	
	小計	銘柄数：8	16,600,000.00	16,636,307.12	
				(215,107,451)	
		組入時価比率：0.2%		0.2%	
	デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,650,000.00	1,716,491.37	

	ネ	KINGDOM OF DENMARK	3,400,000.00	3,690,190.00	
		KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,405,503.30	
		KINGDOM OF DENMARK	6,400,000.00	6,727,392.00	
		KINGDOM OF DENMARK	4,900,000.00	8,771,477.26	
		KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	989,430.00	
	小計	銘柄数：6	19,650,000.00	24,300,483.93	
				(423,071,425)	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	
	ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	8,730,274.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	3,548,212.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,428,550.00	
	小計	銘柄数：3	15,800,000.00	15,707,036.50	
				(439,449,896)	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	
	豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	854,216.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,050,139.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	294,766.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,436,210.79	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	585,939.06	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	964,162.39	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	969,962.76	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	862,077.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	976,531.68	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,123,335.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	873,998.88	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,721,914.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	190,539.64	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,192,105.08	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	141,981.31	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	483,397.90	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,170,000.00	1,517,419.21	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	892,199.68	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	186,255.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	375,139.16	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,199,259.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	306,235.86	

		AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	441,760.05	
	小計	銘柄数：23	17,160,000.00	18,639,545.98	
				(1,540,931,266)	
		組入時価比率：1.7%		1.7%	
	シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,441,996.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	421,548.72	
		SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	417,326.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	727,128.92	
		SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	806,672.55	
		SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	321,549.24	
		SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	437,097.88	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1,210,000.00	1,332,758.13	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,003,519.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	945,864.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	749,323.75	
		SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	568,988.15	
		SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	386,184.64	
	小計	銘柄数：13	9,040,000.00	9,559,957.98	
				(806,000,057)	
		組入時価比率：0.9%		0.9%	
	人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	8,984,430.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,008,550.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,050,380.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,167,307.00	
	小計	銘柄数：4	22,000,000.00	22,210,667.00	
				(399,159,001)	
		組入時価比率：0.4%		0.5%	
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,541,610.60	
		ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,623,311.25	
		ISRAEL FIXED BOND	2,500,000.00	2,516,371.50	
		ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,143,801.40	
		ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	997,425.30	
		ISRAEL FIXED BOND	1,100,000.00	1,751,886.40	
		ISRAEL FIXED BOND	800,000.00	1,034,766.00	
	小計	銘柄数：7	10,400,000.00	11,609,172.45	
				(421,197,029)	

		組入時価比率：0.5%		0.5%	
合計				88,210,256,011 (88,210,256,011)	

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

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

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

第２ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2021年12月27日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	88,946,542,999	－	89,614,138,987	△667,595,988
米ドル	42,486,642,001	－	42,746,354,300	△259,712,299
カナダドル	1,762,895,863	－	1,763,210,063	△314,200
メキシコペソ	606,655,486	－	644,041,865	△37,386,379
ユーロ	34,217,226,888	－	34,466,636,915	△249,410,027
英ポンド	5,335,814,282	－	5,394,039,165	△58,224,883
スウェーデンクローナ	254,909,818	－	254,386,440	523,378
ノルウェークローネ	209,467,725	－	214,696,238	△5,228,513
デンマーククローネ	445,043,960	－	448,049,832	△3,005,872
ズロチ	476,138,694	－	485,866,878	△9,728,184
豪ドル	1,530,328,690	－	1,556,940,861	△26,612,171
シンガポールドル	791,193,099	－	802,453,710	△11,260,611
人民元	397,855,693	－	402,097,920	△4,242,227
新シェケル	432,370,800	－	435,364,800	△2,994,000
合計	88,946,542,999	－	89,614,138,987	△667,595,988

（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。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2021年12月27日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	259,202,711
コール・ローン	823,390,510
国債証券	627,697,674,229
派生商品評価勘定	1,559,181
未収利息	5,505,927,586
前払費用	450,473,628
その他未収収益	16,981,802
流動資産合計	634,755,209,647
資産合計	634,755,209,647
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	111,700
未払金	837,821,854
未払解約金	42,157,300
未払利息	403
その他未払費用	6,926,119
流動負債合計	887,017,376
負債合計	887,017,376
純資産の部	
元本等	
元本	246,248,944,233
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	387,619,248,038
元本等合計	633,868,192,271
純資産合計	633,868,192,271
負債純資産合計	634,755,209,647

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

（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12月27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	2.5741円
(10,000口当たり純資産額)	(25,741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	
	224,795,802,762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	235,376,451,832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12月29日 至 2021年12月27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12月27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12月27日現在	
期首	2020年12月29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	234,759,829,540円
同期中における追加設定元本額	43,245,560,711円
同期中における一部解約元本額	31,756,446,018円
期末元本額	246,248,944,233円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	82,107,638円
バランスセレクト５０	83,706,608円
バランスセレクト７０	80,043,489円
野村外国債券インデックスファンド	274,540,569円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,635,925,934円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	23,455,358,770円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	1,808,960,440円
野村資産設計ファンド２０１５	19,311,672円
野村資産設計ファンド２０２０	19,311,460円
野村資産設計ファンド２０２５	35,162,357円
野村資産設計ファンド２０３０	39,855,395円
野村資産設計ファンド２０３５	29,384,848円
野村資産設計ファンド２０４０	50,379,522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）	74,366,527,431円
のむラップ・ファンド（保守型）	6,221,638,771円
のむラップ・ファンド（普通型）	18,905,411,069円
のむラップ・ファンド（積極型）	4,817,212,110円
野村外国債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	520,189,523円
野村資産設計ファンド２０４５	7,831,168円
野村インデックスファンド・外国債券	914,935,563円
マイ・ロード	9,093,472,093円

ネクストコア	198,983,320円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	232,929,423円
野村外国債券インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	8,551,316,402円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,127,026,673円
野村資産設計ファンド２０５０	8,188,435円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型	4,591,048円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型	2,208,084円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型	1,468,866円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型	1,119,781円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	751,866,944円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	750,792,831円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,561,979円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,618,879円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	9,703,366円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,612,128円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	4,706,278円
野村６資産均等バランス	2,013,473,593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）	6,590,342,693円
世界６資産分散ファンド	62,824,345円
野村資産設計ファンド２０６０	3,710,253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	8,320,290,290円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	4,898,962,367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）	6,266,736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）	1,137,831,496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）	183,370,788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）	1,274,005,168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）	776,990,912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）	2,278,997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）	8,770,099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）	360,462円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,145,312,392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）	8,634,618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）	49,622,145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）	8,788,421円
野村グローバル・インデックス・バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	170,182,767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）	156,465,542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）	1,951,613,018円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	74,828,314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）	1,337,103,825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）	742,766,907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）	5,973,460円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	3,639,566円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	7,697,945円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	6,040,715円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	576,295,400円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	5,447,351,474円

マイバランス５０（確定拠出年金向け）	6,684,351,508円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	5,134,873,380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）	19,541,997,762円
マイバランスＤＣ３０	1,981,651,176円
マイバランスＤＣ５０	1,502,926,190円
マイバランスＤＣ７０	1,055,127,584円
野村ＤＣ外国債券インデックスファンド	7,880,365,903円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	5,318,217,653円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	629,319,190円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	257,700,816円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	456,386,951円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	217,238,302円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	18,339,334円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	41,190,383円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	19,217,423円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	10,387,836円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	7,023,070円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	3,682,616円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	130,180,250円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	86,405,993円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	48,039,503円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	67,490,507円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	1,823,568円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	15,756,027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）	55,456,928円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	38,805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12月27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12月27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	36,400,000.00	39,759,891.08	
		US TREASURY BOND	46,700,000.00	48,498,678.52	
		US TREASURY BOND	65,000,000.00	77,738,479.00	
		US TREASURY BOND	15,000,000.00	19,090,429.50	

US TREASURY BOND	132,250,000.00	165,839,436.90	
US TREASURY BOND	100,000.00	138,234.38	
US TREASURY BOND	100,000.00	116,328.13	
US TREASURY BOND	200,000.00	264,796.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,548.83	
US TREASURY N/B	400,000.00	404,992.20	
US TREASURY N/B	25,800,000.00	26,255,532.54	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,618,656.32	
US TREASURY N/B	55,450,000.00	56,267,671.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,167.97	
US TREASURY N/B	400,000.00	407,171.88	
US TREASURY N/B	500,000.00	505,488.30	
US TREASURY N/B	67,900,000.00	68,746,095.11	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,359,036.55	
US TREASURY N/B	500,000.00	500,224.60	
US TREASURY N/B	400,000.00	405,117.20	
US TREASURY N/B	100,000.00	102,529.30	
US TREASURY N/B	900,000.00	895,798.80	
US TREASURY N/B	15,700,000.00	15,931,513.77	
US TREASURY N/B	400,000.00	411,921.88	
US TREASURY N/B	37,200,000.00	37,829,204.52	
US TREASURY N/B	21,200,000.00	21,527,109.64	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,211,308.47	
US TREASURY N/B	800,000.00	809,765.60	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,074.22	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,344,175.62	
US TREASURY N/B	37,100,000.00	38,360,821.24	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,698,300.70	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,033,908.68	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,035,078.10	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,487,138.70	
US TREASURY N/B	200,000.00	198,238.28	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	35,644,125.44	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,038,847.70	
US TREASURY N/B	200,000.00	198,054.68	

		US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,784,878.84	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,040,195.30	
		US TREASURY N/B	42,600,000.00	44,245,757.28	
		US TREASURY N/B	300,000.00	297,515.64	
		US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,450,664.12	
		US TREASURY N/B	29,300,000.00	30,516,635.62	
		US TREASURY N/B	44,400,000.00	45,754,546.32	
		US TREASURY N/B	800,000.00	830,218.72	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,433,871.04	
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,419,495.97	
		US TREASURY N/B	800,000.00	833,781.28	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,677,554.73	
		US TREASURY N/B	500,000.00	514,589.85	
		US TREASURY N/B	400,000.00	413,781.24	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,816.41	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,750,269.51	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,996.09	
		US TREASURY N/B	500,000.00	513,671.90	
		US TREASURY N/B	700,000.00	723,160.13	
		US TREASURY N/B	65,400,000.00	67,967,460.12	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,625.00	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,260,929.66	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,515.63	
		US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,199,194.87	
		US TREASURY N/B	500,000.00	511,015.65	
		US TREASURY N/B	300,000.00	296,238.27	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,921,570.36	
		US TREASURY N/B	500,000.00	511,210.95	
		US TREASURY N/B	200,000.00	197,328.12	
		US TREASURY N/B	300,000.00	307,664.07	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,109,925.74	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,558.59	
		US TREASURY N/B	43,600,000.00	45,035,734.92	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,117,101.59	
		US TREASURY N/B	100,000.00	99,175.78	

US TREASURY N/B		2,400,000.00	2,487,937.44	
US TREASURY N/B		500,000.00	507,753.90	
US TREASURY N/B		57,850,000.00	59,978,700.66	
US TREASURY N/B		2,300,000.00	2,376,906.25	
US TREASURY N/B		500,000.00	507,695.30	
US TREASURY N/B		1,900,000.00	1,971,769.46	
US TREASURY N/B		100,000.00	102,277.34	
US TREASURY N/B		1,000,000.00	1,045,546.90	
US TREASURY N/B		300,000.00	303,375.00	
US TREASURY N/B		21,500,000.00	22,147,519.80	
US TREASURY N/B		1,900,000.00	2,002,644.46	
US TREASURY N/B		17,300,000.00	17,355,413.63	
US TREASURY N/B		32,700,000.00	34,363,102.38	
US TREASURY N/B		100,000.00	98,296.88	
US TREASURY N/B		34,500,000.00	36,559,218.75	
US TREASURY N/B		100,000.00	97,753.91	
US TREASURY N/B		8,050,000.00	8,331,750.00	
US TREASURY N/B		1,000,000.00	1,060,468.80	
US TREASURY N/B		4,100,000.00	4,334,308.44	
US TREASURY N/B		5,200,000.00	5,524,187.76	
US TREASURY N/B		23,000,000.00	23,721,445.60	
US TREASURY N/B		700,000.00	740,960.92	
US TREASURY N/B		29,200,000.00	31,209,780.52	
US TREASURY N/B		100,000.00	106,996.09	
US TREASURY N/B		49,700,000.00	51,767,599.52	
US TREASURY N/B		10,000,000.00	10,664,063.00	
US TREASURY N/B		10,000,000.00	10,577,344.00	
US TREASURY N/B		17,700,000.00	18,726,738.06	
US TREASURY N/B		100,000.00	96,753.91	
US TREASURY N/B		2,000,000.00	2,034,531.20	
US TREASURY N/B		1,000,000.00	1,053,320.30	
US TREASURY N/B		100,000.00	97,183.59	
US TREASURY N/B		5,000,000.00	5,218,164.00	
US TREASURY N/B		200,000.00	196,226.56	
US TREASURY N/B		42,300,000.00	44,393,520.06	

		US TREASURY N/B	300,000.00	294,128.91	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,831,148.46	
		US TREASURY N/B	300,000.00	311,812.50	
		US TREASURY N/B	300,000.00	294,035.16	
		US TREASURY N/B	800,000.00	823,031.28	
		US TREASURY N/B	300,000.00	295,347.66	
		US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,409,812.32	
		US TREASURY N/B	100,000.00	97,257.81	
		US TREASURY N/B	41,900,000.00	42,404,111.47	
		US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,078,280.80	
		US TREASURY N/B	100,000.00	97,789.06	
		US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,753,183.05	
		US TREASURY N/B	300,000.00	294,832.02	
		US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,699,531.04	
		US TREASURY N/B	300,000.00	298,183.59	
		US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,806,085.58	
		US TREASURY N/B	81,000,000.00	82,433,319.30	
		US TREASURY N/B	500,000.00	500,156.25	
		US TREASURY N/B	100,000.00	102,417.97	
		US TREASURY N/B	200,000.00	202,375.00	
		US TREASURY N/B	11,300,000.00	11,849,109.94	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,390,156.32	
		US TREASURY N/B	300,000.00	290,132.82	
		US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,313,359.80	
		US TREASURY N/B	38,000,000.00	40,134,532.20	
		US TREASURY N/B	700,000.00	670,578.16	
		US TREASURY N/B	300,000.00	287,191.41	
		US TREASURY N/B	100,000.00	95,019.53	
		US TREASURY N/B	8,700,000.00	9,138,058.92	
		US TREASURY N/B	100,000.00	95,519.53	
		US TREASURY N/B	100,000.00	94,746.09	
		US TREASURY N/B	300,000.00	285,750.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,051,289.10	
		US TREASURY N/B	300,000.00	287,589.84	
		US TREASURY N/B	500,000.00	478,945.30	

		US TREASURY N/B	500,000.00	482,031.25	
		US TREASURY N/B	29,700,000.00	32,143,288.32	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,656.25	
		US TREASURY N/B	500,000.00	496,250.00	
		US TREASURY N/B	100,000.00	99,222.66	
		US TREASURY N/B	53,600,000.00	58,486,813.84	
		US TREASURY N/B	500,000.00	495,761.70	
		US TREASURY N/B	500,000.00	495,429.70	
		US TREASURY N/B	100,000.00	97,476.56	
		US TREASURY N/B	9,900,000.00	10,830,445.56	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,195.31	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,960.94	
		US TREASURY N/B	300,000.00	299,250.00	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,336,125.00	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,191,351.59	
		US TREASURY N/B	23,100,000.00	24,668,272.86	
		US TREASURY N/B	300,000.00	304,875.00	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,154,796.98	
		US TREASURY N/B	600,000.00	571,546.86	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,710,757.77	
		US TREASURY N/B	13,700,000.00	18,943,461.28	
		US TREASURY N/B	16,600,000.00	15,537,858.96	
		US TREASURY N/B	100,000.00	93,382.81	
		US TREASURY N/B	143,750,000.00	192,737,311.87	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	972,265.60	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,460.94	
		US TREASURY N/B	100,000.00	97,968.75	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,978,281.20	
		US TREASURY N/B	29,100,000.00	40,153,454.58	
		US TREASURY N/B	6,200,000.00	9,053,453.28	
		US TREASURY N/B	100,000.00	140,304.69	
		US TREASURY N/B	100,000.00	125,812.50	
		US TREASURY N/B	100,000.00	137,437.50	
		US TREASURY N/B	100,000.00	141,562.50	
		US TREASURY N/B	100,000.00	139,718.75	

		US TREASURY N/B	100,000.00	143,984.38	
		US TREASURY N/B	100,000.00	140,382.81	
		US TREASURY N/B	100,000.00	132,171.88	
		US TREASURY N/B	100,000.00	138,453.13	
		US TREASURY N/B	300,000.00	441,937.50	
		US TREASURY N/B	100,000.00	141,070.31	
		US TREASURY N/B	100,000.00	130,742.19	
		US TREASURY N/B	100,000.00	120,289.06	
		US TREASURY N/B	100,000.00	120,601.56	
		US TREASURY N/B	100,000.00	118,531.25	
		US TREASURY N/B	200,000.00	228,187.50	
		US TREASURY N/B	100,000.00	114,117.19	
		US TREASURY N/B	290,000.00	349,835.14	
		US TREASURY N/B	100,000.00	129,875.00	
		US TREASURY N/B	100,000.00	130,273.44	
		US TREASURY N/B	23,900,000.00	30,119,602.16	
		US TREASURY N/B	39,950,000.00	48,561,098.65	
		US TREASURY N/B	36,700,000.00	43,813,491.27	
		US TREASURY N/B	39,900,000.00	43,936,758.81	
		US TREASURY N/B	23,400,000.00	28,023,327.54	
		US TREASURY N/B	17,500,000.00	20,573,437.50	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,847,500.16	
		US TREASURY N/B	51,500,000.00	56,943,709.65	
		US TREASURY N/B	28,200,000.00	31,196,250.00	
		US TREASURY N/B	34,500,000.00	36,502,618.05	
		US TREASURY N/B	14,200,000.00	16,819,234.02	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,424,062.60	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,065,632.77	
		US TREASURY N/B	11,400,000.00	13,284,562.50	
		US TREASURY N/B	9,300,000.00	10,844,672.34	
		US TREASURY N/B	9,500,000.00	11,610,781.25	
		US TREASURY N/B	5,100,000.00	6,382,172.13	
		US TREASURY N/B	10,500,000.00	12,864,961.20	
		US TREASURY N/B	6,100,000.00	7,991,953.43	
		US TREASURY N/B	2,470,000.00	3,040,222.71	

		US TREASURY N/B	100,000.00	120,601.56	
		US TREASURY N/B	11,250,000.00	12,055,078.12	
		US TREASURY N/B	300,000.00	330,046.89	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,016,718.80	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,868,796.82	
		US TREASURY N/B	9,100,000.00	7,976,008.04	
		US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,427,781.25	
		US TREASURY N/B	16,200,000.00	16,030,407.06	
		US TREASURY N/B	42,150,000.00	46,595,509.92	
	小計	銘柄数：223	2,388,260,000.00	2,623,820,307.26 (300,217,519,556)	
		組入時価比率：47.4%		47.9%	
	カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,325,079.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	6,480,000.00	6,537,192.48	
		CANADIAN GOVERNMENT	2,070,000.00	2,106,518.94	
		CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	512,990.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,477,037.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	34,487,685.60	
		CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,834,924.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	335,924.75	
		CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	303,395.10	
		CANADIAN GOVERNMENT	11,400,000.00	11,254,091.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	197,095.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	834,035.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	14,730,000.00	19,330,503.06	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,064,878.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	601,864.80	
		CANADIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	14,572,597.20	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,751,200.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,509,904.00	
		CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	13,346,233.50	
		CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,576,559.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	10,600,000.00	11,176,099.40	
		CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	126,581.30	
	小計	銘柄数：22	122,180,000.00	137,262,389.73	

				(12,253,413,531)	
		組入時価比率：1.9%		2.0%	
	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,307,009.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	107,500,000.00	109,475,850.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	69,737,850.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	110,000,000.00	103,998,400.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	62,300,000.00	62,700,589.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	81,944,957.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	76,600,000.00	77,661,676.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	404,504.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	64,401,324.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	27,259,248.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	66,381,788.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	42,726,090.00	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	108,500,000.00	110,215,385.00	
	小計	銘柄数：13	802,200,000.00	821,214,670.00	
				(4,552,403,523)	
		組入時価比率：0.7%		0.7%	
	ユーロ	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	3,966,593.90	
		BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,929,332.20	
		BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,325,308.00	
		BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,032,038.00	
		BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,780,663.81	
		BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	8,157,692.20	
		BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,516,862.14	
		BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,129,358.00	
		BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,070,763.40	
		BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	7,020,960.70	
		BELGIUM KINGDOM	10,400,000.00	11,358,048.00	
		BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	2,388,931.80	
		BELGIUM KINGDOM	100,000.00	112,755.50	
		BELGIUM KINGDOM	500,000.00	574,447.50	
		BELGIUM KINGDOM	100,000.00	122,780.60	
		BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,829,194.00	
		BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	6,635,880.00	
		BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,154,512.00	

		BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,277,060.74	
		BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	4,348,388.60	
		BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,419,200.00	
		BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	15,782,968.00	
		BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	16,970,699.55	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000,000.00	10,663,150.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,090,516.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	7,980,287.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	16,400,000.00	18,269,436.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,400,000.00	11,468,652.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	6,231,314.10	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	960,246.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,400,000.00	18,182,164.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,474,800.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,281,586.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000.00	44,408,583.45	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	857,716.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,500,000.00	9,222,049.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	3,037,067.04	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,437,845.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,000,000.00	18,836,720.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,415,476.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	6,443,641.80	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,138,135.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	3,193,909.50	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	6,980,660.40	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,000,000.00	18,226,580.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,386,649.60	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	14,022,078.00	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,700,000.00	5,700,723.20	
		BUNDESOBLIGATION	100,000.00	100,945.30	
		BUNDESOBLIGATION	2,000,000.00	2,040,012.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	400,134.54	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	206,199.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,780,000.00	1,860,343.86	

		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,500,000.00	10,865,017.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,790,615.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,000,000.00	12,640,128.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	8,047,216.10	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,800,739.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	8,687,531.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	21,322,222.80	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,025,932.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	727,630.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	28,242,044.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	211,349.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	26,623,790.30	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	636,415.20	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,900,000.00	13,370,177.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	28,793,469.60	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,550,000.00	30,164,261.95	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,800,000.00	24,263,268.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,250,000.00	20,040,877.50	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,500,000.00	8,002,017.00	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000.00	4,021,157.70	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,909,994.02	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	9,156,071.40	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	18,940,121.46	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,700,000.00	27,189,139.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	804,404.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9,800,000.00	9,954,016.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,656.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	7,042,563.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	540,850.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,048,682.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	14,200,000.00	16,630,131.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	19,300,000.00	21,250,342.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	314,050.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	627,198.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	7,270,758.00	

		BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,897,108.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,072,950.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	31,600,000.00	36,576,241.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	836,923.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,765,210.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	424,128.32	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	15,750,000.00	17,182,525.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,214,812.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	14,200,000.00	16,737,923.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,164,716.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	22,600,000.00	30,164,220.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	219,007.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	217,397.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	32,800,000.00	44,128,792.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	217,508.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	13,400,000.00	17,018,227.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	33,000,000.00	44,380,908.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,057,157.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	19,200,000.00	27,873,100.80	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	526,667.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,130,332.30	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,585,532.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	31,897,875.40	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	13,500,000.00	16,716,496.50	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,627,072.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	604,570.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	6,870,033.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	246,859.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	11,200,000.00	17,355,968.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	13,747,043.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	7,051,066.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,721,494.00	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	11,086,483.20	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	8,788,702.60	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,430,992.00	

		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	102,892.09	
		FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	404,396.80	
		FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	743,854.30	
		FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,189,215.60	
		FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,292.00	
		FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,085,784.00	
		FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,965,055.60	
		FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,525,436.00	
		FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	859,751.20	
		FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	224,315.00	
		FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,928,876.00	
		FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	586,787.20	
		FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	375,733.20	
		FRANCE (GOVT OF)	200,000.00	201,613.20	
		FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,623,546.42	
		FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,114,507.90	
		FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,400.10	
		FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	10,807,171.70	
		FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,830,408.12	
		FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	13,450,060.00	
		FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,872,478.80	
		FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,709,041.50	
		FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,582,320.00	
		FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	7,340,979.00	
		FRANCE (GOVT OF)	14,600,000.00	15,561,366.20	
		FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,095,298.00	
		FRANCE (GOVT OF)	9,400,000.00	11,444,500.00	
		FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	11,277,205.50	
		FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	111,968.32	
		FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	122,166.50	
		FRANCE (GOVT OF)	10,400,000.00	13,571,053.60	
		FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,359,100.00	
		FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	486,836.45	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,300,000.00	1,459,471.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,300,000.00	17,778,247.00	

		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,204,273.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	11,903,300.50	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,344,322.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	305,385.30	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	38,792,835.90	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,317,560.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,000,000.00	39,769,632.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	12,600,000.00	14,317,606.80	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,300,000.00	34,270,592.40	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	28,600,000.00	45,372,470.00	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	475,231.20	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,250,000.00	12,538,541.50	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	25,650,000.00	40,097,388.15	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,850,000.00	13,099,953.70	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,340,000.00	26,804,955.78	
		IRISH GOVERNMENT	6,130,000.00	7,300,431.55	
		IRISH GOVERNMENT	7,300,000.00	7,803,137.90	
		IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	651,374.40	
		IRISH TSY 1.3% 2033	4,300,000.00	4,786,858.90	
		IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	3,691,541.70	
		IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	3,033,677.40	
		IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	3,661,065.90	
		IRISH TSY 1% 2026	6,800,000.00	7,220,148.88	
		IRISH TSY 2.4% 2030	7,000,000.00	8,421,693.00	
		IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	2,064,699.20	
		IRISH TSY 3.4% 2024	5,200,000.00	5,669,051.96	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	213,200.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	549,950.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	415,503.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	101,332.30	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	6,300,000.00	6,724,693.71	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,541,549.40	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,987,648.90	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,665,395.75	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	16,365,150.00	

		NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,073,837.20	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	832,000.00	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	12,200,000.00	15,671,363.60	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4,700,000.00	7,501,693.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	538,322.50	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3,600,000.00	6,217,138.80	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	8,600,000.00	14,155,187.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,286,711.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	910,096.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	156,767.53	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,321,392.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	745,909.15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,386,555.30	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,643,998.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,112,240.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	10,449,521.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	10,600,000.00	11,110,252.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	8,600,000.00	10,998,643.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	636,324.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	7,055,397.80	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	8,689,149.00	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,098,725.20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,995,388.55	
		REPUBLIC OF IRELAND	10,650,000.00	11,246,750.38	
		SPANISH GOVERNMENT	25,200,000.00	35,766,712.80	
		SPANISH GOVERNMENT	28,100,000.00	43,377,576.60	
		SPANISH GOVERNMENT	5,900,000.00	8,758,791.90	
	小計	銘柄数：220	1,441,740,000.00	1,868,230,670.77 (241,823,778,024)	
		組入時価比率：38.2%		38.5%	
	英ポンド	UK TREASURY	1,600,000.00	1,594,035.20	
		UK TREASURY	9,900,000.00	9,936,477.54	
		UK TREASURY	2,800,000.00	2,878,589.28	
		UK TREASURY	300,000.00	296,717.82	
		UK TREASURY	1,600,000.00	1,614,743.04	

		UK TREASURY	3,250,000.00	3,430,610.30	
		UK TREASURY	14,770,000.00	16,770,448.80	
		UK TREASURY	200,000.00	199,949.68	
		UK TREASURY	200,000.00	209,590.64	
		UK TREASURY	2,610,000.00	2,704,841.91	
		UK TREASURY	400,000.00	411,677.60	
		UK TREASURY	13,080,000.00	15,732,807.12	
		UK TREASURY	200,000.00	211,622.24	
		UK TREASURY	6,300,000.00	8,521,367.40	
		UK TREASURY	6,650,000.00	8,877,643.60	
		UK TREASURY	9,830,000.00	13,051,620.30	
		UK TREASURY	15,750,000.00	22,259,890.80	
		UK TREASURY	4,030,000.00	5,718,228.25	
		UK TREASURY	100,000.00	156,546.60	
		UK TREASURY	350,000.00	526,161.30	
		UK TREASURY	300,000.00	458,943.27	
		UK TREASURY	320,000.00	520,393.40	
		UK TREASURY	18,440,000.00	27,151,437.70	
		UK TREASURY	5,900,000.00	9,839,299.61	
		UK TREASURY	8,200,000.00	8,844,392.90	
		UK TREASURY	16,100,000.00	18,465,320.23	
		UK TREASURY	5,350,000.00	9,367,028.24	
		UK TREASURY	1,100,000.00	1,135,544.52	
		UK TREASURY	6,750,000.00	11,378,596.50	
		UK TREASURY	1,300,000.00	1,496,645.80	
		UK TREASURY	700,000.00	847,890.12	
		UK TREASURY	9,450,000.00	18,447,269.40	
		UK TREASURY	100,000.00	155,857.23	
		UK TREASURY	200,000.00	393,685.20	
		UK TSY 3 1/4% 2044	8,300,000.00	11,668,826.41	
		UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	6,400,000.00	12,202,140.16	
	小計	銘柄数：36	182,830,000.00	247,476,840.11	
				(37,918,401,441)	
		組入時価比率：6.0%		6.0%	
	スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	8,156,328.14	
		SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	39,552,664.00	

		SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	16,767,520.00	
		SWEDISH GOVERNMENT	17,300,000.00	18,035,509.50	
		SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	19,831,675.50	
		SWEDISH GOVERNMENT	8,100,000.00	8,031,546.09	
		SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	32,223,638.97	
	小計	銘柄数：7	125,850,000.00	142,598,882.20	
				(1,788,189,982)	
		組入時価比率：0.3%		0.3%	
	ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,365,190.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	39,141,522.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,602,875.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,690,330.52	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	10,281,090.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	9,625,731.60	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	28,000,000.00	28,248,920.00	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	7,244,156.00	
	小計	銘柄数：8	116,300,000.00	118,199,815.12	
				(1,528,323,609)	
		組入時価比率：0.2%		0.2%	
	デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	870,000.00	905,059.08	
		KINGDOM OF DENMARK	24,800,000.00	26,916,680.00	
		KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,420,174.70	
		KINGDOM OF DENMARK	37,250,000.00	39,155,523.75	
		KINGDOM OF DENMARK	40,200,000.00	71,961,915.48	
		KINGDOM OF DENMARK	3,500,000.00	3,463,005.00	
	小計	銘柄数：6	122,320,000.00	158,822,358.01	
				(2,765,097,252)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	39,000,000.00	37,831,189.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	730,878.08	
		POLAND GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	10,852,310.70	
		POLAND GOVERNMENT BOND	59,100,000.00	55,184,034.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,466,360.00	
	小計	銘柄数：5	112,500,000.00	107,064,772.28	
				(2,995,447,492)	

		組入時価比率：0.5%		0.5%	
	豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	750,000.00	800,827.57	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,625,347.50	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	10,932,350.82	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	16,380,000.00	18,457,080.64	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,231,781.34	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,293,283.68	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	325,510.56	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,145,338.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	14,530,231.38	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	23,891,562.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,430,379.74	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,278,288.97	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,316,675.10	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,500,000.00	11,023,985.75	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,449,824.48	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	10,244,025.00	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	820,616.93	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,635,353.25	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	5,557,613.81	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,650,560.30	
	小計	銘柄数：20	113,380,000.00	125,640,637.12	
				(10,386,711,470)	
		組入時価比率：1.6%		1.7%	
	シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	505,892.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT	3,800,000.00	3,913,990.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,484,285.25	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,423,905.14	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,147,646.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,454,257.84	
		SINGAPORE GOVERNMENT	4,650,000.00	5,138,393.68	
		SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	535,915.40	
		SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	327,823.41	
		SINGAPORE GOVERNMENT	3,850,000.00	4,240,594.05	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2,080,000.00	2,428,176.40	
			1,920,000.00	2,017,843.20	

		SINGAPORE GOVERNMENT			
		SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,110,580.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,162,154.97	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,027,469.36	
	小計	銘柄数：15	30,600,000.00	32,918,928.10	
				(2,775,394,828)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	411,994.48	
		MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,799,601.74	
		MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,683,509.75	
		MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	436,026.16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,703,731.20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	3,975,288.33	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,249,506.82	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,982,651.28	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	619,105.68	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	15,600,000.00	16,394,623.44	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,744,205.86	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,083,454.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,240,901.74	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	286,026.35	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	16,400,765.92	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,659,409.52	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	814,229.04	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	7,390,780.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,607,505.81	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4,100,000.00	4,335,219.87	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	325,744.29	
	小計	銘柄数：21	104,580,000.00	109,144,281.78	
				(2,975,262,206)	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	
	人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	13,975,780.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	89,627,537.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,415,635.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,836,535.00	
	小計	銘柄数：4	151,500,000.00	152,855,487.50	

				(2,747,042,393)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,056,876.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,266,476.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,138,702.00	
		ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,709,686.50	
		ISRAEL FIXED BOND	11,900,000.00	12,503,240.75	
		ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	8,284,833.05	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,359,503.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,502,876.50	
		ISRAEL FIXED BOND	8,500,000.00	8,478,115.05	
		ISRAEL FIXED BOND	3,700,000.00	3,555,773.63	
		ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	9,555,744.00	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	6,467,287.50	
	小計	銘柄数：12	72,800,000.00	81,879,114.98	
				(2,970,688,922)	
		組入時価比率：0.5%		0.5%	
合計				627,697,674,229	
				(627,697,674,229)	

(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12月27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	13,000,000	
		US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	1,445,000	
		US TREASURY N/B	8,117,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	12,895,000	
		US TREASURY N/B	4,592,000	
		US TREASURY N/B	340,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	13,700,000	
		US TREASURY N/B	14,000,000	
		US TREASURY BOND	85,000	
		US TREASURY N/B	7,586,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	
		US TREASURY N/B	10,700,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	

		US TREASURY N/B	1,815,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	246,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	16,300,000	
		US TREASURY N/B	8,435,000	
		US TREASURY BOND	43,000,000	
		US TREASURY N/B	15,000,000	
		US TREASURY N/B	26,000,000	
		US TREASURY N/B	27,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	5,000,000	
		US TREASURY BOND	12,000,000	
		US TREASURY BOND	30,000,000	
		US TREASURY N/B	11,000,000	
		US TREASURY N/B	1,445,000	
		US TREASURY N/B	170,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	14,450,000	
		US TREASURY N/B	14,000,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	255,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	850,000	
		US TREASURY N/B	14,705,000	
		US TREASURY N/B	935,000	
		US TREASURY N/B	425,000	
		US TREASURY N/B	29,000,000	
		US TREASURY N/B	8,400,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	
		US TREASURY N/B	46,000,000	
		US TREASURY N/B	340,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	50,000,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	31,000,000	
		US TREASURY N/B	1,785,000	
		US TREASURY N/B	47,000,000	
		US TREASURY N/B	19,000,000	
		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	1,870,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	

		US TREASURY N/B	37,000,000	
		US TREASURY N/B	1,020,000	
		US TREASURY N/B	9,000,000	
		US TREASURY N/B	1,445,000	
		US TREASURY N/B	7,395,000	
		US TREASURY N/B	37,000,000	
		US TREASURY N/B	1,028,000	
		US TREASURY N/B	41,000,000	
		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	17,000,000	
		US TREASURY N/B	25,000,000	
		US TREASURY N/B	7,500,000	
		US TREASURY N/B	765,000	
		US TREASURY N/B	37,000,000	
		US TREASURY N/B	3,000,000	
		US TREASURY N/B	8,000,000	
		US TREASURY N/B	12,750,000	
		US TREASURY N/B	27,000,000	
		US TREASURY N/B	680,000	
		US TREASURY N/B	25,000,000	
		US TREASURY N/B	36,000,000	
		US TREASURY N/B	850,000	
		US TREASURY N/B	31,000,000	
		US TREASURY N/B	7,735,000	
		US TREASURY N/B	8,415,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	27,000,000	
		US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	850,000	
	豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,600,000	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,500,000	
	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	351,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	759,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	36,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	529,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	579,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	151,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	794,000	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	840,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	365,000	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	219,000	

		MEX BONOS DESARR FIX RT	657,000	
	ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,100,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,240,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000	
		BUNDESOBLIGATION	1,700,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	770,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,450,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,930,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,900,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	945,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	960,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,020,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,235,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,100,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,300,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000	
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,700,000	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,000,000	
		SPANISH GOVERNMENT	23,800,000	
		SPANISH GOVERNMENT	20,000,000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7,310,000	
		NETHERLANDS GOVERNMENT	10,400,000	
		BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000	

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12月27日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	707,699,449	－	709,146,930	1,447,481
米ドル	308,357,739	－	308,926,980	569,241

ユーロ	323,722,950	－	323,611,250	△111,700
英ポンド	75,618,760	－	76,608,700	989,940
合計	707,699,449	－	709,146,930	1,447,481

（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。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	(2021年12月27日現在)
資産の部	
流動資産	
預金	98,129,927
コール・ローン	7,174,416
国債証券	8,648,628,797
未収利息	90,882,420
前払費用	11,060,821
流動資産合計	8,855,876,381
資産合計	8,855,876,381
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,248,568
未払利息	3
その他未払費用	476,200
流動負債合計	2,724,771
負債合計	2,724,771
純資産の部	
元本等	
元本	6,347,454,617
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,505,696,993
元本等合計	8,853,151,610
純資産合計	8,853,151,610
負債純資産合計	8,855,876,381

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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12月27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	1.3948円
(10,000口当たり純資産額)	(13,948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12月29日 至 2021年12月27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、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3.金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。
○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12月27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12月27日現在	
期首	2020年12月29日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	6,443,256,508円
同期中における追加設定元本額	1,808,877,544円
同期中における一部解約元本額	1,904,679,435円
期末元本額	6,347,454,617円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド２０１５	20,509,531円
野村資産設計ファンド２０２０	20,513,421円
野村資産設計ファンド２０２５	36,889,642円
野村資産設計ファンド２０３０	41,115,345円
野村資産設計ファンド２０３５	30,319,858円
野村資産設計ファンド２０４０	51,982,538円
野村資産設計ファンド２０４５	8,080,342円
野村インデックスファンド・新興国債券	737,037,238円
ネクストコア	8,731,854円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	439,782,107円
野村資産設計ファンド２０５０	8,466,280円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型	4,828,773円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型	2,278,443円
野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型	1,515,670円

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型	1,155,463円
世界６資産分散ファンド	118,613,446円
野村資産設計ファンド２０６０	3,941,171円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）	4,122,930,907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）	939,862円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	14,018,694円
野村ＤＣ新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド	398,784,816円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	229,416,858円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	21,895,944円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	10,714,574円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	7,246,533円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	3,808,326円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	1,936,981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12月27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12月27日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	8,513,855.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,700,000.00	14,970,186.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000.00	15,127,749.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	21,600,000.00	20,421,504.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,400,000.00	7,725,732.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	15,650,000.00	15,750,629.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000.00	11,448,972.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000.00	13,484,338.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	7,988,954.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,262,356.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,600,000.00	12,256,096.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,700,000.00	6,521,378.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,500,000.00	8,445,855.00	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,500,000.00	9,650,195.00	
	小計	銘柄数：14 組入時価比率：9.7%	153,950,000.00	155,567,799.50 (862,390,096) 10.0%	
	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	2,500,000.00	2,367,507.25	

		LETRA TESOURO NACIONAL	6,100,000.00	5,177,271.30	
		LETRA TESOURO NACIONAL	11,900,000.00	9,652,851.60	
		LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000.00	2,710,000.65	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	480,000.00	4,955,740.80	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000.00	4,952,179.27	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000.00	3,283,751.36	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	2,545,128.50	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	160,000.00	1,614,583.04	
	小計	銘柄数：9	25,691,000.00	37,259,013.77	
				(751,219,961)	
		組入時価比率：8.5%		8.7%	
	チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	99,460,000.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	270,000,000.00	249,280,200.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	190,000,000.00	185,540,700.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	295,000,000.00	281,096,650.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	227,016,000.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	215,000,000.00	224,675,000.00	
	小計	銘柄数：6	1,310,000,000.00	1,267,068,550.00	
				(168,025,960)	
		組入時価比率：1.9%		1.9%	
	コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,790,000,000.00	2,002,578,789.00	
		TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	1,019,388,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA	1,900,000,000.00	1,830,118,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	813,024,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	814,392,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA	850,000,000.00	831,300,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA	800,000,000.00	743,288,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA	1,600,000,000.00	1,468,304,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA	1,850,000,000.00	1,702,259,000.00	
		TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	745,524,000.00	
	小計	銘柄数：10	12,440,000,000.00	11,970,175,789.00	
				(342,897,655)	
		組入時価比率：3.9%		4.0%	
	ソル	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	206,796.00	
		BONOS DE TESORERIA	1,000,000.00	1,020,220.00	
		BONOS DE TESORERIA	600,000.00	602,748.00	
		BONOS DE TESORERIA	700,000.00	639,401.00	
		BONOS DE TESORERIA	700,000.00	594,825.00	
		PERU BONO SOBERANO	700,000.00	798,546.00	
		PERU BONO SOBERANO	500,000.00	536,875.00	
		PERU BONO SOBERANO	1,020,000.00	1,036,707.60	
		REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,153,955.00	
	小計	銘柄数：9	6,520,000.00	6,590,073.60	

			(188,351,552)	
	組入時価比率：2.1%		2.2%	
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,981,040.00	
小計	銘柄数：1	4,000,000.00	3,981,040.00	
			(10,258,343)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
ドミニカペソ	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	8,872,000.00	
小計	銘柄数：1	8,000,000.00	8,872,000.00	
			(17,752,872)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
セルビアディナール	SERBIA TREASURY BONDS	30,000,000.00	30,935,370.00	
小計	銘柄数：1	30,000,000.00	30,935,370.00	
			(34,072,154)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,100,000.00	1,038,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	790,000.00	733,120.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	200,000.00	184,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	770,000.00	657,965.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,113,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	406,120.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	818,070.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	682,890.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,349,100.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	270,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	1,337,700.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	421,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,177,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	903,000.00	
小計	銘柄数：14	15,010,000.00	11,092,765.00	
			(114,434,073)	
	組入時価比率：1.3%		1.3%	
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	13,272,557.20	
	CZECH REPUBLIC	16,600,000.00	15,075,082.50	
	CZECH REPUBLIC	11,500,000.00	9,945,651.95	
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	11,286,422.40	
	CZECH REPUBLIC	17,800,000.00	15,335,839.20	
	CZECH REPUBLIC	6,500,000.00	5,993,000.00	
	CZECH REPUBLIC	5,200,000.00	6,133,400.00	
小計	銘柄数：7	84,800,000.00	77,041,953.25	
			(398,453,278)	
	組入時価比率：4.5%		4.6%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	62,000,000.00	59,998,807.40	

		HUNGARY GOVERNMENT BOND	27,000,000.00	27,990,900.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	66,242,200.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	75,000,000.00	71,780,107.50	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	65,669,625.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	38,000,000.00	33,903,600.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	73,233,076.60	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	80,319,717.20	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	76,444,319.60	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	64,868,850.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	52,000,000.00	46,669,875.20	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	130,000,000.00	119,611,050.00	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	40,000,000.00	33,142,000.00	
	小計	銘柄数：13	862,000,000.00	819,874,128.50	
				(287,068,267)	
		組入時価比率：3.2%		3.3%	
	ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,551,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND	700,000.00	686,913.64	
		POLAND GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,385,268.48	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	1,989,278.76	
		POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,801,220.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND	8,600,000.00	8,157,960.00	
	小計	銘柄数：6	22,700,000.00	21,572,440.88	
				(603,551,593)	
		組入時価比率：6.8%		7.0%	
	ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	13,500,000.00	13,498,717.50	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	11,944,946.40	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	28,676,940.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	21,000,000.00	20,278,020.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	28,300,000.00	27,766,423.31	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	32,500,000.00	31,372,305.25	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	26,560,440.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	38,700,000.00	38,205,951.93	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	28,876,602.10	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	10,760,829.60	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	17,612,969.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	16,000,000.00	13,992,160.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	9,256,850.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,200,000.00	19,493,808.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	26,989,720.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	26,396,700.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	9,231,600.00	
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	51,000,000.00	48,374,520.00	
	小計	銘柄数：18	422,900,000.00	409,289,503.09	

			(638,491,624)	
	組入時価比率：7.2%		7.4%	
レイ	ROMANIA	550,000.00	561,184.25	
	ROMANIA	400,000.00	400,798.64	
	ROMANIA	500,000.00	497,574.95	
	ROMANIA	1,000,000.00	973,785.00	
	ROMANIA	500,000.00	499,650.00	
	ROMANIA	800,000.00	782,306.08	
	ROMANIA	920,000.00	924,379.20	
	ROMANIA	500,000.00	485,154.60	
	ROMANIA	500,000.00	501,985.00	
	ROMANIA	1,100,000.00	1,034,594.88	
	ROMANIA	760,000.00	795,431.20	
	ROMANIA	800,000.00	800,852.00	
	ROMANIA	1,400,000.00	1,238,174.00	
小計	銘柄数：13	9,730,000.00	9,495,869.80	
			(248,514,509)	
	組入時価比率：2.8%		2.9%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	823,988.96	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,000,000.00	2,061,071.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	795,114.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,400,000.00	1,526,091.56	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	406,036.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,019,304.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	700,000.00	715,752.17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,218,369.96	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,681,878.16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,270,054.16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,444,676.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,240,189.56	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	2,953,915.93	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,758,111.29	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,131,344.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	764,765.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,662,062.97	
小計	銘柄数：17	26,100,000.00	26,472,728.02	
			(721,643,918)	
	組入時価比率：8.2%		8.3%	
バーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,000,000.00	5,069,406.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	16,700,000.00	17,431,778.97	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,616,634.88	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,008,928.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,900,000.00	18,236,226.44	

		THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,519,205.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	9,300,000.00	10,313,113.17	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	10,700,000.00	11,155,736.54	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	12,900,000.00	13,980,645.90	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	12,448,013.70	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	11,171,726.92	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	12,800,000.00	14,801,326.08	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,042,746.40	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	17,536,491.00	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,329,634.96	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	12,819,728.60	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,944,653.75	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	6,490,714.49	
		THAILAND GOVERNMENT BOND	15,700,000.00	15,887,746.88	
	小計	銘柄数：19	219,200,000.00	230,804,457.68	
				(789,351,245)	
		組入時価比率：8.9%		9.1%	
	フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	11,098,932.00	
	小計	銘柄数：1	10,000,000.00	11,098,932.00	
				(25,387,697)	
		組入時価比率：0.3%		0.3%	
	ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	4,700,000,000.00	4,822,529,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	4,730,000,000.00	5,149,361,800.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	3,800,000,000.00	4,139,606,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	6,900,000,000.00	7,269,564,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,905,859,200.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	4,700,000,000.00	4,777,315,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	6,250,000,000.00	6,716,687,500.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,094,850,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	5,230,000,000.00	6,064,185,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	4,700,000,000.00	5,251,545,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,415,286,408.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	6,100,000,000.00	6,341,072,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	2,900,000,000.00	2,932,770,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,909,928,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,795,093,920.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,403,840,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,921,756,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	7,180,000,000.00	8,075,130,600.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,259,100,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,552,100,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	3,400,000,000.00	3,549,974,000.00	

		INDONESIA GOVERNMENT	4,600,000,000.00	5,198,506,000.00	
		INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000.00	2,411,780,000.00	
	小計	銘柄数：23	97,280,000,000.00	104,957,839,428.00	
				(850,158,499)	
		組入時価比率：9.6%		9.8%	
	人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	13,476,645.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	15,800,000.00	15,822,515.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,032,355.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,075,570.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,695,191.50	
	小計	銘柄数：5	47,800,000.00	48,102,276.50	
				(864,470,062)	
		組入時価比率：9.8%		10.0%	
	ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,600,000.00	3,707,033.04	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,900,000.00	16,593,866.27	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,100,000.00	14,956,389.63	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,460,000.00	3,778,130.22	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,400,000.00	11,238,669.32	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,100,000.00	5,517,374.97	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,396,409.44	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000.00	9,514,331.68	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	6,228,815.09	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	2,986,487.11	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	9,971,650.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000.00	11,721,106.89	
	小計	銘柄数：12	110,810,000.00	99,610,263.84	
				(732,135,439)	
		組入時価比率：8.3%		8.5%	
合計				8,648,628,797	
				(8,648,628,797)	

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

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

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

第２ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２６－２０２８年目標型

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	147,981,661円
Ⅱ　負債総額	150,587円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	147,831,074円
Ⅳ　発行済口数	116,090,402口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2734円

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０２９－２０３１年目標型

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	58,287,004円
Ⅱ　負債総額	59,372円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	58,227,632円
Ⅳ　発行済口数	44,325,397口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3136円

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３２－２０３４年目標型

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	38,663,536円
Ⅱ　負債総額	39,510円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	38,624,026円
Ⅳ　発行済口数	29,082,658口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3281円

野村ターゲットデートファンド２０１６　２０３５－２０３７年目標型

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	29,695,198円
Ⅱ　負債総額	30,253円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	29,664,945円
Ⅳ　発行済口数	22,214,094口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3354円

（参考）国内株式マザーファンド

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**435,486,148,303円**
Ⅱ　負債総額	**24,677,087,833円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**410,809,060,470円**
Ⅳ　発行済口数	**204,876,612,994口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.0052円**

（参考）外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**1,164,037,852,554円**
Ⅱ　負債総額	**707,753,108円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**1,163,330,099,446円**
Ⅳ　発行済口数	**269,080,049,802口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**4.3234円**

（参考）新興国株式マザーファンド

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**70,470,741,414円**
Ⅱ　負債総額	**395,014,259円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**70,075,727,155円**
Ⅳ　発行済口数	**44,460,173,334口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.5761円**

（参考）国内債券ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合　マザーファンド

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**859,126,132,526円**
Ⅱ　負債総額	**19,639,182,767円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**839,486,949,759円**
Ⅳ　発行済口数	**636,341,197,783口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.3192円**

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	179,633,034,905円
Ⅱ　負債総額	90,335,091,866円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	89,297,943,039円
Ⅳ　発行済口数	74,450,250,007口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1994円

（参考）外国債券マザーファンド

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	633,137,583,021円
Ⅱ　負債総額	3,383,327,925円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	629,754,255,096円
Ⅳ　発行済口数	248,080,500,244口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5385円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2022年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	8,780,803,283円
Ⅱ　負債総額	19,397,066円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	8,761,406,217円
Ⅳ　発行済口数	6,275,146,282口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3962円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

③委託者は、上記①の振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、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

2022年1月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数　　20,000,000株

発行済株式総数　　5,150,693株

過去５年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

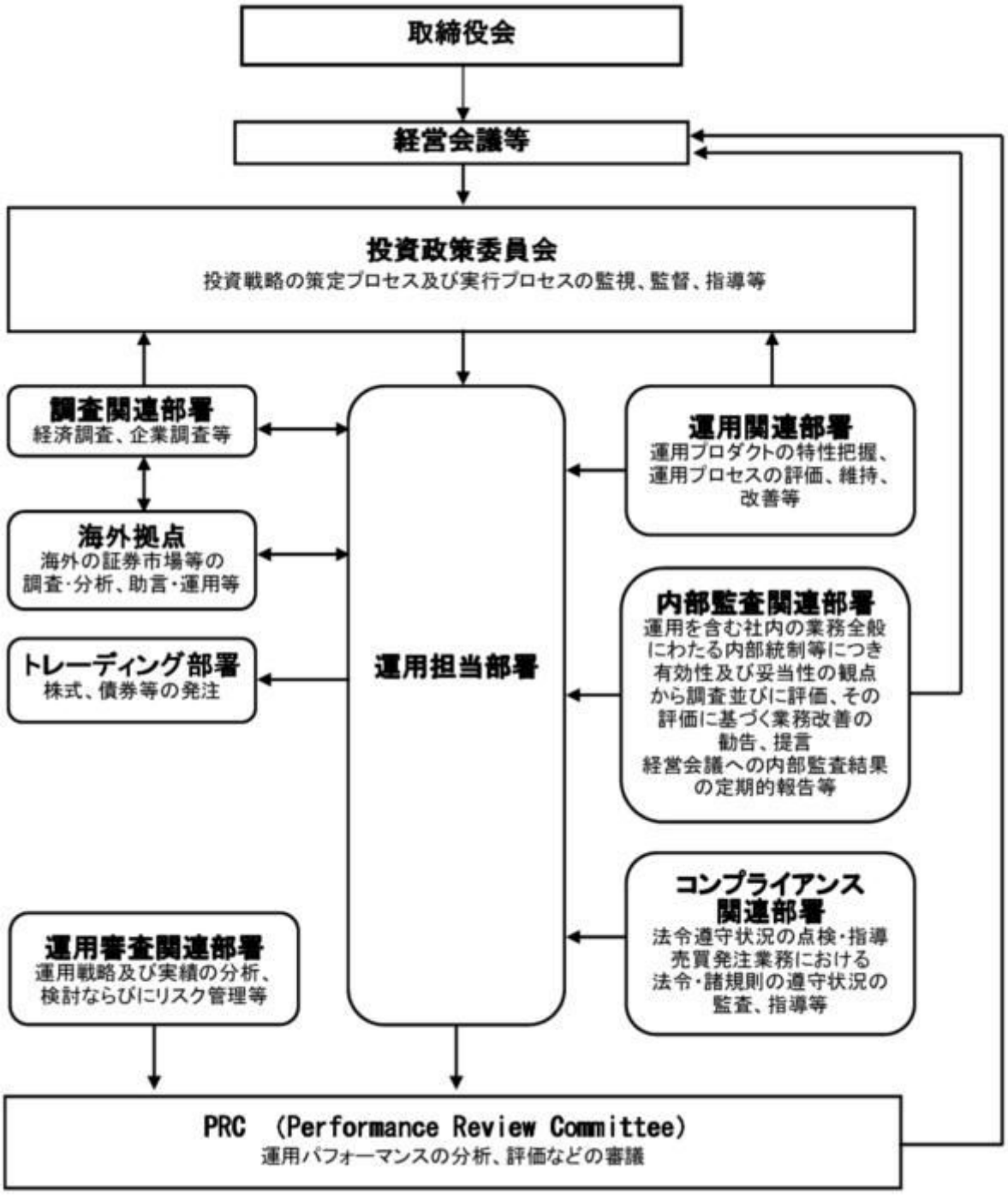
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2021年12月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

種類	本数	純資産総額(百万円)

追加型株式投資信託	991	39,486,534
単位型株式投資信託	194	782,637
追加型公社債投資信託	14	6,381,492
単位型公社債投資信託	510	1,574,766
合計	1,709	48,225,429

3【委託会社等の経理状況】

1．委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

2．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

		前事業年度 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(資産の部)					
流動資産					
現金・預金			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

区分	注記番号	前事業年度 (2020年3月31日) 金額(百万円)		当事業年度 (2021年3月31日) 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 (自　2019年4月1日 至　2020年3月31日)		当事業年度 (自　2020年4月1日 至　2021年3月31日)	
区分	注記番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			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

区分	注記番号	前事業年度 (自　2019年4月1日 至　2020年3月31日) 金額(百万円)		当事業年度 (自　2020年4月1日 至　2021年3月31日) 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
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	△1,653	△1,653	△1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(単位：百万円)

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

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	(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの … 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの … 移動平均法による原価法
２．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
３．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。
４．引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。

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

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

◇　損益計算書関係

前事業年度 (自　2019年4月１日 至　2020年3月31日)	当事業年度 (自　2020年4月１日 至　2021年3月31日)

※１．関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　4,931百万円 ※２．固定資産除却損 器具備品　7百万円 ソフトウェア　59 合計　67	※１．関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金　4,334百万円 ※２．固定資産除却損 器具備品　2百万円 ソフトウェア　102 合計　105

◇　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ディブ取引は行わない方針であります。

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リ

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

２．金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

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 5年以内	5年超 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	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

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

該当事項はありません。

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	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	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)
１．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。 ２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

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

２．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,761 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 (2020年3月31日)		当事業年度末 (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 自　2019年4月 1日 至　2020年3月31日	当事業年度 自　2020年4月 1日 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(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000(百万円)	証券業	―	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1．上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2．取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。
(*2) コマーシャル･ペーパーの購入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

２．親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

野村ホールディングス㈱（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(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000(百万円)	証券業	―	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1）	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㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇ 1株当たり情報

前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額 16,557円31銭 1株当たり当期純利益 4,658円88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 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。 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 23,996百万円 普通株式に係る当期純利益 23,996百万円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 5,150,693株	潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 26,276百万円 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 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

中間財務諸表

◇中間貸借対照表

		2021年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		2,226
金銭の信託		36,349
有価証券		11,600
未収委託者報酬		26,924
未収運用受託報酬		4,497
その他		1,176
貸倒引当金		△15
流動資産計		82,759
固定資産		
有形固定資産	※1	2,005
無形固定資産		5,512
ソフトウェア		5,511

その他		0
投資その他の資産		15,622
投資有価証券		1,949
関係会社株式		9,864
前払年金費用		1,305
繰延税金資産		1,951
その他		551
固定資産計		23,140
資産合計		105,899

		2021年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		12,617
未払収益分配金		0
未払償還金		5
未払手数料		8,203
関係会社未払金		3,481
その他未払金	※2	925
未払費用		9,068
未払法人税等		1,282
賞与引当金		1,966
資産除去債務		296
その他		150
流動負債計		25,381
固定負債		
退職給付引当金		3,265
時効後支払損引当金		588
資産除去債務		1,123
固定負債計		4,976
負債合計		30,358
(純資産の部)		
株主資本		75,467
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		44,557
利益準備金		685
その他利益剰余金		43,872
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		19,265
評価・換算差額等		74
その他有価証券評価差額金		74
純資産合計		75,541
負債・純資産合計		105,899

◇中間損益計算書

		自　2021年4月 1日 至　2021年9月30日
区分	注記番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		57,049
運用受託報酬		8,278
その他営業収益		219

営業収益計		65,547
営業費用		
支払手数料		19,265
調査費		12,882
その他営業費用		2,443
営業費用計		34,591
一般管理費	※１	14,589
営業利益		16,366
営業外収益	※２	4,136
営業外費用	※３	262
経常利益		20,241
特別利益	※４	49
特別損失	※５	507
税引前中間純利益		19,782
法人税、住民税及び事業税		4,594
法人税等調整額		1,049
中間純利益		14,139

◇中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自　2021年4月1日　至　2021年9月30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	31,395	56,686	87,596
当中間期変動額									
剰余金の配当							△26,268	△26,268	△26,268
中間純利益							14,139	14,139	14,139
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	－	－	－	－	－	－	△12,129	△12,129	△12,129

当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	19,265	44,557	75,467

（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	57	57	87,654
当中間期変動額			
剰余金の配当			△26,268
中間純利益			14,139
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	16	16	16
当中間期変動額合計	16	16	△12,112
当中間期末残高	74	74	75,541

[重要な会計方針]

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

	(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
5　収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。 ①　委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年４回、もしくは年２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。 ②　運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年４回、もしくは年２回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。 ③　成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。
6　消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。
7　連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。 なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」(令和2年法律第8号)において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号　2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号　2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

[会計方針の変更]

（収益認識に関する会計基準等の適用）
「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。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識しています。
これにより、営業外収益に計上しておりますシステム利用サービスに係る収益について、従来は、当該システム利用サービスに係るシステム関連費用を控除し、純額で認識しておりましたが、控除せず、総額で収益を認識する方法に変更しております。
収益認識会計基準等の適用については、収益認識会計基準第84項ただし書きに定める経過的な取扱いに従っており、当中間会計期間の期首より前に新たな会計方針を遡及適用した場合の累積的影響額を、当中間会計期間の期首の繰越利益剰余金に反映させ、当該期首残高から新たな会計方針を適用しております。
これによる中間財務諸表に与える影響は軽微であります。

（時価の算定に関する会計基準の適用）
「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-２項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用しております。これによる中間財務諸表に与える影響はありません。
また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うこととしました。

[注記事項]

◇中間貸借対照表関係

2021年9月30日現在
※１　有形固定資産の減価償却累計額 1,136百万円
※２　消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。

◇中間損益計算書関係

	自　2021年4月 1日 至　2021年9月30日
※１　減価償却実施額	
有形固定資産	286百万円
無形固定資産	1,006百万円
※２　営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	3,530百万円
※３　営業外費用のうち主要なもの	
金銭の信託運用損	71百万円
時効後支払損引当金繰入	10百万円
※４　特別利益の内訳	
投資有価証券等売却益	26百万円
株式報酬受入益	23百万円

※５　特別損失の内訳

投資有価証券等売却損	0百万円
関係会社株式評価損	77百万円
固定資産除却損	374百万円
事務所移転費用	54百万円

◇中間株主資本等変動計算書関係

自　2021年4月 1日
至　2021年9月30日

１　発行済株式に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式	5,150,693株	―	―	5,150,693株

２　配当に関する事項

配当金支払額

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

(1) 配当金の総額	26,268百万円
(2) 1株当たり配当額	5,100円
(3) 基準日	2021年3月31日
(4) 効力発生日	2021年6月30日

◇金融商品関係

１．金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	36,349	36,349	-
資産計	36,349	36,349	-

（注）1　現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注）2　投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

区分	当中間会計期間（百万円）
市場価格のない株式等（※）1，2	10,176
組合出資金等	1,637
合計	11,814

（※）1　市場価格のない株式等には非上場株式等が含まれております。

（※）2　非上場株式等について、当中間会計期間において77百万円減損処理を行っております。

２．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3

つのレベルに分類しております。
レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価
レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価
レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価
時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

（1）時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

2021年9月30日現在

	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託（運用目的・その他）（※）	-	2,452	-	2,452
合計	-	2,452	-	2,452

（※）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託33,897百万円は表中に含まれておりません。

（2）時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品
該当事項はありません。

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

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。
信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。

◇有価証券関係

当中間会計期間末 （2021年9月30日）

１．満期保有目的の債券(2021年9月30日)
該当事項はありません。

２．子会社株式及び関連会社株式(2021年9月30日)
市場価格のない子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

	中間貸借対照表計上額(百万円)
子会社株式	9,758
関連会社株式	106

合計	9,864

これらについては市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

３．その他有価証券(2021年9月30日)

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	11,600	11,600	-
小計	11,600	11,600	-
合計	11,600	11,600	-

◇資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減　　(単位：百万円)

	自　2021年4月 1日 至　2021年9月30日
期首残高	1,371
有形固定資産の取得に伴う増加	48
時の経過による調整額	-
中間期末残高	1,419

◇収益認識に関する注記

１．顧客との契約から生じる収益を分解した情報

	自　2021年4月 1日 至　2021年9月30日
委託者報酬	57,003百万円
運用受託報酬	8,273百万円
成功報酬（注）	51百万円
その他営業収益	219百万円
合計	65,547百万円

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

２．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針]５　収益及び費用の計上基準に記載のとおりであります。

３．顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

◇セグメント情報等

当中間会計期間(自　2021年4月1日　至　2021年9月30日)

１．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

２．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

◇１株当たり情報

	自　2021年4月 1日 至　2021年9月30日
１株当たり純資産額	14,666円31銭
１株当たり中間純利益	2,745円08銭

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

２.１株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

中間純利益	14,139百万円
普通株主に帰属しない金額	―
普通株式に係る中間純利益	14,139百万円
期中平均株式数	5,150千株

４【利害関係人との取引制限】

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

①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものと

して内閣府令で定めるものを除きます。)。

②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託者

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

＊2021年12月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額*	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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んでいます。

＊2021年12月末現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託者

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 3月19日	有価証券届出書
2021年 3月19日	有価証券報告書
2021年 9月24日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年 9月24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 業務執行社員	公認会計士	亀　井　　純　子
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津　村　　健二郎
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水　永　　真太郎

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

２０２２年2月１８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」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016　2026-2028年目標型の２０２０年１２月２９日から２０２１年１２月２７日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016　2026-2028年目標型の２０２１年１２月２７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. 上記の監査報告書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

２０２２年2月１８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」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型の２０２０年１２月２９日から２０２１年１２月２７日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型の２０２１年１２月２７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. 上記の監査報告書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

２０２２年2月１８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」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型の２０２０年１２月２９日から２０２１年１２月２７日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型の２０２１年１２月２７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. 上記の監査報告書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

２０２２年2月１８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」に掲げられている野村ターゲットデートファンド2016　2035-2037年目標型の２０２０年１２月２９日から２０２１年１２月２７日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村ターゲットデートファンド2016　2035-2037年目標型の２０２１年１２月２７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. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

２０２１年１１月２４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	湯　原　　尚
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津　村　健二郎
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	水　永　真太郎

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の２０２１年４月１日から２０２２年3月３１日までの第６３期事業年度の中間会計期間（２０２１年４月１日から２０２１年9月３０日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の２０２１年9月３０日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（２０２１年４月１日から２０２１年９月３０日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判

断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

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

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．上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。