

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年7月20日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックス・ブレンド（タイプⅠ） インデックス・ブレンド（タイプⅡ） インデックス・ブレンド（タイプⅢ） インデックス・ブレンド（タイプⅣ） インデックス・ブレンド（タイプⅤ）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	インデックス・ブレンド（タイプⅠ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプⅡ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプⅢ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプⅣ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプⅤ） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

インデックス・ブレンド（タイプⅤ）

※これらを総称して「インデックス・ブレンド」または「各ファンド」、「各タイプ」という場合、あるいは個別に「ファンド」という場合があります。なお、ファンドの愛称を「My Funds-i」とします。）

ファンドの名称については、正式名称ではなく略称で記載する場合があります。

正式名称	略称
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	タイプⅠ
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	タイプⅡ
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	タイプⅢ
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	タイプⅣ
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	タイプⅤ

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

■信用格付■

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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ます（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託者である野村アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額[※]とします。

※「基準価額」とは、純資産総額をその時の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/>

（５）【申込手数料】

①取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（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ください。

②収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

（６）【申込単位】

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

なお、販売会社や申込形態によっては、申込単位が上記と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（７）【申込期間】

2022年7月21日から2023年7月20日まで

※なお、申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)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/>

（９）【払込期日】

販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。

※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、「委託者」（または「委託会社」といいます。）の指定する口座を経由して、「受託者」（または「受託会社」といいます。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込代金は申込みの販売会社にお支払いください。払込取扱場所についてご不明の場合は、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/>

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【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】

◆国内外（新興国を含む）の株式、債券、不動産投資信託証券（REIT）等を実質的な主要投資対象[※]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。

※「実質的な主要投資対象」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」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「米国株式配当貴族インデックスマザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」、「海外REITインデックスマザーファンド」、「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」を通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

■信託金の限度額■

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。

（インデックス・ブレンド（タイプⅠ））
（インデックス・ブレンド（タイプⅡ））
（インデックス・ブレンド（タイプⅢ））
（インデックス・ブレンド（タイプⅣ））
（インデックス・ブレンド（タイプⅤ））

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

＜商品分類表定義＞

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル…目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載が

あるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

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

〔投資形態による属性区分〕

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

〔為替ヘッジによる属性区分〕

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

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

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

〔特殊型〕

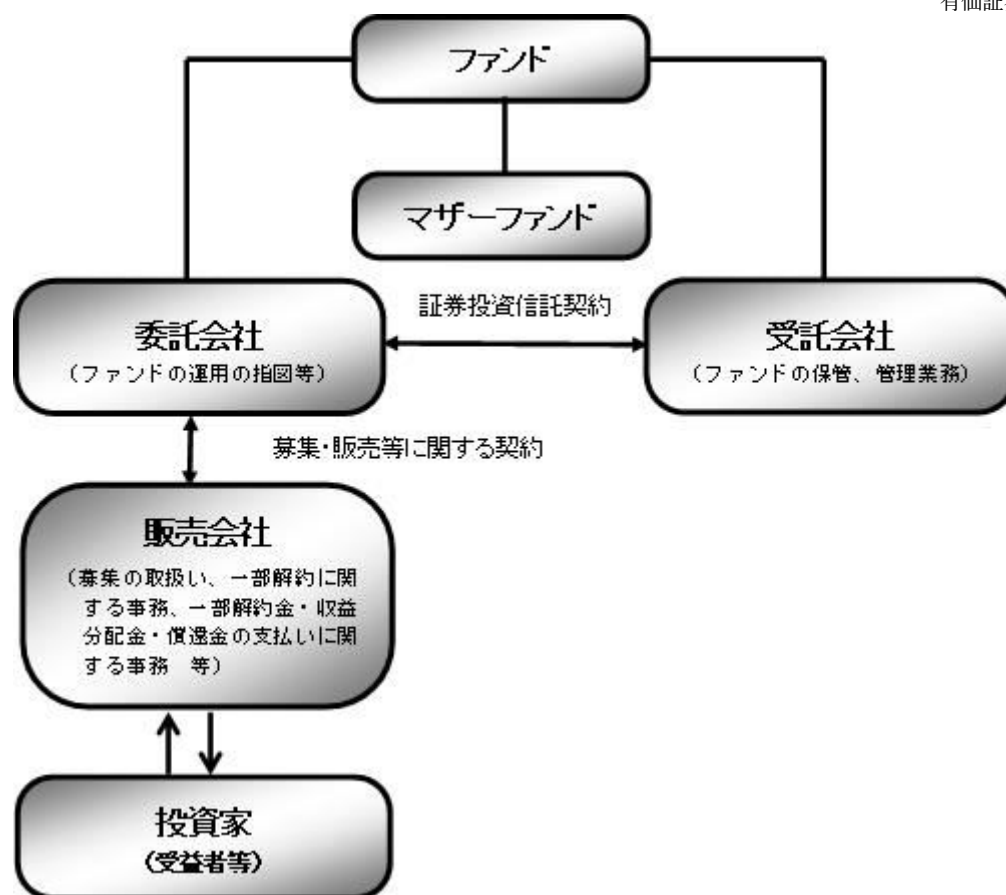
- (1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年1月10日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

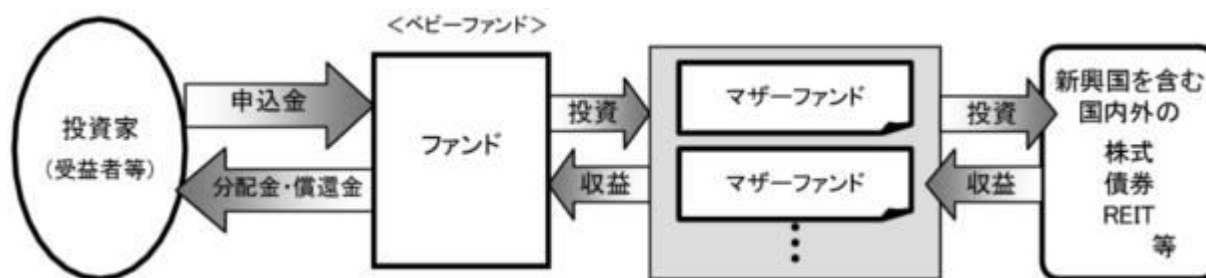
(3) 【ファンドの仕組み】



ファンド	インデックス・ブレンド (タイプⅠ)	インデックス・ブレンド (タイプⅡ)	インデックス・ブレンド (タイプⅢ)	インデックス・ブレンド (タイプⅣ)	インデックス・ブレンド (タイプⅤ)
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				
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド				
	新興国株式マザーファンド				
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド				
	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド				
	外国債券マザーファンド				
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド				
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド				
	新興国債券マザーファンド				
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド				
	J-REITインデックス マザーファンド				
	海外REITインデックス マザーファンド				
	海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド				
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				

※上記マザーファンドは2022年7月20日現在のものであり、変更する場合があります。

●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6月末現在)■

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- 「インデックス・ブレンド」は、リスク性資産[※]への投資比率が低い順に「タイプⅠ」、「タイプⅡ」、「タイプⅢ」、「タイプⅣ」、「タイプⅤ」の5つのファンドで構成されています。

※当ファンドにおいて、投資対象とするマザーファンドが連動することを目指すインデックス等（インデックス）の過去の値動きや特性などを勘案し、相対的に大きな値動きが想定されるものをリスク性資産とします。

◆投資対象とする各マザーファンドは、各々以下の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。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数	リスク性資産
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） ・MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）	○

新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券） ^{*1} を含みます。）	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	米国の株式	S&P 500配当貴族指数（配当込み・円換算ベース） ^(注1) ・S&P 500配当貴族指数（配当込み・米ドル建て）をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合	
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	○
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）	
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・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） ・JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース） ^(注1) ・JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。	(注2)
米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	米ドル建てのハイ・イールド社債	ブルームバーグ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース） ^(注1) ・ブルームバーグ米国ハイイールド社債高流動性インデックス(USドルベース)をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
J-REITインデックスマザーファンド	J-REIT ^{*2}	東証REIT指数（配当込み）	○
海外REITインデックスマザーファンド	日本を除く世界各国のREIT ^{*3}	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） ・S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。	○
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	日本を除く世界各国のREIT ^{*3}	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）	○

※上記は2022年7月20日現在のものであり、変更する場合があります。

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

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

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

(注1) マザーファンドでは原則として為替ヘッジを行ないませんが、ファンドにおいて為替ヘッジを行なうことで、実

質的に為替ヘッジを行なった当該対象指数へ連動する投資効果を得ることを目指して運用を行なう場合があります。

(注2) 「新興国債券マザーファンド」への投資にあたっては為替ヘッジを行なうことを原則としており、当ファンドにおいて為替ヘッジ後の当該マザーファンドへの投資についてはリスク性資産とみなしておりません。

●各ファンドのリスク性資産への投資比率の合計は、信託財産の純資産総額に対してそれぞれ以下の比率を中心とすることを原則とします。

タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
30%	43%	55%	65%	80%

・上記はリスク性資産とみなしたマザーファンドへの投資比率の合計とします。

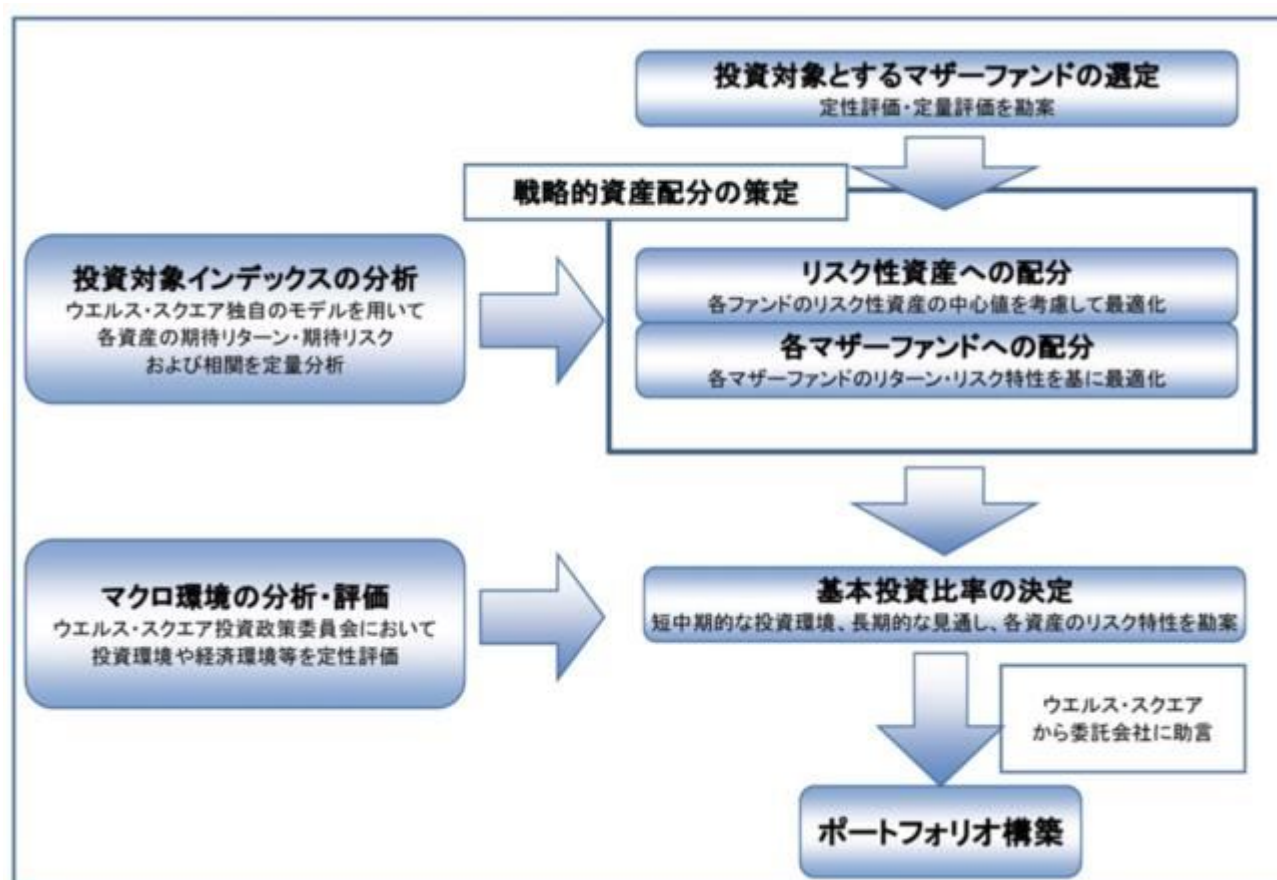
●株式会社ウエルス・スクエア(ウエルス・スクエア) による以下のプロセスに従った助言に基づいて投資対象とするマザーファンドおよび各マザーファンドへの投資比率を決定します。

◆ウエルス・スクエア独自のモデルを用いてインデックスを定量的な手法により分析し、リスク性資産への配分および各マザーファンドへの配分を含む戦略的資産配分等を策定します。なお、分析において為替ヘッジを行なう場合と為替ヘッジを行なわない場合では異なるインデックスとして扱います。

◆戦略的資産配分に各種情報や分析を基とした定性的な判断による短期、中期、長期の視点を取り入れ、リスク特性などを勘案して最終的な投資比率（基本投資比率）を決定します。なお、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。

◆投資対象とするマザーファンドについては、定性評価・定量評価等を勘案し、適宜見直しを行ないます。なお、投資対象とするマザーファンドは各種金融指標の動きを捉えることを目的とするマザーファンドから選定することを基本とします。

■ポートフォリオ構築プロセス■



*上記のポートフォリオ構築プロセスは、今後変更となる場合があります。

●組入マザーファンドとファンド全体のリスク特性の状況をモニターし、基本投資比率の見直しを定期的

に行なうことを基本とします。なお、市況見通しの変化等によっては、適宜リバランスや基本投資比率の見直しを行なう場合があります。また、投資対象とするマザーファンドは適宜見直しを行ないます。

- 基本投資比率の決定において為替ヘッジを行なうこととした実質組入外貨建資産については、マザーファンドもしくはファンドにおいて為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図ります。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて効率的な運用を行なうため、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実質的に活用する場合があります。

(参考) ウェルス・スクエアについて

■ウェルス・スクエアの概要■

- ◆株式会社ウェルス・スクエアは、野村グループの資産運用会社で、主にファンドラップの投資運用サービス等の提供を行ないます。

■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）、東証REIT指数（配当込み）■

- ①東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有する。
- ②J P Xは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③J P Xは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④J P Xは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）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ない。また、J P Xは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑥J P Xは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ⑦J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
- ⑧以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

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

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源から本件指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性及び／または完全性について保証するものではありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、本件ファンドの発行会社、本件ファンドの所有者その他の個人・法人が、本契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連して本件指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証をおこなうものではありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数及びそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。本件指数及びそれに含まれるデータに関し、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら

保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害（逸失利益を含む。）につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

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

■S&P 500配当貴族指数■

「S&P 500 Dividend Aristocrats Index」（S&P 500配当貴族指数）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが野村アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's^(R) およびS&P^(R) はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones^(R) はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが野村アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追従するS&P 500 Dividend Aristocrats Indexの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexに関して、S&P Dow Jones Indicesと野村アセットマネジメント株式会社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexは野村アセットマネジメント株式会社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 500 Dividend Aristocrats Indexの決定、構成または計算において野村アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexに基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追従する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホルードの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P DOW JONES INDICESは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって野村アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESと野村アセットマネジメント株式会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

■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、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)」、「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。

■「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド」、

「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス」■

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まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

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

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。

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

■ブルームバーグ米国ハイイールド社債高流動性インデックス■

「Bloomberg^(R)」は、Bloomberg Finance L.P.および、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社（以下、総称して「ブルームバーグ」）の商標およびサービスマークです。ブルームバーグまたはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

■S&P先進国REIT指数■

本ファンドは、スタンダード&プアーズ及びその関連会社（以下、S&P）により、何ら支援、推奨、販売または販促されるものではありません。

S&Pは、ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、証券への全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいはS&P先進国REIT指数の一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックする能力に関して、明示的であると黙示的であることを問わず、一切の表明または保証を行いません。

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

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

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

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

各マザーファンドへの投資を通じて、国内外（新興国を含む）の株式、債券、不動産投資信託証券（REIT）等を実質的な主要投資対象とします。なお、投資対象とするマザーファンドにおいて効率的な運用を行なうため、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。

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、⑥、⑨及び⑪」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. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

の証券または証書のうち第15号および第16号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

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13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記②第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）
9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記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. クレジットデリバティブ取引
4. 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。

5. 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。

6. 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 主としてわが国の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。

（外国株式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、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）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・為替ヘッジあり）の動きに連動す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す。
- ③ MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引ならびに為替予約取引をヘッジ目的外の利用も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 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- 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（預託証券）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（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。
- 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。

（米国株式配当貴族インデックスマザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、S&P 500配当貴族指数（配当込み・円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

米国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。
- ② S&P 500配当貴族指数（配当込み・円換算ベース）の動きを効率的に捉える投資成果を目指すため、株価指数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も含め活用する場合があります。また、効率的な運用を行なうため、上場投資信託証券（ETF）を活用する場合があります。
- ③ 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。
- 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 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ④ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤ 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑥ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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 同一銘柄の上場投資信託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 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。
- ⑨ 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。

（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。

（新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

（新興国債券マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。
- 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 投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- 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。

（米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、ブルームバーグ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・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

米ドル建てのハイ・イールド社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

- ① 米ドル建てのハイ・イールド社債を主要投資対象とし、ブルームバーグ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・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、米国国債に投資する場合があります。
- ② ブルームバーグ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース）の動きを効率的に捉える投資成果を目指すため、債券先物取引等のデリバティブ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。また、効率的な運用を行なうため、上場投資信託証券（ETF）を活用する場合があります。
- ③ 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。
- 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、優先証券のうち株券または新株引受権証券の性質を有するものまたは転換社債を転換、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。）を行使したものおよび社債権者割当等により取得したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。
- 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 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ⑤ 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。
- ⑥ 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑦ 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。
- ⑧ 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。
- ⑨ 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。

（Ｊ－REITインデックス マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

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

２．運用方法

（１）投資対象

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

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

（２）投資態度

- ① J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
- 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 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への直接投資は行ないません。
- ③ 株式への直接投資は行ないません。
- ④ 不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。
- ⑤ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超えるJ-REITがある場合には、当該J-REITへ東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。
- 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。

（海外REITインデックス マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

１．基本方針

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

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

２．運用方法

（１）投資対象

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

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

(2) 投資態度

- ① REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
- ② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ③ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ 株式への直接投資は行いません。
- ④ 不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。
- ⑤ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。
- 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。

（海外REITインデックス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、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）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

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

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

(2) 投資態度

- ① 日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）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。

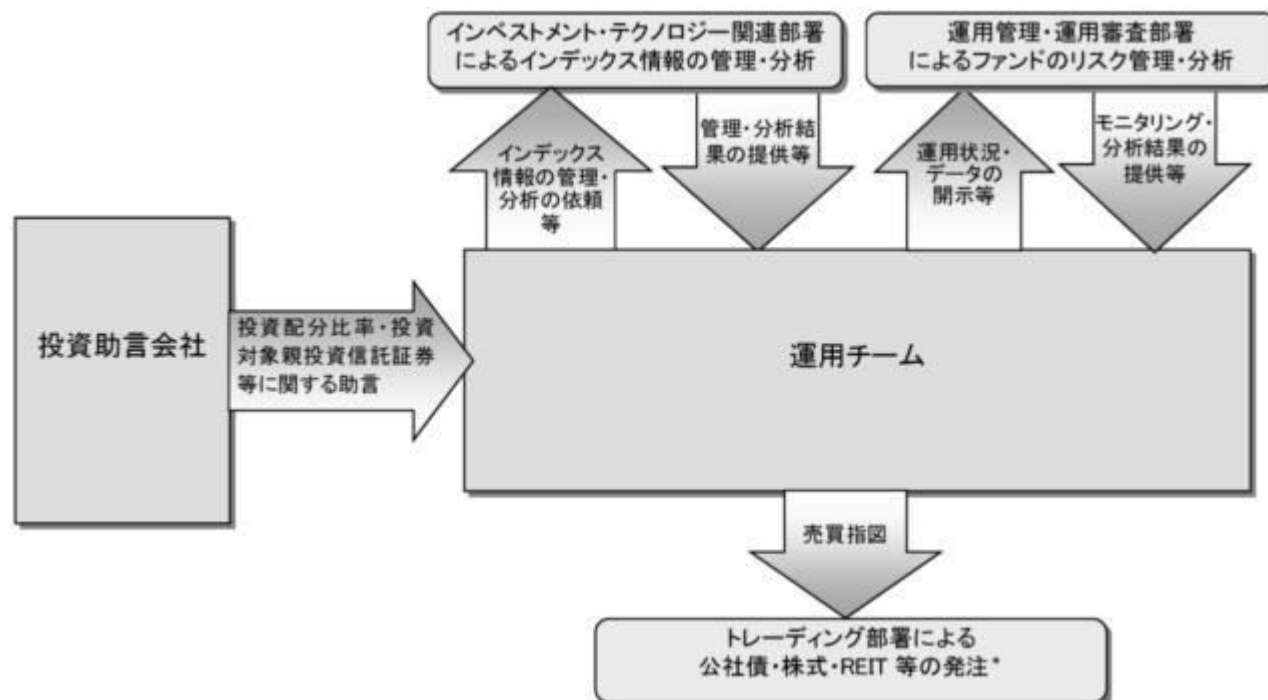
- ② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。
- ③ 効率的な運用を行なうため、REIT指数先物取引、株価指数先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。
- ④ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

- ① 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。
- 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。

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

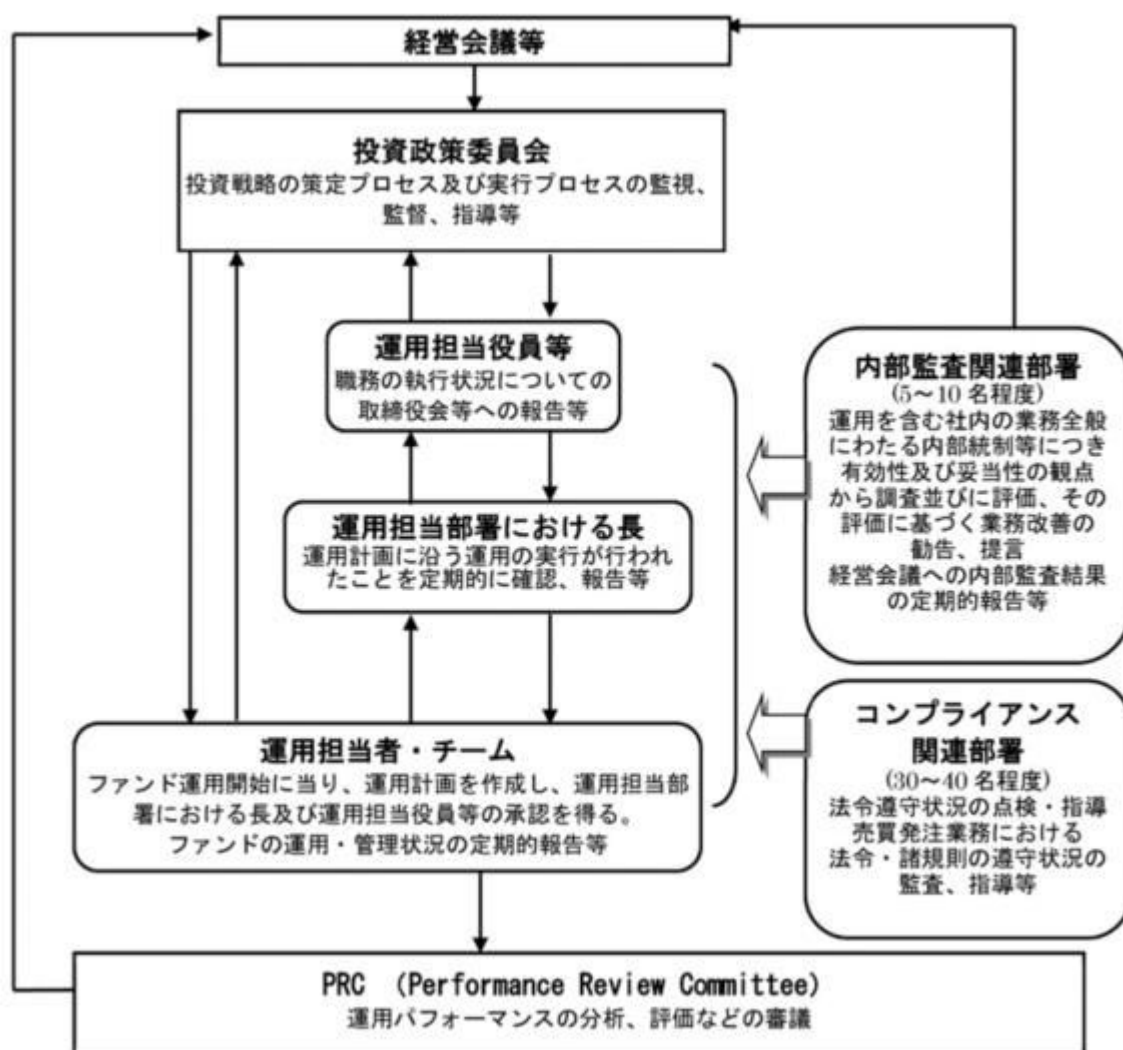


※一部のマザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴う裁量権は付与しないものとします。）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドに代行させます。

※運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

◆ファンドの決算日

原則として**毎年4月22日**（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

（５）【投資制限】

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券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債[※]の新株予約権に限ります。）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ならびに有価証券店頭デリバティブ取引（金融商品取引法第28条第8項第4号イからニに掲げるものをいいます。以下同じ。）を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- (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)の店頭デリバティブ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- (v) 委託者は、上記(i)の店頭デリバティブ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

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クレジットデリバティブ取引の運用指図(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、クレジットデリバティブ取引（金融商品取引法第2条第21項第5号イ、同条第22項第6号イに掲げるものおよび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。
- (ii)クレジットデリバティブ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)クレジットデリバティブ取引（金融商品取引法第2条第22項第6号イに掲げるものに限ります。）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、クレジットデリバティブ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑦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。

⑧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。

⑨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、

(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。

⑩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。

⑪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、

(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。

⑫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。

⑬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。

[REITの価格変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の債券価格の変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。また、ファンドが実質的に投資を行なうハイ・イールド社債等の格付けの低い債券については、格付けの高い債券に比べ、価格が大きく変動する可能性や組入債券の元利金の支払遅延および支払不履行などが生じるリスクが高いと想定されます。

[為替変動リスク]

ファンドは、基本投資比率の決定において為替ヘッジを行なうこととした実質組入外貨建資産については、マザーファンドもしくはファンドにおいて為替ヘッジを行ない為替変動リスクの低減を図りますが、その他の実質組入外貨建資産については、為替変動の影響を受けます。なお、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図る場合においても、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。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性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。
 - ◆投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。また、投資対象に含まれる一部のマザーファンドにおいてはベビーファンドの換金等に伴ない、マザーファンドの換金を行なう場合には、原則として当該マザーファンドの信託財産に信託財産留保額を繰り入れます。
 - ◆ファンドが実質的な投資対象とするREITの中には、流動性の低いものもあり、こうしたREITへの投資は、流動性の高い株式等に比べて制約を受けることが想定されます。
 - ◆REITに関する法律（税制度、会計制度等）、不動産を取り巻く規制が変更となった場合、REITの価格や配当に影響が及ぶことが想定されます。
 - ◆ファンドが投資対象とするマザーファンドについては、適宜見直しを行ないます。マザーファンドの増減および入替を行なう際には、一時的にマザーファンドへの投資比率が低下する場合があります。
 - ◆ファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。
 - ◆金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入（スイッチングによる購入を含みます。）・換金の各受付けを中止すること、およびすでに受付けた購入（スイッチングによる購入を含みます。）・換金の各受付を取り消す場合があります。
 - ◆ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。
- 投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。
- 分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

《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

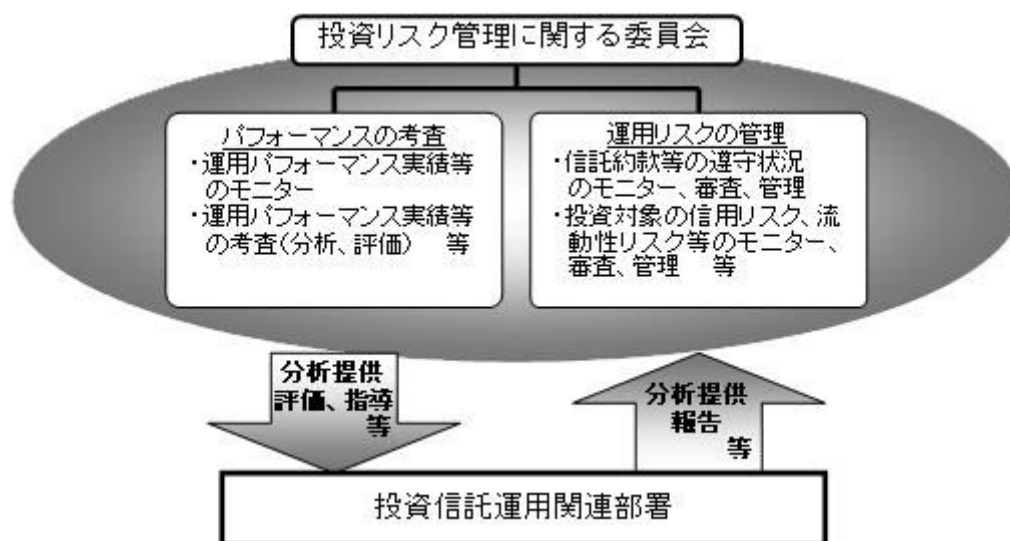
投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

※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

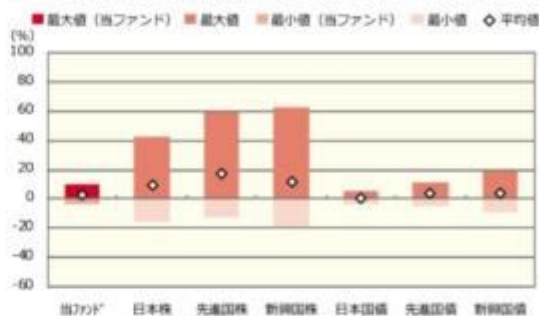
■ リスクの定量的比較（2017年6月末～2022年5月末：月次）

■ タイプⅠ

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 (%)	10.3	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 3.6	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	3.0	9.6	17.1	11.8	0.1	3.7	3.3

- * 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6月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

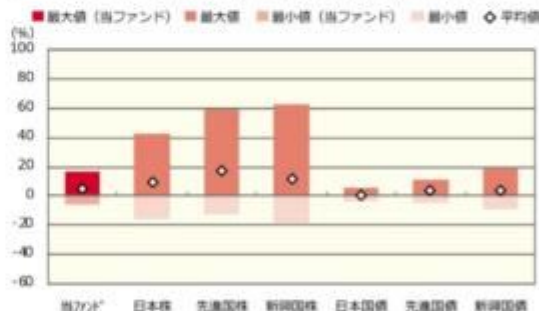
- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2017年6月から2022年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2022年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

■ タイプⅡ

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 (%)	16.9	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 5.3	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	4.5	9.6	17.1	11.8	0.1	3.7	3.3

- * 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6月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2022年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2017年6月から2022年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2022年5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。



投資リスク

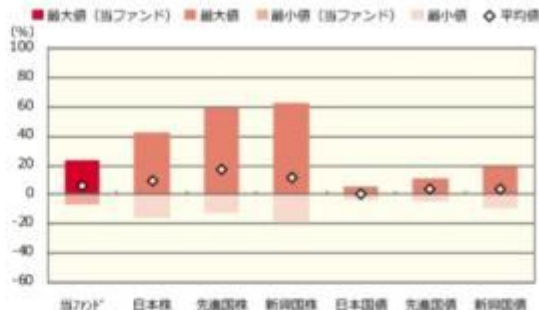
タイプⅢ

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



2017年6月 2018年5月 2019年5月 2020年5月 2021年5月 2022年5月

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	23.6	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値 (%)	△ 6.9	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 4.0	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	6.0	9.6	17.1	11.8	0.1	3.7	3.3

* 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6月末を10,000として指数化しております。

* 年間騰落率は、2018年1月から2022年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
 * 2017年6月から2022年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2022年5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。

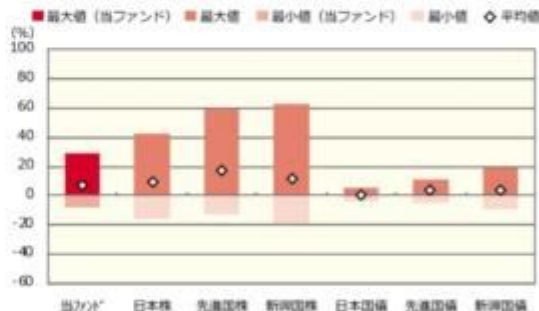
タイプⅣ

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



2017年6月 2018年5月 2019年5月 2020年5月 2021年5月 2022年5月

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	29.0	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	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	7.0	9.6	17.1	11.8	0.1	3.7	3.3

* 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6月末を10,000として指数化しております。

* 年間騰落率は、2018年1月から2022年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
 * 2017年6月から2022年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2022年5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。



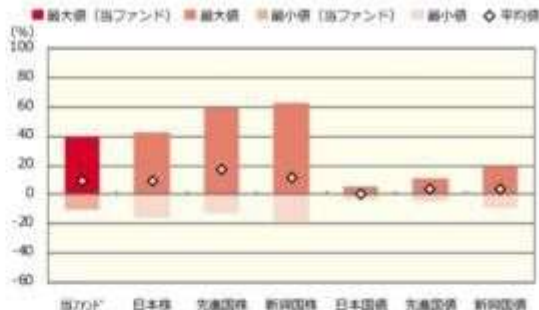
投資リスク

タイプV

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(%)	38.7	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	19.3
最小値(%)	10.0	16.0	12.4	19.4	4.0	4.5	9.4
平均値(%)	9.1	9.6	17.1	11.8	0.1	3.7	3.3

* 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6月末を10,000として指数化しております。

* 年間騰落率は、2018年1月から2022年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
 * 2017年6月から2022年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2022年5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。

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

<代表的な資産クラスの指数>

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

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標準又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標準又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の限定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。
- MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社の NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価値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、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JP Morgan）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、JP Morgan やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J P Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての勧誘、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。
- JPMS LLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA、JPFI、JP Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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。

ファンド	タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
信託報酬率	年0.528% (税抜年 0.48%)	年0.539% (税抜年 0.49%)	年0.55% (税抜年 0.50%)	年0.561% (税抜年 0.51%)	年0.572% (税抜年 0.52%)
委託会社	年0.25%	年0.26%	年0.27%	年0.28%	年0.29%
販売会社	年0.20%	年0.20%	年0.20%	年0.20%	年0.20%
受託会社	年0.03%	年0.03%	年0.03%	年0.03%	年0.03%

《支払先の役務の内容》

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

(4) 【その他の手数料等】

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、受託者の立替えた立替金の利息および信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用（債権回収に要する弁護士費用等を含む。）等は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。

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。

<タイプⅠ、タイプⅡ、タイプⅢ>

- 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0.15%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

<タイプⅣ、タイプⅤ>

- 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0.20%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

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

なお、配当控除は適用されません。

<換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税>

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

《損益通算について》

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

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

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

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

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

◆法人の投資家に対する課税

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■換金（解約）時および償還時の課税について■

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

■個別元本について■

◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

■分配金の課税について■

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

①分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額の場合または受益者の個別元本を上回っている場合には分配金の全額が普通分配金となります。



②分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。



※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5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5月31日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

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	168,574,631	98.39
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,757,729	1.60
合計（純資産総額）		171,332,360	100.00

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

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	89,495,693	98.11
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,719,002	1.88
合計（純資産総額）		91,214,695	100.00

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

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	559,659,176	98.29
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	9,689,549	1.70
合計（純資産総額）		569,348,725	100.00

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

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	129,537,630	98.20
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,373,463	1.79
合計（純資産総額）		131,911,093	100.00

インデックス・ブレンド（タイプⅤ）

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	433,286,115	98.48
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,682,549	1.51
合計（純資産総額）		439,968,664	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	422,079,661,420	97.11
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	12,549,990,871	2.88
合計（純資産総額）		434,629,652,291	100.00

その他の資産の投資状況

※その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	11,186,740,000	2.57

（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	897,316,953,515	69.96
	カナダ	49,549,071,945	3.86
	ドイツ	30,942,636,321	2.41
	イタリア	9,005,999,388	0.70
	フランス	42,046,097,672	3.27
	オランダ	16,740,017,709	1.30
	スペイン	9,439,920,772	0.73

	ベルギー	3,098,703,044	0.24
	オーストリア	763,097,962	0.05
	ルクセンブルグ	465,555,787	0.03
	フィンランド	3,744,806,262	0.29
	アイルランド	2,309,308,488	0.18
	ポルトガル	852,520,597	0.06
	イギリス	58,757,914,352	4.58
	スイス	38,444,411,852	2.99
	スウェーデン	13,218,158,340	1.03
	ノルウェー	2,889,335,934	0.22
	デンマーク	10,011,854,217	0.78
	オーストラリア	28,762,763,406	2.24
	ニュージーランド	690,427,313	0.05
	香港	10,128,063,150	0.78
	シンガポール	3,964,310,824	0.30
	イスラエル	1,611,941,240	0.12
	小計	1,234,753,870,090	96.27
投資証券	アメリカ	26,981,175,143	2.10
	カナダ	138,377,187	0.01
	フランス	586,059,418	0.04
	イギリス	742,839,448	0.05
	オーストラリア	1,876,876,963	0.14
	香港	540,900,223	0.04
	シンガポール	529,557,033	0.04
	小計	31,395,785,415	2.44
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	16,367,724,819	1.27
合計（純資産総額）		1,282,517,380,324	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	11,109,061,529	0.86
	買建	カナダ	638,648,700	0.04
	買建	ドイツ	1,539,385,344	0.12
	買建	イギリス	761,360,640	0.05
	買建	スイス	485,305,599	0.03
	買建	オーストラリア	385,695,763	0.03

（参考）外国株式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（％）
株式	アメリカ	66,394,100,129	66.65
	カナダ	3,661,580,678	3.67
	ドイツ	2,284,671,095	2.29
	イタリア	666,468,333	0.66
	フランス	3,115,183,909	3.12
	オランダ	1,241,170,032	1.24
	スペイン	698,447,808	0.70
	ベルギー	229,810,309	0.23
	オーストリア	56,641,374	0.05
	ルクセンブルグ	34,169,604	0.03
	フィンランド	278,671,172	0.27
	アイルランド	175,416,835	0.17
	ポルトガル	63,379,422	0.06
	イギリス	4,347,042,605	4.36
	スイス	2,839,480,473	2.85
	スウェーデン	978,327,207	0.98
	ノルウェー	213,253,883	0.21
	デンマーク	745,601,384	0.74
	オーストラリア	2,126,611,855	2.13
	ニュージーランド	50,027,946	0.05
	香港	750,120,056	0.75
	シンガポール	293,281,030	0.29
	イスラエル	121,866,216	0.12
	小計	91,365,323,355	91.72
投資証券	アメリカ	1,977,242,801	1.98
	カナダ	10,029,775	0.01
	フランス	42,089,137	0.04
	イギリス	55,962,392	0.05
	オーストラリア	138,241,124	0.13
	香港	38,687,403	0.03
	シンガポール	41,758,497	0.04
	小計	2,304,011,129	2.31
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	5,933,242,414	5.95
合計（純資産総額）		99,602,576,898	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	3,942,784,423	3.95
	買建	カナダ	204,367,584	0.20

買建	ドイツ	513,128,448	0.51
買建	イギリス	257,880,213	0.25
買建	スイス	156,550,193	0.15
買建	オーストラリア	134,155,048	0.13

（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	2,795,545,061	3.80
	メキシコ	1,525,086,124	2.07
	ブラジル	3,920,075,716	5.33
	チリ	122,520,444	0.16
	コロンビア	49,665,441	0.06
	ギリシャ	205,994,098	0.28
	トルコ	209,642,420	0.28
	チェコ	115,586,627	0.15
	ハンガリー	105,623,219	0.14
	ポーランド	461,050,627	0.62
	香港	16,108,368,152	21.92
	マレーシア	1,041,949,258	1.41
	タイ	1,356,367,578	1.84
	フィリピン	561,791,740	0.76
	インドネシア	1,310,900,279	1.78
	韓国	8,970,140,626	12.21
	台湾	11,212,531,542	15.26
	インド	8,938,090,214	12.16
	カタール	730,527,099	0.99
	エジプト	40,164,527	0.05
	南アフリカ	2,659,793,197	3.62
	アラブ首長国連邦	930,762,769	1.26
	クウェート	560,459,464	0.76
	サウジアラビア	3,180,833,498	4.33
	小計	67,113,469,720	91.36
投資信託受益証券	アメリカ	2,955,793,085	4.02
投資証券	メキシコ	49,472,126	0.06
	南アフリカ	35,541,000	0.04
	小計	85,013,126	0.11
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	3,300,141,521	4.49
合計（純資産総額）		73,454,417,452	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	2,695,799,185	3.67
	買建	香港	541,991,748	0.73

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	67,520,472,103	94.41
投資信託受益証券	アメリカ	559,923,840	0.78
投資証券	アメリカ	3,062,719,455	4.28
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	370,723,234	0.51
合計（純資産総額）		71,513,838,632	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	346,325,658	0.48

（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	683,155,306,850	80.57
地方債証券	日本	56,432,342,495	6.65
特殊債券	日本	64,348,465,446	7.58
社債券	日本	41,440,624,950	4.88
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,453,407,889	0.28
合計（純資産総額）		847,830,147,630	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	320,893,076,826	49.34
	カナダ	13,347,481,584	2.05
	メキシコ	4,946,056,623	0.76
	ドイツ	37,698,818,733	5.79
	イタリア	59,064,048,627	9.08

	フランス	54,023,100,754	8.30
	オランダ	8,750,640,522	1.34
	スペイン	41,126,842,363	6.32
	ベルギー	13,328,061,184	2.04
	オーストリア	8,037,030,093	1.23
	フィンランド	2,554,000,693	0.39
	アイルランド	8,186,758,047	1.25
	イギリス	33,843,547,838	5.20
	スウェーデン	1,779,666,233	0.27
	ノルウェー	1,646,936,362	0.25
	デンマーク	2,539,091,364	0.39
	ポーランド	2,729,987,933	0.41
	オーストラリア	10,117,259,340	1.55
	シンガポール	2,835,733,029	0.43
	マレーシア	3,197,808,806	0.49
	中国	11,086,006,465	1.70
	イスラエル	2,593,090,381	0.39
	小計	644,325,043,800	99.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	5,992,250,002	0.92
合計（純資産総額）		650,317,293,802	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	39,768,878,303	49.11
	カナダ	1,631,375,808	2.01
	メキシコ	618,674,204	0.76
	ドイツ	5,161,940,258	6.37
	イタリア	6,585,719,775	8.13
	フランス	7,615,850,955	9.40
	オランダ	1,263,796,414	1.56
	スペイン	4,546,144,355	5.61
	ベルギー	1,767,178,866	2.18
	オーストリア	967,698,825	1.19
	フィンランド	445,130,488	0.54
	アイルランド	595,735,472	0.73
	イギリス	4,163,468,572	5.14
	スウェーデン	207,270,093	0.25
	ノルウェー	215,638,846	0.26
	デンマーク	317,365,599	0.39
	ポーランド	355,365,229	0.43

	オーストラリア	1,248,669,671	1.54
	シンガポール	761,282,732	0.94
	中国	1,339,318,940	1.65
	イスラエル	332,938,061	0.41
	小計	79,909,441,466	98.68
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,065,744,754	1.31
合計（純資産総額）		80,975,186,220	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	696,851,986	10.03
	ブラジル	693,971,996	9.99
	チリ	148,764,409	2.14
	コロンビア	294,812,876	4.24
	ペルー	161,460,054	2.32
	ウルグアイ	11,853,883	0.17
	セルビア	20,986,527	0.30
	トルコ	63,956,724	0.92
	チェコ	303,791,136	4.37
	ハンガリー	196,364,409	2.82
	ポーランド	476,300,552	6.85
	ロシア	0	0.00
	ルーマニア	216,289,872	3.11
	マレーシア	673,690,729	9.70
	タイ	671,867,021	9.67
	インドネシア	656,570,074	9.45
	中国	665,288,276	9.57
	エジプト	102,832,103	1.48
	南アフリカ	669,023,098	9.63
	小計	6,724,675,725	96.83
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	219,945,645	3.16
合計（純資産総額）		6,944,621,370	100.00

（参考）新興国債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	23,563,457,242	98.06
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	464,194,873	1.93
合計（純資産総額）		24,027,652,115	100.00

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
社債券	アメリカ	7,240,058,995	97.78
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	164,217,203	2.21
合計（純資産総額）		7,404,276,198	100.00

（参考）J－REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	42,907,146,100	95.97
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,799,934,801	4.02
合計（純資産総額）		44,707,080,901	100.00

その他の資産の投資状況

※その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	1,344,020,000	3.00

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	40,272,372,333	75.44
	カナダ	1,009,370,470	1.89
	ドイツ	31,723,373	0.05
	イタリア	15,938,832	0.02
	フランス	946,976,430	1.77
	オランダ	103,771,577	0.19
	スペイン	228,142,958	0.42
	ベルギー	678,290,979	1.27
	アイルランド	63,364,089	0.11
	シンガポール	22,763,462	0.04
	イギリス	2,890,537,240	5.41
	オーストラリア	3,516,269,328	6.58
	ニュージーランド	182,963,732	0.34

	香港	828,888,787	1.55
	シンガポール	1,764,172,509	3.30
	韓国	130,101,209	0.24
	イスラエル	39,211,780	0.07
	小計	52,724,859,088	98.76
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	657,812,811	1.23
合計（純資産総額）		53,382,671,899	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	608,771,844	1.14

（参考）海外REITインデックス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（％）
投資証券	アメリカ	4,992,066,595	74.20
	カナダ	124,796,321	1.85
	ドイツ	3,965,422	0.05
	イタリア	2,063,094	0.03
	フランス	117,079,882	1.74
	オランダ	12,574,870	0.18
	スペイン	27,766,148	0.41
	ベルギー	84,297,589	1.25
	アイルランド	7,831,656	0.11
	シンガポール	3,259,953	0.04
	イギリス	358,834,456	5.33
	オーストラリア	435,842,315	6.47
	ニュージーランド	22,942,719	0.34
	香港	102,848,046	1.52
	シンガポール	217,227,572	3.22
	韓国	16,117,511	0.23
	イスラエル	5,655,545	0.08
	小計	6,535,169,694	97.14
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	191,878,356	2.85
合計（純資産総額）		6,727,048,050	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	134,728,192	2.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

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	81,521,212	1.3012	106,075,402	1.3037	106,279,204	62.03
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	2,926,322	4.7147	13,796,731	4.5345	13,269,407	7.74
3	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	4,628,769	2.5872	11,976,007	2.5639	11,867,700	6.92
4	日本	親投資信託受益証券	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	5,381,511	2.1922	11,797,349	2.1175	11,395,349	6.65
5	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	4,596,762	2.0332	9,346,268	2.0478	9,413,249	5.49
6	日本	親投資信託受益証券	海外REITインデックスマザーファンド	1,318,707	3.6710	4,840,974	3.3089	4,363,469	2.54
7	日本	親投資信託受益証券	J－REITインデックスマザーファンド	1,240,780	2.6916	3,339,684	2.7248	3,380,877	1.97
8	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	1,682,333	1.5701	2,641,432	1.5780	2,654,721	1.54
9	日本	親投資信託受益証券	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,742,372	1.5114	2,633,422	1.4988	2,611,467	1.52
10	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	1,444,356	1.1082	1,600,740	1.1055	1,596,735	0.93
11	日本	親投資信託受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	330,393	2.7661	913,901	2.6574	877,986	0.51
12	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	453,503	1.9258	873,368	1.9062	864,467	0.50

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.39
合 計	98.39

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

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	33,246,133	1.3012	43,259,869	1.3037	43,342,983	47.51
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	2,790,427	4.7154	13,157,980	4.5345	12,653,191	13.87

3	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマ ザーファンド	3,728,150	2.1920	8,172,105	2.1175	7,894,357	8.65
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	3,547,706	2.0353	7,220,809	2.0478	7,264,992	7.96
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	2,628,277	2.5848	6,793,571	2.5639	6,738,639	7.38
6	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マ ザーファンド	1,257,584	3.6763	4,623,257	3.3089	4,161,219	4.56
7	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マ ザーファンド	823,053	2.6927	2,216,235	2.7248	2,242,654	2.45
8	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,188,118	1.5832	1,881,029	1.5780	1,874,850	2.05
9	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	1,230,513	1.5170	1,866,689	1.4988	1,844,292	2.02
10	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	501,526	1.1091	556,244	1.1055	554,436	0.60
11	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファ ンド	174,959	2.7689	484,444	2.6574	464,936	0.50
12	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	240,869	1.9264	464,028	1.9062	459,144	0.50

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.11
合 計	98.11

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

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	161,697,910	1.3012	210,401,321	1.3037	210,805,565	37.02
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	28,868,113	4.7451	136,982,083	4.5345	130,902,458	22.99
3	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマ ザーファンド	25,862,746	2.1979	56,843,730	2.1175	54,764,364	9.61
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	23,287,101	2.0351	47,393,257	2.0478	47,687,325	8.37
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	13,003,600	2.5817	33,571,526	2.5639	33,339,930	5.85
6	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マ ザーファンド	8,672,872	3.6803	31,918,771	3.3089	28,697,666	5.04
7	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マ ザーファンド	6,100,758	2.6931	16,429,952	2.7248	16,623,345	2.91
8	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	9,204,314	1.5864	14,602,415	1.5780	14,524,407	2.55
9	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	7,638,276	1.5168	11,585,738	1.4988	11,448,248	2.01
10	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	4,653,516	1.1082	5,157,245	1.1055	5,144,461	0.90
11	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファ ンド	1,086,678	2.7729	3,013,250	2.6574	2,887,738	0.50
12	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,486,554	1.9258	2,862,809	1.9062	2,833,669	0.49

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.29
合 計	98.29

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

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	27,483,086	1.3012	35,760,992	1.3037	35,829,699	27.16
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド	7,842,265	4.7460	37,219,390	4.5345	35,560,750	26.95
3	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	6,896,515	2.1989	15,164,747	2.1175	14,603,370	11.07
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	6,938,070	2.0356	14,123,685	2.0478	14,207,779	10.77
5	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックスマザーファンド	2,600,492	3.6841	9,580,473	3.3089	8,604,767	6.52
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	2,742,849	2.5753	7,063,909	2.5639	7,032,390	5.33
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,966,788	1.5924	4,724,592	1.5780	4,681,591	3.54
8	日本	親投資信託 受益証券	J－REITインデックスマザーファンド	1,404,674	2.6928	3,782,507	2.7248	3,827,455	2.90
9	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,762,157	1.5166	2,672,488	1.4988	2,641,120	2.00
10	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	1,113,772	1.1081	1,234,266	1.1055	1,231,274	0.93
11	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	250,349	2.7742	694,519	2.6574	665,277	0.50
12	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	342,125	1.9261	658,977	1.9062	652,158	0.49

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.20
合 計	98.20

インデックス・ブレンド（タイプⅤ）

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド	35,799,824	4.7580	170,335,563	4.5345	162,334,301	36.89
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	30,586,954	2.0365	62,290,933	2.0478	62,635,964	14.23
3	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	25,989,786	2.2035	57,268,494	2.1175	55,033,371	12.50
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	27,652,495	1.3012	35,981,427	1.3037	36,050,557	8.19

5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	13,295,386	2.5755	34,242,931	2.5639	34,088,040	7.74
6	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マ ザーファンド	9,945,134	3.6919	36,716,441	3.3089	32,907,453	7.47
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	12,647,758	1.5980	20,211,637	1.5780	19,958,162	4.53
8	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マ ザーファンド	4,724,820	2.6935	12,726,329	2.7248	12,874,189	2.92
9	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	7,298,600	1.5171	11,072,707	1.4988	10,939,141	2.48
10	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファ ンド	829,678	2.7783	2,305,095	2.6574	2,204,786	0.50
11	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,135,018	1.9262	2,186,323	1.9062	2,163,571	0.49
12	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	1,896,500	1.1094	2,104,158	1.1055	2,096,580	0.47

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	98.48
合 計	98.48

（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	7,947,400	2,176.77	17,299,661,898	2,122.50	16,868,356,500	3.88
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,053,000	10,537.69	11,096,195,147	12,115.00	12,757,095,000	2.93
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	152,300	50,435.55	7,681,334,386	51,590.00	7,857,157,000	1.80
4	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	9,935,800	749.80	7,449,862,840	729.70	7,250,153,260	1.66
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	1,807,700	3,856.09	6,970,663,980	3,911.00	7,069,914,700	1.62
6	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	106,700	53,629.60	5,722,278,331	58,980.00	6,293,166,000	1.44
7	日本	株式	リクルートホール ディングス	サービ ス業	1,180,200	4,372.95	5,160,955,590	4,734.00	5,587,066,800	1.28
8	日本	株式	任天堂	その他製 品	94,900	56,409.77	5,353,287,615	57,420.00	5,449,158,000	1.25
9	日本	株式	日立製作所	電気機器	808,500	6,454.12	5,218,163,510	6,725.00	5,437,162,500	1.25
10	日本	株式	KDDI	情報・通 信業	1,202,500	4,348.63	5,229,231,829	4,486.00	5,394,415,000	1.24
11	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通 信業	989,100	4,911.52	4,857,986,568	5,379.00	5,320,368,900	1.22
12	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,137,300	4,128.77	4,695,650,121	4,433.00	5,041,650,900	1.15
13	日本	株式	信越化学工業	化学	268,200	17,856.41	4,789,089,162	18,335.00	4,917,447,000	1.13
14	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,321,200	3,772.30	4,983,970,996	3,703.00	4,892,403,600	1.12
15	日本	株式	HOYA	精密機器	324,500	12,524.40	4,064,170,287	13,810.00	4,481,345,000	1.03
16	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	1,099,800	3,921.08	4,312,403,784	3,922.00	4,313,415,600	0.99
17	日本	株式	第一三共	医薬品	1,253,300	3,288.52	4,121,502,116	3,419.00	4,285,032,700	0.98
18	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	1,260,500	3,346.94	4,218,817,870	3,187.00	4,017,213,500	0.92
19	日本	株式	ダイキン工業	機械	193,800	19,636.28	3,805,511,064	20,685.00	4,008,753,000	0.92

20	日本	株式	三井物産	卸売業	1,228,600	3,147.01	3,866,416,486	3,232.00	3,970,835,200	0.91
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	470,300	8,250.02	3,879,984,406	8,300.00	3,903,490,000	0.89
22	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,047,800	3,691.47	3,867,922,266	3,695.00	3,871,621,000	0.89
23	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,498,300	1,511.06	3,775,083,787	1,480.00	3,697,484,000	0.85
24	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	485,000	6,920.22	3,356,306,700	7,466.00	3,621,010,000	0.83
25	日本	株式	日本電産	電気機器	394,200	8,314.90	3,277,733,580	8,679.00	3,421,261,800	0.78
26	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	177,200	17,209.67	3,049,553,524	19,200.00	3,402,240,000	0.78
27	日本	株式	SMC	機械	49,200	61,669.27	3,034,128,363	66,610.00	3,277,212,000	0.75
28	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	586,000	5,703.21	3,342,081,060	5,410.00	3,170,260,000	0.72
29	日本	株式	ファナック	電気機器	147,500	19,503.28	2,876,734,537	21,105.00	3,112,987,500	0.71
30	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,032,000	1,583.82	3,218,322,240	1,519.00	3,086,608,000	0.71

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	0.35
		建設業	2.06
		食料品	3.13
		繊維製品	0.42
		パルプ・紙	0.17
		化学	6.20
		医薬品	5.03
		石油・石炭製品	0.51
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.69
		鉄鋼	0.82
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.58
		機械	5.24
		電気機器	17.79
		輸送用機器	7.73
		精密機器	2.65
		その他製品	2.34
		電気・ガス業	1.20
		陸運業	2.86
		海運業	0.66
		空運業	0.41
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.70
		卸売業	5.54
		小売業	3.97

	銀行業	5.01
	証券、商品先物取引業	0.71
	保険業	2.19
	その他金融業	1.12
	不動産業	1.92
	サービス業	5.24
	合　　計	97.11

（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	3,184,400	22,684.82	72,237,559,176	19,185.34	61,093,810,707	4.76
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,384,400	40,069.58	55,472,338,478	35,032.10	48,498,439,794	3.78
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	88,590	422,344.80	37,415,526,423	295,258.65	26,156,964,273	2.03
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	58,390	361,747.26	21,122,423,047	288,001.96	16,816,434,987	1.31
5	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	165,690	139,080.71	23,044,284,179	97,392.16	16,136,907,371	1.25
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	55,500	363,530.30	20,175,932,011	289,239.19	16,052,775,367	1.25
7	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	182,810	66,652.03	12,184,658,758	65,016.57	11,885,679,728	0.92
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	511,000	23,017.86	11,762,129,489	23,217.54	11,864,167,488	0.92
9	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	485,240	35,136.63	17,049,699,231	24,117.58	11,702,816,023	0.91
10	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	459,300	29,105.02	13,367,939,760	25,017.61	11,490,591,626	0.89
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	253,000	45,683.45	11,557,915,354	40,913.09	10,351,012,554	0.80
12	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	821,700	10,776.77	8,855,276,143	12,512.01	10,281,121,822	0.80
13	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	573,600	17,958.84	10,301,192,715	16,830.12	9,653,760,675	0.75
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	469,700	19,785.09	9,293,058,381	19,067.39	8,955,953,647	0.69
15	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	324,100	28,640.98	9,282,543,275	27,293.34	8,845,773,050	0.68

16	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	374,200	21,243.98	7,949,498,666	22,857.27	8,553,193,727	0.66
17	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	546,400	16,092.34	8,792,859,984	15,608.31	8,528,381,677	0.66
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	202,700	39,520.96	8,010,900,432	39,547.65	8,016,309,993	0.62
19	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	170,300	46,383.43	7,899,098,288	45,870.97	7,811,826,838	0.60
20	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	1,089,400	6,717.27	7,317,802,707	6,911.80	7,529,716,118	0.58
21	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,430,000	5,488.26	7,848,216,275	4,746.33	6,787,257,906	0.52
22	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	796,500	7,985.64	6,360,563,824	8,292.62	6,605,074,060	0.51
23	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	343,100	20,944.52	7,186,065,451	19,231.50	6,598,327,650	0.51
24	アメリカ	株式	ELI LILLY & CO.	医薬品	157,800	37,208.20	5,871,455,048	41,473.37	6,544,497,912	0.51
25	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	80,230	85,308.74	6,844,320,230	76,608.33	6,146,286,797	0.47
26	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	136,400	49,339.65	6,729,928,272	44,131.91	6,019,593,206	0.46
27	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	79,890	80,696.77	6,446,865,395	74,782.32	5,974,360,248	0.46
28	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	268,400	21,548.35	5,783,579,693	22,022.63	5,910,874,348	0.46
29	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	490,300	10,596.41	5,195,420,776	11,933.78	5,851,135,668	0.45
30	イギリス	株式	SHELL PLC-NEW	石油・ガス・消耗燃料	1,479,000	3,422.73	5,062,230,574	3,840.18	5,679,629,770	0.44

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.70
		メディア	0.89
		娯楽	1.07
		不動産管理・開発	0.37
		エネルギー設備・サービス	0.27
		石油・ガス・消耗燃料	5.17
		化学	2.20
		建設資材	0.24
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.70
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	1.50
		建設関連製品	0.52
		建設・土木	0.20
		電気設備	0.77
		コングロマリット	1.01
		機械	1.62
		商社・流通業	0.34
		商業サービス・用品	0.46

航空貨物・物流サービス	0.57
旅客航空輸送業	0.05
海運業	0.08
陸運・鉄道	1.03
運送インフラ	0.14
自動車部品	0.19
自動車	1.89
家庭用耐久財	0.29
レジャー用品	0.02
繊維・アパレル・贅沢品	1.26
ホテル・レストラン・レジャー	1.74
販売	0.09
インターネット販売・通信販売	2.35
複合小売り	0.47
専門小売り	1.58
食品・生活必需品小売り	1.45
飲料	1.78
食品	1.64
タバコ	0.77
家庭用品	1.16
パーソナル用品	0.52
ヘルスケア機器・用品	2.33
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.37
バイオテクノロジー	1.85
医薬品	5.46
銀行	6.04
各種金融サービス	1.05
保険	3.15
情報技術サービス	3.71
ソフトウェア	6.93
通信機器	0.63
コンピュータ・周辺機器	5.04
電子装置・機器・部品	0.54
半導体・半導体製造装置	4.67
各種電気通信サービス	1.31
無線通信サービス	0.29
電力	1.93
ガス	0.14
総合公益事業	0.95
水道	0.11
消費者金融	0.45
資本市場	3.14

		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	0.09
		ヘルスケア・テクノロジー	0.10
		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.46
		専門サービス	0.67
投資証券	—	—	2.44
合 計			98.72

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

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	235,670	19,501.06	4,595,815,437	19,185.34	4,521,410,115	4.53
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	102,470	33,932.90	3,477,104,635	35,032.10	3,589,739,328	3.60
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	6,560	278,960.21	1,829,979,016	295,258.65	1,936,896,779	1.94
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	4,325	288,593.61	1,248,167,376	288,001.96	1,245,608,517	1.25
5	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	12,275	100,947.44	1,239,129,944	97,392.16	1,195,488,792	1.20
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4,112	290,045.04	1,192,665,240	289,239.19	1,189,351,573	1.19
7	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	13,553	62,367.75	845,270,177	65,016.57	881,169,615	0.88
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	37,880	22,734.91	861,198,673	23,217.54	879,480,752	0.88
9	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	35,980	21,749.07	782,531,874	24,117.58	867,750,640	0.87
10	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	34,050	25,160.00	856,698,230	25,017.61	851,849,869	0.85
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	18,760	40,123.45	752,716,036	40,913.09	767,529,627	0.77
12	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	60,950	10,830.20	660,100,902	12,512.01	762,607,247	0.76
13	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	42,550	15,615.27	664,429,749	16,830.12	716,121,891	0.71
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	34,840	19,948.47	695,005,040	19,067.39	664,307,909	0.66
15	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	24,050	24,746.21	595,146,571	27,293.34	656,404,942	0.65
16	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	27,770	20,421.97	567,118,383	22,857.27	634,746,632	0.63
17	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	40,540	16,063.47	651,213,444	15,608.31	632,760,968	0.63
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	15,040	38,065.23	572,501,095	39,547.65	594,796,755	0.59
19	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	12,640	42,043.80	531,433,720	45,870.97	579,809,109	0.58

20	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	80,880	6,238.32	504,555,456	6,911.80	559,026,473	0.56
21	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	106,150	4,661.13	494,779,745	4,746.33	503,823,375	0.50
22	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	59,140	8,281.82	489,786,888	8,292.62	490,425,712	0.49
23	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	25,480	19,357.55	493,230,431	19,231.50	490,018,620	0.49
24	アメリカ	株式	ELI LILLY & CO.	医薬品	11,720	37,072.93	434,494,818	41,473.37	486,067,906	0.48
25	オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	5,962	67,061.71	399,821,961	76,608.33	456,738,899	0.45
26	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	10,130	46,194.07	467,946,002	44,131.91	447,056,299	0.44
27	アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	5,935	72,231.08	428,691,516	74,782.32	443,833,121	0.44
28	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	19,930	22,013.01	438,719,368	22,022.63	438,911,050	0.44
29	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	36,430	11,236.78	409,356,163	11,933.78	434,747,853	0.43
30	イギリス	株式	SHELL PLC-NEW	石油・ガス・消耗燃料	111,100	3,599.99	399,959,468	3,840.18	426,644,265	0.42

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.53
		メディア	0.86
		娯楽	1.00
		不動産管理・開発	0.35
		エネルギー設備・サービス	0.26
		石油・ガス・消耗燃料	4.98
		化学	2.09
		建設資材	0.23
		容器・包装	0.27
		金属・鉱業	1.62
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	1.43
		建設関連製品	0.49
		建設・土木	0.20
		電気設備	0.74
		コングロマリット	0.97
		機械	1.54
		商社・流通業	0.32
		商業サービス・用品	0.43
		航空貨物・物流サービス	0.55
		旅客航空輸送業	0.05
		海運業	0.08
		陸運・鉄道	0.96
		運送インフラ	0.13
		自動車部品	0.19

		自動車	1.79
		家庭用耐久財	0.28
		レジャー用品	0.02
		繊維・アパレル・贅沢品	1.20
		ホテル・レストラン・レジャー	1.63
		販売	0.09
		インターネット販売・通信販売	2.23
		複合小売り	0.45
		専門小売り	1.52
		食品・生活必需品小売り	1.39
		飲料	1.70
		食品	1.57
		タバコ	0.73
		家庭用品	1.10
		パーソナル用品	0.50
		ヘルスケア機器・用品	2.17
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.26
		バイオテクノロジー	1.74
		医薬品	5.22
		銀行	5.72
		各種金融サービス	1.01
		保険	3.03
		情報技術サービス	3.53
		ソフトウェア	6.59
		通信機器	0.61
		コンピュータ・周辺機器	4.80
		電子装置・機器・部品	0.51
		半導体・半導体製造装置	4.46
		各種電気通信サービス	1.24
		無線通信サービス	0.28
		電力	1.84
		ガス	0.14
		総合公益事業	0.92
		水道	0.10
		消費者金融	0.45
		資本市場	2.97
		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	0.09
		ヘルスケア・テクノロジー	0.10
		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.39
		専門サービス	0.64
投資証券	—	—	2.31

合 計	94.04

（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	1,962,000	2,302.01	4,516,549,575	2,421.07	4,750,152,485	6.46
2	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	4,572,000	603.43	2,758,893,716	646.49	2,955,793,085	4.02
3	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	497,200	5,691.68	2,829,903,487	5,715.50	2,841,746,600	3.86
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュー タ・周辺機 器	379,650	6,836.49	2,595,474,244	7,000.18	2,657,618,337	3.61
5	香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インター ネット販 売・通信販 売	1,206,780	1,475.43	1,780,528,134	1,549.71	1,870,167,481	2.54
6	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	242,500	4,194.39	1,017,141,645	4,423.56	1,072,715,240	1.46
7	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インター ネット販 売・通信販 売	325,300	2,566.42	834,857,792	2,859.38	930,157,290	1.26
8	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	323,652	2,062.75	667,616,197	2,336.75	756,294,201	1.02
9	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	7,644,000	89.81	686,541,154	95.20	727,738,612	0.99
10	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	267,400	2,604.79	696,522,184	2,534.48	677,722,091	0.92
11	香港	株式	JD.COM, INC.	インター ネット販 売・通信販 売	159,417	3,698.45	589,597,016	3,638.32	580,010,697	0.78
12	サウジア ラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	156,320	3,854.29	602,503,864	3,429.84	536,153,527	0.72
13	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵 当・不動産 金融	135,600	3,599.37	488,075,657	3,929.63	532,858,506	0.72

14	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	404,900	1,179.18	477,450,387	1,242.51	503,092,299	0.68
15	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	997,649	460.31	459,232,200	489.08	487,934,213	0.66
16	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	42,980	11,115.50	477,744,190	11,063.80	475,522,124	0.64
17	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半 導体製造装 置	119,538	3,598.41	430,147,847	3,886.11	464,538,511	0.63
18	香港	株式	NETEASE, INC.	娯楽	165,950	2,307.42	382,917,842	2,727.10	452,563,904	0.61
19	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	511,000	794.28	405,880,743	808.33	413,059,185	0.56
20	サウジア ラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	172,100	2,714.43	467,154,952	2,392.67	411,779,712	0.56
21	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュー タ・周辺機 器	64,800	6,110.94	395,988,912	6,297.06	408,049,488	0.55
22	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	72,247	5,718.86	413,170,912	5,602.91	404,793,800	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	22,170	13,669.75	303,058,362	17,832.72	395,351,600	0.53
24	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,480,000	74.79	335,078,457	76.42	342,381,312	0.46
25	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	6,440,000	49.63	319,623,033	50.62	326,012,120	0.44
26	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信 サービス	2,244,000	123.79	277,790,199	141.07	316,572,120	0.43
27	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガ ス・消耗燃 料	383,000	867.28	332,168,712	808.76	309,755,587	0.42
28	韓国	株式	NAVER CORP	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	10,450	28,396.01	296,738,315	29,055.40	303,628,930	0.41
29	インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA	銀行	4,380,000	66.88	292,934,400	66.66	291,970,800	0.39
30	香港	株式	BYD CO LTD-H	自動車	65,000	3,733.03	242,647,470	4,490.75	291,898,750	0.39

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	5.51
		メディア	0.19
		娯楽	1.06
		不動産管理・開発	1.77
		エネルギー設備・サービス	0.05
		石油・ガス・消耗燃料	4.80
		化学	3.05
		建設資材	0.91
		容器・包装	0.07
		金属・鉱業	3.97
		紙製品・林産品	0.18
		航空宇宙・防衛	0.12
		建設関連製品	0.02
		建設・土木	0.45
		電気設備	0.58
		コングロマリット	1.06
		機械	0.31
		商社・流通業	0.13
		商業サービス・用品	0.07
		航空貨物・物流サービス	0.27
		旅客航空輸送業	0.21
		海運業	0.63
		陸運・鉄道	0.21
		運送インフラ	0.68
		自動車部品	0.41
		自動車	2.75
		家庭用耐久財	0.30
		レジャー用品	0.07
		繊維・アパレル・贅沢品	1.01
		ホテル・レストラン・レジャー	0.88
		インターネット販売・通信販売	5.56
		複合小売り	0.25
		専門小売り	0.59
		食品・生活必需品小売り	1.16
		飲料	0.93
		食品	1.63

		タバコ	0.33
		家庭用品	0.06
		パーソナル用品	0.72
		ヘルスケア機器・用品	0.11
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.63
		バイオテクノロジー	0.49
		医薬品	0.95
		銀行	14.84
		各種金融サービス	0.82
		保険	2.48
		情報技術サービス	2.18
		ソフトウェア	0.14
		通信機器	0.09
		コンピュータ・周辺機器	5.29
		電子装置・機器・部品	2.54
		半導体・半導体製造装置	9.17
		各種電気通信サービス	1.42
		無線通信サービス	1.72
		電力	0.98
		ガス	0.55
		総合公益事業	0.02
		水道	0.13
		貯蓄・抵当・不動産金融	0.72
		消費者金融	0.58
		資本市場	0.71
		各種消費者サービス	0.04
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.75
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.76
		その他の業種	0.00
投資信託受益証券	—	—	4.02
投資証券	—	—	0.11
合 計			95.50

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

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	ALBEMARLE CORP	化学	43,840	26,642.96	1,168,027,529	34,734.65	1,522,767,196	2.12
2	アメリカ	株式	AMCOR PLC	容器・包装	759,500	1,535.22	1,166,006,028	1,706.47	1,296,067,838	1.81
3	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	103,320	11,178.50	1,154,963,451	12,512.01	1,292,741,276	1.80
4	アメリカ	株式	SHERWIN-WILLIAMS	化学	35,910	32,924.87	1,182,332,217	35,430.83	1,272,321,231	1.77
5	アメリカ	株式	EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	航空貨物・物流サービス	88,460	12,813.63	1,133,494,259	14,186.43	1,254,932,173	1.75
6	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	54,650	21,123.47	1,154,398,160	22,857.27	1,249,150,286	1.74
7	アメリカ	株式	LINDE PLC	化学	28,400	41,433.60	1,176,714,500	42,261.86	1,200,236,889	1.67
8	アメリカ	株式	NEXTERA ENERGY INC	電力	118,940	9,668.46	1,149,966,932	9,927.30	1,180,753,098	1.65
9	アメリカ	株式	FRANKLIN RESOURCES INC	資本市場	333,300	3,348.35	1,116,007,900	3,532.18	1,177,277,427	1.64
10	アメリカ	株式	CONSOLIDATED EDISON INC	総合公益事業	91,150	12,567.62	1,145,539,439	12,895.36	1,175,412,228	1.64
11	アメリカ	株式	GENUINE PARTS CO	販売	65,810	17,650.59	1,161,585,653	17,844.26	1,174,331,264	1.64
12	アメリカ	株式	AIR PRODUCTS	化学	36,210	31,777.66	1,150,669,404	32,135.83	1,163,638,640	1.62
13	アメリカ	株式	CHUBB LTD	保険	42,680	27,083.10	1,155,906,808	27,038.20	1,153,990,671	1.61
14	アメリカ	株式	ILLINOIS TOOL WORKS INC	機械	43,250	26,473.42	1,144,975,541	26,506.13	1,146,390,356	1.60
15	アメリカ	株式	LOWES COS INC	専門小売り	44,630	26,049.98	1,162,610,778	25,594.56	1,142,285,315	1.59
16	アメリカ	株式	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	情報技術サービス	63,620	17,887.72	1,138,016,794	17,855.80	1,135,986,422	1.58
17	アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	ホテル・レストラン・レジャー	35,160	32,624.88	1,147,090,839	32,292.25	1,135,395,605	1.58
18	アメリカ	株式	BECTON, DICKINSON	ヘルスケア機器・用品	34,490	33,857.97	1,167,761,633	32,880.73	1,134,056,605	1.58
19	アメリカ	株式	AUTOMATIC DATA PROCESS	情報技術サービス	39,350	29,383.40	1,156,237,141	28,803.65	1,133,423,966	1.58
20	アメリカ	株式	CATERPILLAR INC DEL	機械	40,660	29,631.70	1,204,825,090	27,839.51	1,131,954,859	1.58
21	アメリカ	株式	3M CORP	コングロマリット	58,960	19,300.15	1,137,936,959	19,168.67	1,130,185,202	1.58
22	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	51,090	22,376.27	1,143,203,852	22,022.63	1,125,136,254	1.57
23	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	48,450	23,470.38	1,137,140,017	23,217.54	1,124,890,244	1.57
24	アメリカ	株式	BROWN-FORMAN CORP-CL B	飲料	131,290	8,794.31	1,154,605,347	8,533.65	1,120,383,906	1.56
25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	134,800	8,473.39	1,142,213,466	8,292.62	1,117,845,553	1.56
26	アメリカ	株式	ATMOS ENERGY CORP	ガス	74,100	15,479.37	1,147,021,585	15,082.62	1,117,622,468	1.56
27	アメリカ	株式	CLOROX CO	家庭用品	58,380	18,921.97	1,104,664,804	19,066.10	1,113,079,449	1.55
28	アメリカ	株式	GRAINGER(W.W.) INC	商社・流通業	17,610	65,353.38	1,150,873,116	62,872.90	1,107,191,802	1.54
29	アメリカ	株式	PPG INDUSTRIES	化学	66,210	16,916.56	1,120,045,552	16,671.14	1,103,796,597	1.54
30	アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	コングロマリット	19,370	59,890.00	1,160,069,325	56,909.85	1,102,343,888	1.54

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	石油・ガス・消耗燃料	3.55
		化学	10.25

		容器・包装	1.81
		金属・鉱業	1.34
		航空宇宙・防衛	1.49
		建設関連製品	1.49
		電気設備	1.48
		コングロマリット	3.12
		機械	7.51
		商社・流通業	1.54
		商業サービス・用品	1.53
		航空貨物・物流サービス	1.75
		繊維・アパレル・贅沢品	1.44
		ホテル・レストラン・レジャー	1.58
		販売	1.64
		複合小売り	1.09
		専門小売り	1.59
		食品・生活必需品小売り	4.30
		飲料	4.70
		食品	4.38
		家庭用品	7.44
		ヘルスケア機器・用品	4.57
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.47
		バイオテクノロジー	1.52
		医薬品	1.57
		保険	5.99
		情報技術サービス	3.17
		電力	1.65
		ガス	1.56
		総合公益事業	1.64
		資本市場	4.67
		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.44
投資信託受益証券	—	—	0.78
投資証券	—	—	4.28
合 計			99.48

（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365回	12,000,000,000	98.90	11,868,525,000	98.83	11,859,600,000	0.1	2031/12/20	1.39
2	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第360回	10,900,000,000	99.45	10,840,704,000	99.30	10,824,136,000	0.1	2030/9/20	1.27

3	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第359回	10,600,000,000	99.55	10,552,618,000	99.40	10,536,824,000	0.1	2030/6/20	1.24
4	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第363回	10,450,000,000	99.13	10,360,025,500	98.97	10,343,201,000	0.1	2031/6/20	1.21
5	日本	国債証券	国庫債券 利付（5年）第139回	10,200,000,000	100.29	10,229,625,000	100.31	10,232,130,000	0.1	2024/3/20	1.20
6	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第350回	10,150,000,000	100.20	10,171,112,000	100.28	10,179,333,500	0.1	2028/3/20	1.20
7	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第347回	10,000,000,000	100.37	10,037,364,000	100.42	10,042,900,000	0.1	2027/6/20	1.18
8	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第364回	10,150,000,000	99.00	10,049,361,000	98.90	10,038,857,500	0.1	2031/9/20	1.18
9	日本	国債証券	国庫債券 利付（5年）第141回	9,600,000,000	100.33	9,631,968,000	100.38	9,636,480,000	0.1	2024/9/20	1.13
10	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第343回	9,500,000,000	100.40	9,538,000,000	100.50	9,548,165,000	0.1	2026/6/20	1.12
11	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第338回	9,000,000,000	101.29	9,116,280,000	101.27	9,114,750,000	0.4	2025/3/20	1.07
12	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第362回	8,500,000,000	99.25	8,436,250,000	99.09	8,422,820,000	0.1	2031/3/20	0.99
13	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第361回	8,400,000,000	99.30	8,341,640,000	99.20	8,332,800,000	0.1	2030/12/20	0.98
14	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第346回	7,600,000,000	100.37	7,628,172,000	100.48	7,636,480,000	0.1	2027/3/20	0.90
15	日本	国債証券	国庫債券 利付（5年）第148回	7,300,000,000	100.00	7,300,000,000	100.12	7,308,833,000	0.005	2026/6/20	0.86
16	日本	国債証券	国庫債券 利付（5年）第138回	7,100,000,000	100.25	7,118,318,000	100.27	7,119,809,000	0.1	2023/12/20	0.83
17	日本	国債証券	国庫債券 利付（5年）第149回	7,100,000,000	99.95	7,096,805,000	100.10	7,107,597,000	0.005	2026/9/20	0.83
18	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第345回	7,000,000,000	100.35	7,024,710,000	100.50	7,035,070,000	0.1	2026/12/20	0.82
19	日本	国債証券	国庫債券 利付（2年）第427回	6,800,000,000	100.09	6,806,324,000	100.11	6,807,480,000	0.005	2023/8/1	0.80
20	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第334回	6,600,000,000	101.42	6,693,786,000	101.37	6,690,816,000	0.6	2024/6/20	0.78
21	日本	国債証券	国庫債券 利付（5年）第137回	6,600,000,000	100.23	6,615,510,000	100.24	6,615,906,000	0.1	2023/9/20	0.78
22	日本	国債証券	国庫債券 利付（20年）第174回	6,970,000,000	95.35	6,646,218,000	94.90	6,614,599,700	0.4	2040/9/20	0.78
23	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第344回	6,400,000,000	100.37	6,424,256,000	100.51	6,433,024,000	0.1	2026/9/20	0.75
24	日本	国債証券	国庫債券 利付（10年）第352回	6,400,000,000	100.09	6,406,144,000	100.12	6,408,000,000	0.1	2028/9/20	0.75
25	日本	国債証券	国庫債券 利付（5年）第143回	6,070,000,000	100.40	6,094,280,000	100.43	6,096,343,800	0.1	2025/3/20	0.71

26	日本	国債証券	国庫債券 利付（１０年）第３５１回	6,000,000,000	100.15	6,009,240,000	100.21	6,012,600,000	0.1	2028/6/20	0.70
27	日本	国債証券	国庫債券 利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	101.11	5,966,021,000	101.05	5,962,363,000	0.6	2023/12/20	0.70
28	日本	国債証券	国庫債券 利付（４０年）第１３回	7,020,000,000	86.24	6,054,048,000	82.98	5,825,406,600	0.5	2060/3/20	0.68
29	日本	国債証券	国庫債券 利付（１０年）第３４８回	5,800,000,000	100.30	5,817,400,000	100.39	5,823,026,000	0.1	2027/9/20	0.68
30	日本	国債証券	国庫債券 利付（２０年）第１７６回	6,020,000,000	96.97	5,837,895,000	96.03	5,781,547,800	0.5	2041/3/20	0.68

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.57
地方債証券	6.65
特殊債券	7.58
社債券	4.88
合 計	99.71

（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	151,700,000	15,082.70	22,880,461,801	15,427.26	23,403,167,903	5.375	2031/2/15	3.59
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	129,400,000	14,468.69	18,722,495,869	14,695.06	19,015,420,489	5.25	2028/11/15	2.92
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	81,000,000	12,089.80	9,792,739,380	12,226.52	9,903,486,164	1.625	2026/11/30	1.52
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	66,600,000	14,231.31	9,478,052,460	14,308.43	9,529,418,381	6	2026/2/15	1.46
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	72,000,000	12,787.44	9,206,960,313	12,837.27	9,242,838,907	2.5	2024/5/15	1.42
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	67,500,000	12,448.38	8,402,663,039	12,599.13	8,504,417,098	2.375	2027/5/15	1.30
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,100,000	15,722.75	7,562,643,986	16,041.27	7,715,853,241	6.25	2030/5/15	1.18
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	57,850,000	12,646.71	7,316,123,986	12,717.33	7,356,975,796	2.25	2024/11/15	1.13
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	56,700,000	12,717.81	7,211,003,153	12,781.43	7,247,074,029	2.375	2024/8/15	1.11
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,600,000	12,687.28	6,800,382,517	12,887.10	6,907,490,382	2.875	2028/5/15	1.06
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	60,050,000	10,733.58	6,445,515,352	11,248.42	6,754,679,128	2.375	2051/5/15	1.03
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,100,000	12,539.53	6,282,308,549	12,635.19	6,330,232,947	2.25	2025/11/15	0.97
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,900,000	12,756.89	5,855,414,805	12,810.73	5,880,126,421	2.25	2023/12/31	0.90

14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000	18,564.71	5,810,757,054	18,620.57	5,828,241,029	4.75	2035/4/25	0.89
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,000,000	12,825.13	5,771,311,770	12,902.63	5,806,185,242	2.875	2025/4/30	0.89
16	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	35,000,000	16,233.63	5,681,773,440	16,374.15	5,730,953,760	5.25	2029/11/1	0.88
17	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	33,800,000	16,785.64	5,673,546,413	16,883.86	5,706,746,573	6.5	2027/11/1	0.87
18	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000	16,411.08	5,686,441,667	16,405.52	5,684,513,218	5.9	2026/7/30	0.87
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,700,000	10,834.74	5,384,868,921	11,298.50	5,615,357,606	2.5	2046/2/15	0.86
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,600,000	12,636.19	5,509,381,815	12,699.80	5,537,113,587	2.125	2024/9/30	0.85
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	12,869.07	5,482,227,547	12,915.15	5,501,855,970	2.75	2023/11/15	0.84
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,100,000	12,710.81	5,478,362,974	12,758.39	5,498,869,374	2.125	2024/3/31	0.84
23	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	30,700,000	17,721.64	5,440,545,694	17,716.56	5,438,986,897	5.5	2029/4/25	0.83
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	12,550.55	5,308,885,353	12,668.24	5,358,669,464	2.375	2026/4/30	0.82
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,400,000	15,178.11	5,221,272,619	15,179.08	5,221,605,447	3.5	2026/4/25	0.80
26	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	27,900,000	18,374.42	5,126,465,636	18,451.57	5,147,989,258	5.75	2032/7/30	0.79
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,900,000	12,063.75	5,054,715,309	12,192.47	5,108,645,344	1.5	2026/8/15	0.78
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,950,000	12,122.35	4,842,881,024	12,610.65	5,037,957,116	3.125	2044/8/15	0.77
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,700,000	10,843.76	4,738,723,453	11,296.50	4,936,572,077	2.5	2045/2/15	0.75
30	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	32,600,000	15,068.89	4,912,460,985	15,091.60	4,919,864,208	5	2025/3/1	0.75

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.07
合 計	99.07

（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	5,000,000	14,620.44	731,022,329	13,073.41	653,670,672	3.125	2028/11/15	0.80
2	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	4,500,000	13,791.94	620,637,730	13,707.05	616,817,301	0	2024/2/25	0.76
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,500,000	12,130.36	667,170,274	10,840.75	596,241,624	0.625	2030/8/15	0.73
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	12,661.11	633,055,588	11,850.91	592,545,529	0.875	2026/9/30	0.73
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	13,860.70	554,428,093	12,859.56	514,382,520	2.75	2025/6/30	0.63

6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	13,058.63	522,345,559	12,758.39	510,335,904	2.125	2024/3/31	0.63
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	13,355.99	534,239,644	12,717.33	508,693,227	2.25	2024/11/15	0.62
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	13,400.44	536,017,957	12,697.79	507,911,915	2	2024/6/30	0.62
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	13,345.85	533,834,388	12,245.05	489,802,253	1.625	2026/9/30	0.60
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	13,187.09	527,483,941	12,128.86	485,154,640	1.375	2026/8/31	0.59
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	13,879.23	527,410,836	12,599.13	478,767,185	2.375	2027/5/15	0.59
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,991.27	519,651,131	11,754.75	470,190,123	1.25	2028/4/30	0.58
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	13,559.70	474,589,809	12,938.19	452,836,707	2.875	2023/11/30	0.55
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	13,463.05	471,206,797	12,917.15	452,100,513	2.75	2023/8/31	0.55
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	14,243.25	498,514,031	12,887.10	451,048,812	2.875	2028/5/15	0.55
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,030,000	13,637.33	549,584,646	10,743.59	432,966,998	2.25	2046/8/15	0.53
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	11,874.95	451,248,216	11,365.61	431,893,427	1.375	2031/11/15	0.53
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	14,195.41	482,643,980	12,700.80	431,827,306	2.625	2029/2/15	0.53
19	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,290,000	22,362.80	512,108,148	18,620.57	426,411,245	4.75	2035/4/25	0.52
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	18,064.58	505,808,456	14,904.41	417,323,550	4.25	2040/11/15	0.51
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	13,262.72	464,195,311	11,897.48	416,412,079	1.625	2029/8/15	0.51
22	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,720,000	17,053.10	463,844,422	15,064.38	409,751,316	2.5	2030/5/25	0.50
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	13,805.61	441,779,577	12,504.48	400,143,410	2.25	2027/8/15	0.49
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	13,979.39	447,340,691	12,504.48	400,143,410	2.375	2029/5/15	0.49
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	13,529.22	419,405,938	12,907.14	400,121,394	2.875	2025/5/31	0.49
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	14,367.03	445,377,987	12,881.59	399,329,592	2.875	2028/8/15	0.49
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	14,033.48	421,004,575	12,953.21	388,596,497	3	2025/9/30	0.47
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	12,798.96	396,767,861	12,519.00	388,089,161	0.125	2023/8/15	0.47
29	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000	1,928.60	385,721,415	1,933.52	386,705,775	2.47	2024/9/2	0.47
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	14,282.39	485,601,353	11,293.49	383,978,945	2.5	2046/5/15	0.47

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.68
合 計	98.68

（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	9,300,000	1,933.91	179,854,242	1,933.52	179,818,185	2.47	2024/9/2	2.58
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000	1,944.47	175,003,171	1,949.16	175,424,975	2.91	2028/10/14	2.52
3	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	7,100,000	2,302.00	163,442,197	2,296.09	163,022,555	—	2023/7/1	2.34
4	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000	1,941.31	151,422,473	1,939.40	151,273,272	2.69	2026/8/12	2.17
5	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	480,000	2,680.58	128,674,866	2,751.68	132,081,003	10	2023/1/1	1.90

6	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	481,000	2,649.03	127,421,892	2,645.08	127,228,825	10	2025/1/1	1.83
7	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,200,000	769.85	124,716,198	753.08	121,999,583	8	2030/1/31	1.75
8	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	1,954.54	117,272,710	1,955.51	117,331,025	3.02	2031/5/27	1.68
9	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000	2,562.09	115,294,111	2,343.68	105,465,672	2.75	2029/10/25	1.51
10	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,500,000	608.36	106,464,236	591.69	103,546,680	5.75	2026/3/5	1.49
11	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	3,025.60	105,896,098	2,909.89	101,846,186	4	2023/10/25	1.46
12	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000	691.06	97,439,761	670.18	94,495,893	10	2024/12/5	1.36
13	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000	713.58	99,187,625	676.64	94,054,233	8.75	2048/2/28	1.35
14	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000	2,803.10	86,896,202	2,741.80	84,996,017	2.25	2024/10/25	1.22
15	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000	652.93	86,840,746	623.80	82,966,259	7.75	2031/5/29	1.19
16	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,500,000	921.03	78,287,550	898.36	76,360,627	10.5	2026/12/21	1.09
17	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,950,000	2,755.34	81,282,708	2,472.88	72,950,094	2.5	2027/7/25	1.05
18	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000	2,955.78	73,894,595	2,909.00	72,725,122	3.733	2028/6/15	1.04
19	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	14,000,000	527.25	73,815,077	517.73	72,483,244	0.45	2023/10/25	1.04
20	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000	763.88	75,624,761	730.53	72,322,665	8.875	2035/2/28	1.04
21	ブラジル	国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	3,500,000	2,077.39	72,708,919	2,042.10	71,473,618	—	2024/7/1	1.02
22	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000	3,007.99	72,191,988	2,952.64	70,863,464	3.9	2026/11/30	1.02
23	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000	682.68	73,729,835	651.39	70,350,626	8.5	2029/5/31	1.01
24	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,000,000	724.04	65,164,061	731.27	65,814,992	8.25	2032/3/31	0.94
25	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000	3,022.39	66,492,664	2,968.37	65,304,240	3.955	2025/9/15	0.94
26	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,600,000	637.66	67,592,566	602.93	63,911,390	8	2047/11/7	0.92
27	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	250,000	2,551.95	63,802,295	2,511.30	62,782,572	10	2029/1/1	0.90
28	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,500,000	657.29	62,443,152	646.16	61,385,367	8	2023/12/7	0.88
29	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000	2,686.13	61,781,114	2,611.84	60,072,535	2.632	2031/4/15	0.86
30	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,790,000,000	3.59	64,402,219	3.29	59,058,654	9.85	2027/6/28	0.85

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.83
合 計	96.83

（参考）新興国債券マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	3,400,000	10,982.34	373,399,574	11,421.20	388,320,910	2.783	2031/1/23	1.61
2	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	2,200,000	13,061.91	287,362,227	13,953.96	306,987,255	4.817	2049/3/14	1.27
3	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,800,000	9,665.11	270,623,104	10,648.99	298,171,843	5.75	2049/9/30	1.24
4	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	2,600,000	10,626.20	276,281,242	11,114.11	288,967,080	4.5	2056/4/1	1.20
5	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,000,000	12,363.51	247,270,230	12,588.81	251,776,234	4.625	2028/1/13	1.04
6	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000	9,062.15	226,553,993	9,929.73	248,243,407	5	2045/6/15	1.03
7	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000	12,486.05	224,748,924	12,964.72	233,365,021	4.5	2029/4/22	0.97
8	アメリカ	国債証券	HUNGARY	1,750,000	13,225.69	231,449,661	13,190.23	230,829,060	5.75	2023/11/22	0.96
9	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	6,537,686	3,576.28	233,806,594	3,513.59	229,707,811	1.125	2035/7/9	0.95
10	アメリカ	国債証券	PANAMA GLOBAL	1,550,000	14,085.25	218,321,404	14,687.09	227,649,997	6.7	2036/1/26	0.94
11	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	1,700,000	12,957.75	220,281,858	13,366.86	227,236,738	4	2029/3/14	0.94
12	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,600,000	13,684.82	218,957,181	14,155.16	226,482,575	5.95	2046/1/8	0.94
13	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	1,500,000	13,556.75	203,351,381	14,467.61	217,014,208	5.103	2048/4/23	0.90
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	4,786,159	4,579.27	219,171,458	4,529.65	216,796,696	2	2038/1/9	0.90
15	アメリカ	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,600,000	12,624.83	201,997,419	13,022.28	208,356,635	3.625	2028/3/4	0.86
16	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,100,000	9,317.79	195,673,590	9,879.22	207,463,653	4.75	2050/1/14	0.86
17	アメリカ	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,600,000	12,205.13	195,282,087	12,700.80	203,212,850	3.125	2030/4/16	0.84
18	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000	10,281.85	195,355,243	10,400.01	197,600,200	5.95	2031/1/15	0.82
19	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,150,000	17,010.10	195,616,166	17,005.94	195,568,322	9.5	2030/2/2	0.81
20	アメリカ	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,400,000	13,256.09	185,585,308	13,922.88	194,920,432	5.25	2050/1/16	0.81
21	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNL BOND	1,500,000	12,810.95	192,164,353	12,951.77	194,276,613	5.625	2028/1/17	0.80
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,450,000	13,050.84	189,237,210	13,288.58	192,684,437	5.875	2025/9/16	0.80
23	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,410,000	12,869.20	181,455,818	13,558.20	191,170,726	6.05	2040/1/11	0.79
24	アメリカ	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,500,000	11,941.27	179,119,114	12,679.96	190,199,535	4.625	2047/10/4	0.79
25	アメリカ	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,400,000	13,113.06	183,582,873	13,513.33	189,186,676	4.375	2029/4/16	0.78
26	アメリカ	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,600,000	11,416.77	182,668,480	11,729.93	187,678,927	1.625	2028/6/2	0.78
27	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	1,500,000	12,384.44	185,766,674	12,337.59	185,063,955	5.75	2024/3/22	0.77
28	アメリカ	国債証券	HUNGARY	1,400,000	13,197.87	184,770,226	13,191.14	184,675,992	5.375	2024/3/25	0.76
29	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000	11,933.27	178,999,110	12,244.82	183,672,364	4.5	2029/5/30	0.76
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,700,000	9,897.81	168,262,891	10,713.74	182,133,587	5.625	2044/2/26	0.75

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.06
合 計	98.06

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	社債券	CHENIERE ENERGY PARTNERS	330,000	12,324.18	40,669,815	12,596.37	41,568,041	4.5	2029/10/1	0.56
2	アメリカ	社債券	COLT MERGER SUB INC	280,000	13,160.37	36,849,041	13,017.61	36,449,308	6.25	2025/7/1	0.49
3	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	300,000	11,820.96	35,462,886	11,826.34	35,479,040	4.75	2030/3/1	0.47
4	アメリカ	社債券	SIRIUS XM RADIO INC	300,000	11,029.00	33,087,028	11,378.83	34,136,490	3.875	2031/9/1	0.46
5	アメリカ	社債券	AMERICAN AIRLINES/AADVAN	270,000	12,581.56	33,970,233	12,366.07	33,388,402	5.75	2029/4/20	0.45
6	アメリカ	社債券	AMERICAN AIRLINES/AADVAN	260,000	12,774.71	33,214,262	12,811.96	33,311,099	5.5	2026/4/20	0.44
7	アメリカ	社債券	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	200,000	14,764.85	29,529,712	14,764.53	29,529,071	8.5	2027/7/15	0.39
8	アメリカ	社債券	MOZART DEBT MERGER SUB	250,000	11,442.74	28,606,856	11,697.88	29,244,701	3.875	2029/4/1	0.39
9	アメリカ	社債券	CENTENE CORP	250,000	11,252.99	28,132,478	11,600.12	29,000,300	2.45	2028/7/15	0.39
10	アメリカ	社債券	CARVANA CO	250,000	11,666.85	29,167,134	11,573.58	28,933,952	10.25	2030/5/1	0.39
11	アメリカ	社債券	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	200,000	14,124.89	28,249,791	14,364.57	28,729,143	6.625	2030/9/1	0.38
12	アメリカ	社債券	CARNIVAL CORP	250,000	12,075.84	30,189,608	11,381.00	28,452,523	5.75	2027/3/1	0.38
13	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	250,000	11,252.83	28,132,078	11,379.02	28,447,555	4.25	2031/2/1	0.38
14	アメリカ	社債券	UBER TECHNOLOGIES INC	220,000	12,911.13	28,404,489	12,805.71	28,172,564	6.25	2028/1/15	0.38
15	アメリカ	社債券	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	200,000	13,798.92	27,597,843	13,865.33	27,730,669	6.375	2028/9/1	0.37
16	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	200,000	13,353.71	26,707,425	13,419.86	26,839,738	8	2025/12/15	0.36

17	アメリカ	社債券	SPRINGLEAF FINANCE CORP	220,000	11,791.47	25,941,242	11,878.97	26,133,749	5.375	2029/11/15	0.35
18	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE SA	200,000	13,176.59	26,353,181	13,010.36	26,020,732	8.125	2027/2/1	0.35
19	アメリカ	社債券	UNICREDIT SPA	200,000	13,291.14	26,582,292	13,002.15	26,004,306	7.296	2034/4/2	0.35
20	アメリカ	社債券	LCPR SR SECURED FIN DAC	200,000	12,932.79	25,865,598	12,942.03	25,884,060	6.75	2027/10/15	0.34
21	アメリカ	社債券	BOMBARDIER INC	220,000	12,454.89	27,400,772	11,734.99	25,816,994	7.875	2027/4/15	0.34
22	アメリカ	社債券	CENTENE CORP	200,000	12,470.34	24,940,692	12,837.02	25,674,053	4.25	2027/12/15	0.34
23	アメリカ	社債券	NETFLIX INC	200,000	13,045.36	26,090,735	12,817.02	25,634,051	4.875	2030/6/15	0.34
24	アメリカ	社債券	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000	12,772.85	25,545,714	12,816.12	25,632,256	5.25	2025/4/30	0.34
25	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE HOLDING SA	200,000	13,313.32	26,626,652	12,762.21	25,524,431	10.5	2027/5/15	0.34
26	アメリカ	社債券	VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000	12,247.00	24,494,008	12,709.84	25,419,684	5.5	2029/5/15	0.34
27	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000	12,625.15	25,250,318	12,708.17	25,416,350	3.37	2023/11/17	0.34
28	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	12,614.77	25,229,548	12,659.64	25,319,295	6.5	2029/2/1	0.34
29	アメリカ	社債券	NETFLIX INC	200,000	12,692.79	25,385,580	12,649.71	25,299,423	3.625	2025/6/15	0.34
30	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000	12,613.30	25,226,600	12,624.74	25,249,480	4.063	2024/11/1	0.34

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.78
合 計	97.78

（参考）J－REITインデックス マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資 証券	4,504	720,327	3,244,356,050	700,000	3,152,800,000	7.05
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法 人 投資証券	3,864	680,159	2,628,137,312	639,000	2,469,096,000	5.52
3	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,321	357,570	2,260,204,078	343,000	2,168,103,000	4.84
4	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資 証券	19,494	113,032	2,203,447,172	108,900	2,122,896,600	4.74

5	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,494	179,331	2,240,564,012	167,800	2,096,493,200	4.68
6	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	12,513	187,104	2,341,242,362	165,700	2,073,404,100	4.63
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,801	326,527	1,894,185,911	318,500	1,847,618,500	4.13
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,698	207,914	1,600,528,823	186,200	1,433,367,600	3.20
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,863	364,812	1,409,269,258	360,500	1,392,611,500	3.11
10	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,698	157,774	1,372,322,253	143,800	1,250,772,400	2.79
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,640	438,150	1,156,718,296	410,500	1,083,720,000	2.42
12	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,485	204,304	1,120,611,937	190,400	1,044,344,000	2.33
13	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,728	90,827	1,065,230,314	79,500	932,376,000	2.08
14	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,334	648,592	865,221,981	670,000	893,780,000	1.99
15	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,730	181,350	857,785,831	183,100	866,063,000	1.93
16	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,522	586,332	892,397,867	556,000	846,232,000	1.89
17	日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,059	491,559	1,012,119,981	410,500	845,219,500	1.89
18	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,605	322,524	840,175,410	324,000	844,020,000	1.88
19	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,195	790,873	945,093,880	662,000	791,090,000	1.76
20	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	11,836	68,958	816,190,557	66,800	790,644,800	1.76
21	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,005	45,486	773,491,470	42,800	727,814,000	1.62
22	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,354	516,832	699,791,069	531,000	718,974,000	1.60
23	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,544	157,186	714,256,773	154,100	700,230,400	1.56
24	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,543	161,831	735,199,823	152,200	691,444,600	1.54
25	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,221	118,353	617,922,161	118,000	616,078,000	1.37
26	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,797	350,419	629,704,596	339,000	609,183,000	1.36
27	日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,765	228,315	631,292,081	214,100	591,986,500	1.32
28	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,604	181,401	653,772,483	162,100	584,208,400	1.30
29	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	817	783,130	639,817,397	695,000	567,815,000	1.27
30	日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	3,703	163,131	604,076,981	152,100	563,226,300	1.25

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	95.97
合 計	95.97

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	206,290	16,323.54	3,367,384,507	16,316.00	3,365,828,589	6.30
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	25,070	102,804.31	2,577,304,088	88,936.71	2,229,643,390	4.17
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	42,490	38,698.94	1,644,318,174	43,049.07	1,829,155,057	3.42
4	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	79,060	20,422.99	1,614,641,867	18,142.99	1,434,385,351	2.68
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	121,300	10,277.62	1,246,675,961	11,560.69	1,402,312,388	2.62
6	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	157,600	8,769.85	1,382,128,417	8,891.36	1,401,278,888	2.62
7	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	91,600	17,532.96	1,606,019,231	14,581.32	1,335,649,214	2.50
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	38,950	27,590.93	1,074,666,887	27,040.77	1,053,238,034	1.97
9	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	95,200	10,306.98	981,224,593	10,017.04	953,622,903	1.78
10	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	235,000	3,988.72	937,349,842	3,957.84	930,093,035	1.74
11	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	473,900	1,911.20	905,717,950	1,873.94	888,060,640	1.66
12	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	40,580	24,587.54	997,762,721	21,614.92	877,133,612	1.64
13	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	37,330	21,128.88	788,741,419	23,081.64	861,637,856	1.61
14	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	166,400	4,894.28	814,408,639	4,941.21	822,217,910	1.54
15	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	111,300	7,267.31	808,851,889	7,359.25	819,084,970	1.53
16	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	32,160	22,436.61	721,561,456	23,567.56	757,932,800	1.41
17	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	106,200	6,418.63	681,658,594	6,848.97	727,361,485	1.36
18	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	32,340	22,891.41	740,308,284	21,304.65	688,992,565	1.29
19	香港	投資証券	LINK REIT	589,000	1,218.06	717,441,803	1,164.32	685,789,781	1.28
20	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,200	40,266.87	732,857,129	37,012.94	673,635,597	1.26
21	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	335,500	1,805.24	605,659,608	1,826.27	612,713,719	1.14
22	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	53,300	9,913.16	528,371,872	10,917.08	581,880,444	1.09
23	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	150,500	4,418.36	664,963,472	3,856.55	580,411,798	1.08
24	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	39,700	15,519.97	616,143,028	14,446.70	573,534,101	1.07
25	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	80,400	6,003.06	482,646,032	7,043.85	566,326,135	1.06
26	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	28,520	17,758.21	506,464,283	18,587.88	530,126,503	0.99
27	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	199,500	2,263.81	451,631,008	2,653.94	529,462,427	0.99
28	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	171,200	2,860.30	489,684,248	3,043.70	521,082,364	0.97
29	アメリカ	投資証券	UDR INC	83,500	6,557.15	547,522,344	6,229.72	520,181,946	0.97
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	48,300	9,860.90	476,281,816	9,915.76	478,931,276	0.89

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.76
合 計	98.76

（参考）海外REITインデックス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)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	25,520	18,000.68	459,377,455	16,316.00	416,384,437	6.18
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	3,105	110,708.88	343,751,077	88,936.71	276,148,493	4.10
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	5,262	42,759.83	225,002,246	43,049.07	226,524,215	3.36

4	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,770	21,142.27	206,560,016	18,142.99	177,257,082	2.63
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	15,000	11,119.65	166,794,799	11,560.69	173,410,435	2.57
6	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	19,480	8,930.39	173,964,174	8,891.36	173,203,761	2.57
7	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	11,340	17,459.35	197,989,049	14,581.32	165,352,206	2.45
8	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,830	29,947.06	144,644,329	27,040.77	130,606,924	1.94
9	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	11,830	10,972.54	129,805,164	10,017.04	118,501,670	1.76
10	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	29,180	3,977.57	116,065,703	3,957.84	115,489,850	1.71
11	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	58,300	2,121.46	123,681,548	1,873.94	109,250,760	1.62
12	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,040	26,405.15	133,081,967	21,614.92	108,939,216	1.61
13	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,640	24,880.49	115,445,489	23,081.64	107,098,839	1.59
14	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	13,830	7,204.63	99,640,043	7,359.25	101,778,483	1.51
15	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	20,540	5,348.92	109,866,841	4,941.21	101,492,523	1.50
16	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,970	25,227.10	100,151,601	23,567.56	93,563,222	1.39
17	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	13,070	6,915.47	90,385,306	6,848.97	89,516,145	1.33
18	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	4,020	26,296.27	105,711,043	21,304.65	85,644,716	1.27
19	香港	投資証券	LINK REIT	73,200	1,152.33	84,351,109	1,164.32	85,228,883	1.26
20	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,239	43,005.20	96,288,662	37,012.94	82,871,984	1.23
21	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	41,200	2,092.19	86,198,522	1,826.27	75,242,341	1.11
22	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	6,560	10,149.47	66,580,530	10,917.08	71,616,055	1.06
23	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18,520	4,615.25	85,474,581	3,856.55	71,423,432	1.06
24	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	4,890	14,642.21	71,600,426	14,446.70	70,644,377	1.05
25	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	9,930	6,327.31	62,830,234	7,043.85	69,945,504	1.03
26	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,510	19,833.67	69,616,184	18,587.88	65,243,479	0.96
27	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	24,400	2,089.92	50,994,246	2,653.94	64,756,307	0.96
28	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	21,100	2,851.48	60,166,389	3,043.70	64,222,184	0.95
29	アメリカ	投資証券	UDR INC	10,300	7,109.36	73,226,475	6,229.72	64,166,156	0.95
30	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5,950	11,155.56	66,375,586	9,915.76	58,998,780	0.87

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.14
合 計	97.14

②【投資不動産物件】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプV）

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）外国株式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）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）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）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J－REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅤ）

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06月限)	買建	586	日本円	10,969,701,510	11,186,740,000	2.57

（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06月限)	買建	417	米ドル	82,512,800	10,578,966,084	86,647,387.5	11,109,061,529	0.86

カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2022年06月限)	買建	25	カナダドル	6,108,860	617,605,746	6,317,000	638,648,700	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06月限)	買建	291	ユーロ	10,644,850	1,466,434,539	11,174,400	1,539,385,344	0.12
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06月限)	買建	23	豪ドル	4,078,725	375,038,760	4,194,625	385,695,763	0.03
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2022年06月限)	買建	62	英ポンド	4,581,385	741,084,838	4,706,730	761,360,640	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06月限)	買建	31	スイスフラン	3,565,430	475,806,629	3,636,610	485,305,599	0.03

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

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06月限)	買建	148	米ドル	29,478,975	3,779,499,383	30,752,550	3,942,784,423	3.95
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2022年06月限)	買建	8	カナダドル	1,942,240	196,360,464	2,021,440	204,367,584	0.20
	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06月限)	買建	97	ユーロ	3,446,520	474,792,602	3,724,800	513,128,448	0.51
	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06月限)	買建	8	豪ドル	1,412,775	129,904,663	1,459,000	134,155,048	0.13
	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06月限)	買建	21	英ポンド	1,528,815	247,301,110	1,594,215	257,880,213	0.25
	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06月限)	買建	10	スイスフラン	1,147,790	153,172,575	1,173,100	156,550,193	0.15

（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	MSCIエマージング・マーケット指数先物(2022年06月限)	買建	401	米ドル	20,209,430	2,591,051,023	21,026,435	2,695,799,185	3.67
	香港	香港先物取引所	MSCI China A 50 Connect 指数先物(2022年06月限)	買建	75	米ドル	4,129,520	529,445,759	4,227,375	541,991,748	0.73

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地域	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2022年06月限)	買建	13	米ドル	2,619,912.5	335,898,981	2,701,237.5	346,325,658	0.48

（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）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J－REITインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数先物 取引	大阪取引所	REIT指数先物(2022年06月限)	買建	670	日本円	1,259,337,390	1,344,020,000	3.00

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地 域	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2022年06月限)	買建	122	米ドル	4,637,860	594,620,029	4,748,240	608,771,844	1.14

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地 域	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2022年06月限)	買建	27	米ドル	1,140,190	146,183,760	1,050,840	134,728,192	2.00

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

2022年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2017年 4月24日)	1	1	1.0002	1.0002
第2計算期間	(2018年 4月23日)	67	67	1.0242	1.0242
第3計算期間	(2019年 4月22日)	163	163	1.0487	1.0487
第4計算期間	(2020年 4月22日)	138	138	1.0282	1.0282
第5計算期間	(2021年 4月22日)	124	124	1.1365	1.1365
第6計算期間	(2022年 4月22日)	172	172	1.1581	1.1581
	2021年 5月末日	117	—	1.1445	—

6月末日	126	—	1.1517	—
7月末日	134	—	1.1576	—
8月末日	138	—	1.1644	—
9月末日	143	—	1.1542	—
10月末日	148	—	1.1685	—
11月末日	142	—	1.1643	—
12月末日	148	—	1.1766	—
2022年 1月末日	151	—	1.1479	—
2月末日	154	—	1.1375	—
3月末日	166	—	1.1581	—
4月末日	170	—	1.1503	—
5月末日	171	—	1.1434	—

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

2022年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間 (2017年 4月24日)	1	1	0.9998	0.9998
第2計算期間 (2018年 4月23日)	78	78	1.0402	1.0402
第3計算期間 (2019年 4月22日)	90	90	1.0690	1.0690
第4計算期間 (2020年 4月22日)	87	87	1.0281	1.0281
第5計算期間 (2021年 4月22日)	91	91	1.2027	1.2027
第6計算期間 (2022年 4月22日)	93	93	1.2528	1.2528
2021年 5月末日	90	—	1.2158	—
6月末日	91	—	1.2272	—
7月末日	102	—	1.2327	—
8月末日	96	—	1.2442	—
9月末日	91	—	1.2320	—
10月末日	93	—	1.2549	—
11月末日	96	—	1.2467	—
12月末日	94	—	1.2675	—
2022年 1月末日	90	—	1.2270	—
2月末日	88	—	1.2147	—
3月末日	92	—	1.2498	—
4月末日	92	—	1.2381	—
5月末日	91	—	1.2290	—

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

2022年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2017年 4月24日)	2	2	0.9986	0.9986
第2計算期間	(2018年 4月23日)	182	182	1.0534	1.0534
第3計算期間	(2019年 4月22日)	215	215	1.0904	1.0904
第4計算期間	(2020年 4月22日)	291	291	1.0231	1.0231
第5計算期間	(2021年 4月22日)	328	328	1.2629	1.2629
第6計算期間	(2022年 4月22日)	588	588	1.3542	1.3542
2021年 5月末日		338	—	1.2822	—
6月末日		354	—	1.2980	—
7月末日		512	—	1.3068	—
8月末日		527	—	1.3228	—
9月末日		519	—	1.3092	—
10月末日		536	—	1.3440	—
11月末日		540	—	1.3330	—
12月末日		566	—	1.3625	—
2022年 1月末日		539	—	1.3093	—
2月末日		544	—	1.2957	—
3月末日		582	—	1.3482	—
4月末日		565	—	1.3305	—
5月末日		569	—	1.3200	—

インデックス・ブレンド（タイプIV）

2022年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2017年 4月24日)	3	3	0.9989	0.9989
第2計算期間	(2018年 4月23日)	31	31	1.0646	1.0646
第3計算期間	(2019年 4月22日)	51	51	1.1052	1.1052
第4計算期間	(2020年 4月22日)	76	76	1.0179	1.0179
第5計算期間	(2021年 4月22日)	95	95	1.3104	1.3104
第6計算期間	(2022年 4月22日)	131	131	1.4273	1.4273
2021年 5月末日		98	—	1.3351	—
6月末日		99	—	1.3547	—
7月末日		102	—	1.3590	—
8月末日		108	—	1.3792	—
9月末日		108	—	1.3644	—
10月末日		115	—	1.4080	—
11月末日		115	—	1.3933	—
12月末日		121	—	1.4311	—

2022年 1月末日	119	—	1.3668	—
2月末日	120	—	1.3514	—
3月末日	129	—	1.4180	—
4月末日	129	—	1.3970	—
5月末日	131	—	1.3843	—

インデックス・ブレンド（タイプV）

2022年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2017年 4月24日)	2	2	0.9965	0.9965
第2計算期間	(2018年 4月23日)	114	114	1.0820	1.0820
第3計算期間	(2019年 4月22日)	194	194	1.1290	1.1290
第4計算期間	(2020年 4月22日)	210	210	1.0107	1.0107
第5計算期間	(2021年 4月22日)	291	291	1.3953	1.3953
第6計算期間	(2022年 4月22日)	450	450	1.5745	1.5745
	2021年 5月末日	313	—	1.4287	—
	6月末日	324	—	1.4542	—
	7月末日	331	—	1.4560	—
	8月末日	342	—	1.4831	—
	9月末日	333	—	1.4672	—
	10月末日	381	—	1.5267	—
	11月末日	390	—	1.5076	—
	12月末日	413	—	1.5592	—
	2022年 1月末日	397	—	1.4759	—
	2月末日	398	—	1.4615	—
	3月末日	426	—	1.5581	—
	4月末日	437	—	1.5295	—
	5月末日	439	—	1.5141	—

②【分配の推移】

インデックス・ブレンド（タイプI）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	0.0000円

第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	0.0000円
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	0.0000円
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	0.0000円
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプⅤ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	0.0000円
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円

第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	0.0000円
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	0.0000円

③【収益率の推移】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	2.4%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	2.4%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	△2.0%
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	10.5%
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	1.9%

※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。

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	△0.0%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	4.0%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	2.8%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	△3.8%
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	17.0%
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	4.2%

※各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。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。

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	△0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	5.5%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.5%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	△6.2%
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	23.4%
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	7.2%

※各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。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。

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	△0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	6.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.8%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	△7.9%
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	28.7%
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	8.9%

※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。

インデックス・ブレンド（タイプⅤ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	△0.4%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	8.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	4.3%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	△10.5%
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	38.1%
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	12.8%

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

（４）【設定及び解約の実績】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	1,871,229	22,136	1,849,093
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	84,588,270	20,341,137	66,096,226
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	139,749,676	50,154,666	155,691,236
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	68,957,367	89,937,465	134,711,138
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	42,575,201	67,408,880	109,877,459
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	93,234,946	54,593,007	148,519,398

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	1,140,737	—	1,140,737
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	81,863,323	7,157,724	75,846,336
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	64,162,109	55,040,537	84,967,908
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	40,391,880	40,547,332	84,812,456
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	17,569,304	26,503,725	75,878,035
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	20,564,865	22,133,898	74,309,002

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	2,616,123	11,615	2,604,508
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	222,742,777	52,396,644	172,950,641
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	90,227,074	65,793,755	197,383,960
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	148,863,569	61,665,955	284,581,574
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	85,112,865	109,242,029	260,452,410
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	264,299,332	90,012,863	434,738,879

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	3,911,186	6,532	3,904,654
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	40,547,035	15,185,160	29,266,529
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	19,627,025	2,057,321	46,836,233
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	42,459,087	14,139,356	75,155,964
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	27,057,101	29,534,780	72,678,285
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	30,084,394	10,365,196	92,397,483

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレンド（タイプⅤ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	2,529,296	151,621	2,377,675
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	107,829,976	4,387,951	105,819,700
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	119,681,763	53,143,123	172,358,340

第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	84,060,552	47,829,633	208,589,259
第5計算期間	2020年 4月23日～2021年 4月22日	47,688,078	47,012,851	209,264,486
第6計算期間	2021年 4月23日～2022年 4月22日	103,473,634	26,532,080	286,206,040

※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5月31日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） — 純資産総額（右軸）

■ タイプⅠ



■ タイプⅡ



■ タイプⅢ



■ タイプⅣ



■ タイプⅤ



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

■ タイプⅠ

2022年4月	0 円
2021年4月	0 円
2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
設定来累計	0 円

■ タイプⅡ

2022年4月	0 円
2021年4月	0 円
2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
設定来累計	0 円

■ タイプⅢ

2022年4月	0 円
2021年4月	0 円
2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
設定来累計	0 円

■ タイプⅣ

2022年4月	0 円
2021年4月	0 円
2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
設定来累計	0 円

■ タイプⅤ

2022年4月	0 円
2021年4月	0 円
2020年4月	0 円
2019年4月	0 円
2018年4月	0 円
設定来累計	0 円



運用実績（2022年5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（％）				
	タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
国内株式マザーファンド	5.5	8.0	8.4	10.8	14.2
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7.7	13.9	23.0	27.0	36.9
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	0.5	0.5	0.5	0.5	0.5
新興国株式マザーファンド	1.5	2.1	2.6	3.5	4.5
米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	6.7	8.7	9.6	11.1	12.5
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	62.0	47.5	37.0	27.2	8.2
外国債券マザーファンド	6.9	7.4	5.9	5.3	7.7
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	0.9	0.6	0.9	0.9	0.5
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	—	—	—	—	—
新興国債券マザーファンド	0.5	0.5	0.5	0.5	0.5
米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1.5	2.0	2.0	2.0	2.5
J-REITインデックスマザーファンド	2.0	2.5	2.9	2.9	2.9
海外REITインデックスマザーファンド	2.5	4.6	5.0	6.5	7.5
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	—	—	—	—	—

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（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.2	0.3	0.3	0.4	0.6
2	ソニーグループ	電気機器	0.2	0.2	0.2	0.3	0.4
3	キーエンス	電気機器	0.1	0.1	0.2	0.2	0.3
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2
5	日本電信電話	情報・通信業	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2

・「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（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.4	0.7	1.1	1.3	1.8
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3	0.5	0.9	1.0	1.4
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.3	0.5	0.5	0.7
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	0.3	0.4	0.5
5	TESLA INC	自動車	0.1	0.2	0.3	0.3	0.5

・「外国株式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	業種	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	TESLA INC	自動車	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

・「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（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.1	0.1	0.2	0.2	0.3
2	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
3	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
5	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1



運用実績（2022年5月31日現在）

・「米国株式配当貴族インデックスマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	ALBEMARLE CORP	化学	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
2	AMCOR PLC	容器・包装	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
3	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
4	SHERWIN-WILLIAMS	化学	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
5	EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	航空貨物・物流サービス	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	国庫債券 利付（10年）第365回	国債証券	0.9	0.7	0.5	0.4	0.1
2	国庫債券 利付（10年）第360回	国債証券	0.8	0.6	0.5	0.3	0.1
3	国庫債券 利付（10年）第359回	国債証券	0.8	0.6	0.5	0.3	0.1
4	国庫債券 利付（10年）第363回	国債証券	0.8	0.6	0.4	0.3	0.1
5	国庫債券 利付（5年）第139回	国債証券	0.7	0.6	0.4	0.3	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（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.3	0.2	0.2	0.3
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	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	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（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
2	FRANCE (GOVT OF)	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	REPUBLIC OF PERU	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
2	STATE OF QATAR	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	REPUBLIC OF PANAMA	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	FED REPUBLIC OF BRAZIL	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

・「米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	CHENIERE ENERGY PARTNERS	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
2	COLT MERGER SUB INC	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	SIRIUS XM RADIO INC	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	AMERICAN AIRLINES/AADVANTAGE	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0



運用実績（2022年5月31日現在）

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

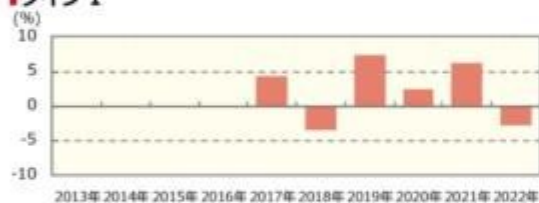
順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
3	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	日本都市ファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
5	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1

・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.2	0.3	0.3	0.4	0.5
2	EQUINIX INC	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2

年間収益率の推移（暦年ベース）

タイプⅠ



タイプⅡ



タイプⅢ



タイプⅣ



タイプⅤ



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2017年は設定日（2017年1月10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、原則として取得およびスイッチングの申込みができません。

申込日当日あるいは申込日の翌営業日が以下のいずれかの休業日と同日の場合

- ・ロンドン証券取引所
- ・ロンドンの銀行
- ・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/>

- ・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。
- ・販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

■積立方式■

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

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

- ・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。
- ・販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

- ・「インデックス・ブレンッド」を構成する各ファンド間でスイッチング※ができます。

スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

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

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

※スイッチングとは、「インデックス・ブレンド」を構成するいずれかのファンドをご換金した場合の手取金をもって、そのご換金のお申込み日の午後3時まで、「インデックス・ブレンド」を構成する他のファンドの取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものをいいます。

- ・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（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、受益権の取得申込の受付け（スイッチングの申込みを含みます。）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（スイッチングの申込みを含みます。）を取り消す場合があります。

※購入およびスイッチングのお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社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（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、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
REIT (不動産投資信託)	原則として、基準価額計算日 ^{※1} の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

無期限とします(2017年1月10日設定)。

（４）【計算期間】

原則として、毎年4月23日から翌年4月22日までとします。

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

（５）【その他】

（a）ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより各ファンドにつき受益権の口数が30億口を下回った場合、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發します。

（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します。
- (ii) 委託者は、上記(i)の事項（上記(i)の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- (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つても、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てします。）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てします。）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】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

インデックス・ブレンド（タイプⅤ）

（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（2021年4月23日から2022年4月22日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【インデックス・ブレンド（タイプI）】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)		
	第5期 (2021年 4月22日現在)	第6期 (2022年 4月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,542,995	2,085,890
親投資信託受益証券	123,004,889	168,002,605
派生商品評価勘定	36,908	-
未収入金	1,888,000	2,792,000
流動資産合計	126,472,792	172,880,495
資産合計	126,472,792	172,880,495
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	35,330	146,131
未払金	-	47,434
未払解約金	1,211,805	276,624
未払受託者報酬	21,992	25,034
未払委託者報酬	329,839	375,509
その他未払費用	2,139	2,449
流動負債合計	1,601,105	873,181
負債合計	1,601,105	873,181
純資産の部		
元本等		
元本	109,877,459	148,519,398
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	14,994,228	23,487,916
（分配準備積立金）	8,393,813	7,045,941
元本等合計	124,871,687	172,007,314
純資産合計	124,871,687	172,007,314
負債純資産合計	126,472,792	172,880,495

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	14,474,893	4,031,816
為替差損益	△115,847	△671,502
営業収益合計	14,359,046	3,360,314
営業費用		
支払利息	379	346
受託者報酬	45,111	46,814
委託者報酬	676,614	702,125
その他費用	10,324	10,510
営業費用合計	732,428	759,795
営業利益又は営業損失（△）	13,626,618	2,600,519
経常利益又は経常損失（△）	13,626,618	2,600,519
当期純利益又は当期純損失（△）	13,626,618	2,600,519
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（△）	4,217,125	724,925
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,794,947	14,994,228
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,186,168	14,178,129
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,186,168	14,178,129
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,396,380	7,560,035
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,396,380	7,560,035
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	14,994,228	23,487,916

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 4月23日から2022年 4月22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 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 109,877,459口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 148,519,398口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1365円 (10,000口当たり純資産額) (11,365円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.1581円 (10,000口当たり純資産額) (11,581円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日																																				
1. 分配金の計算過程 <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,746,660円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>4,487,833円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>6,600,415円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>2,159,320円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>14,994,228円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,746,660円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,487,833円	収益調整金額	C	6,600,415円	分配準備積立金額	D	2,159,320円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,994,228円	1. 分配金の計算過程 <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,509,405円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>366,189円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>16,441,975円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>5,170,347円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>23,487,916円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,509,405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	366,189円	収益調整金額	C	16,441,975円	分配準備積立金額	D	5,170,347円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,487,916円
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	1,746,660円																																			
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	4,487,833円																																			
収益調整金額	C	6,600,415円																																			
分配準備積立金額	D	2,159,320円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,994,228円																																			
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	1,509,405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	366,189円																																			
収益調整金額	C	16,441,975円																																			
分配準備積立金額	D	5,170,347円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	23,487,916円																																			

当ファンドの期末残存口数	F	109,877,459口	当ファンドの期末残存口数	F	148,519,398口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,364円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,581円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 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。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第5期 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	2. 時価の算定方法 同左
派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般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 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
期首元本額 134,711,138円	期首元本額 109,877,459円
期中追加設定元本額 42,575,201円	期中追加設定元本額 93,234,946円
期中一部解約元本額 67,408,880円	期中一部解約元本額 54,593,007円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	8,021,325	3,347,471

合計	8,021,325	3,347,471

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第5期(2021年 4月22日現在)				第6期(2022年 4月22日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	7,051,662	—	7,050,084	1,578	1,471,388	—	1,617,519	△146,131
米ドル	7,051,662	—	7,050,084	1,578	1,471,388	—	1,617,519	△146,131
合計	7,051,662	—	7,050,084	1,578	1,471,388	—	1,617,519	△146,131

（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。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	4,147,612	8,452,418	

親投資信託受益証券		外国債券マザーファンド	3,912,328	10,163,445	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,667,441	12,764,505	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	81,901,098	106,577,898	
		J-REITインデックスマザーファンド	937,624	2,528,115	
		海外REITインデックスマザーファンド	1,871,187	6,976,907	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	605,756	1,693,390	
		新興国株式マザーファンド	1,545,147	2,501,438	
		新興国債券マザーファンド	873,060	1,683,259	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,499,193	1,664,104	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	2,235,531	3,395,324	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	4,322,216	9,601,802	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：97.7%	106,518,193	168,002,605 100.0%	
合計				168,002,605	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

【インデックス・ブレンド（タイプII）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2021年 4月22日現在)	第6期 (2022年 4月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	849,889	900,576
親投資信託受益証券	89,683,774	90,141,997
派生商品評価勘定	26,614	-
未収入金	1,006,000	2,463,000
流動資産合計	91,566,277	93,505,573
資産合計	91,566,277	93,505,573
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	61,247	75,338
未払金	-	87,176
未払解約金	-	62
未払受託者報酬	15,200	15,197
未払委託者報酬	233,024	233,020
その他未払費用	1,472	1,466
流動負債合計	310,943	412,259
負債合計	310,943	412,259
純資産の部		
元本等		
元本	75,878,035	74,309,002
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,377,299	18,784,312
（分配準備積立金）	9,638,325	10,386,354
元本等合計	91,255,334	93,093,314
純資産合計	91,255,334	93,093,314
負債純資産合計	91,566,277	93,505,573

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	15,044,573	4,843,223
為替差損益	△100,804	△598,378
営業収益合計	14,943,769	4,244,845
営業費用		
支払利息	134	98
受託者報酬	30,678	30,767
委託者報酬	470,332	471,718
その他費用	8,900	8,917
営業費用合計	510,044	511,500
営業利益又は営業損失（△）	14,433,725	3,733,345
経常利益又は経常損失（△）	14,433,725	3,733,345
当期純利益又は当期純損失（△）	14,433,725	3,733,345
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（△）	2,560,281	605,888
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,382,831	15,377,299
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,090,026	4,831,925
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,090,026	4,831,925
剰余金減少額又は欠損金増加額	969,002	4,552,369
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	969,002	4,552,369
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,377,299	18,784,312

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 4月23日から2022年 4月22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 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 75,878,035口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 74,309,002口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2027円 (10,000口当たり純資産額) (12,027円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2528円 (10,000口当たり純資産額) (12,528円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日																																				
1. 分配金の計算過程 <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,485,264円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>6,467,162円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>5,738,974円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,685,899円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>15,377,299円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,485,264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	6,467,162円	収益調整金額	C	5,738,974円	分配準備積立金額	D	1,685,899円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,377,299円	1. 分配金の計算過程 <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,366,613円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>1,760,844円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>8,397,958円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>7,258,897円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>18,784,312円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,366,613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	1,760,844円	収益調整金額	C	8,397,958円	分配準備積立金額	D	7,258,897円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,784,312円
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	1,485,264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	6,467,162円																																			
収益調整金額	C	5,738,974円																																			
分配準備積立金額	D	1,685,899円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,377,299円																																			
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	1,366,613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	1,760,844円																																			
収益調整金額	C	8,397,958円																																			
分配準備積立金額	D	7,258,897円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	18,784,312円																																			

当ファンドの期末残存口数	F	75,878,035口	当ファンドの期末残存口数	F	74,309,002口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,026円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,527円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 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っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第5期 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 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。	2. 時価の算定方法 同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般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 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
期首元本額 84,812,456円	期首元本額 75,878,035円
期中追加設定元本額 17,569,304円	期中追加設定元本額 20,564,865円
期中一部解約元本額 26,503,725円	期中一部解約元本額 22,133,898円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	10,254,732	3,695,057

合計	10,254,732	3,695,057

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第5期(2021年 4月22日現在)				第6期(2022年 4月22日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	6,828,909	—	6,863,542	△34,633	805,806	—	881,144	△75,338
米ドル	6,828,909	—	6,863,542	△34,633	805,806	—	881,144	△75,338
合計	6,828,909	—	6,863,542	△34,633	805,806	—	881,144	△75,338

（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。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	3,392,977	6,914,547	

親投資信託受益証券		外国債券マザーファンド	1,960,475	5,092,921	
		外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド	2,427,637	11,616,971	
		国内債券NOMURA－BPI総合マザーファンド	33,462,444	43,544,678	
		J－REITインデックスマザーファンド	681,853	1,838,480	
		海外REITインデックスマザーファンド	1,532,803	5,715,209	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	659,589	1,843,881	
		新興国株式マザーファンド	1,406,141	2,276,401	
		新興国債券マザーファンド	478,680	922,895	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	818,295	908,307	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,845,724	2,803,285	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,999,965	6,664,422	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：96.8%	51,666,583	90,141,997 100.0%	
合計				90,141,997	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

【インデックス・ブレンド（タイプⅢ）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2021年 4月22日現在)	第6期 (2022年 4月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,939,523	6,414,107
親投資信託受益証券	322,714,167	566,620,121
派生商品評価勘定	108,077	-
未収入金	3,555,000	18,648,000
流動資産合計	336,316,767	591,682,228
資産合計	336,316,767	591,682,228
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	190,828	412,096
未払金	-	945,436
未払解約金	6,293,517	87,467
未払受託者報酬	54,235	90,733
未払委託者報酬	849,763	1,421,464
未払利息	5	1
その他未払費用	5,362	9,014
流動負債合計	7,393,710	2,966,211
負債合計	7,393,710	2,966,211
純資産の部		
元本等		
元本	260,452,410	434,738,879
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	68,470,647	153,977,138
（分配準備積立金）	42,188,574	62,170,988
元本等合計	328,923,057	588,716,017
純資産合計	328,923,057	588,716,017
負債純資産合計	336,316,767	591,682,228

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	70,715,041	39,282,954
為替差損益	△347,977	△3,559,103
その他収益	-	17
営業収益合計	70,367,064	35,723,868
営業費用		
支払利息	978	1,157
受託者報酬	108,464	162,221
委託者報酬	1,699,348	2,541,379
その他費用	16,663	22,042
営業費用合計	1,825,453	2,726,799
営業利益又は営業損失（△）	68,541,611	32,997,069
経常利益又は経常損失（△）	68,541,611	32,997,069
当期純利益又は当期純損失（△）	68,541,611	32,997,069
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（△）	14,945,185	3,543,899
期首剰余金又は期首欠損金（△）	6,582,096	68,470,647
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,533,881	80,760,296
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,533,881	80,760,296
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,241,756	24,706,975
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,241,756	24,706,975
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	68,470,647	153,977,138

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 4月23日から2022年 4月22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 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 260,452,410口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 434,738,879口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.2629円 (10,000口当たり純資産額) (12,629円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3542円 (10,000口当たり純資産額) (13,542円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日																																				
1. 分配金の計算過程 <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>5,741,759円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>30,545,261円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>26,282,073円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>5,901,554円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>68,470,647円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	5,741,759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	30,545,261円	収益調整金額	C	26,282,073円	分配準備積立金額	D	5,901,554円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	68,470,647円	1. 分配金の計算過程 <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>8,474,590円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>20,978,580円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>91,806,150円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>32,717,818円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>153,977,138円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	8,474,590円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	20,978,580円	収益調整金額	C	91,806,150円	分配準備積立金額	D	32,717,818円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	153,977,138円
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	5,741,759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	30,545,261円																																			
収益調整金額	C	26,282,073円																																			
分配準備積立金額	D	5,901,554円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	68,470,647円																																			
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	8,474,590円																																			
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	20,978,580円																																			
収益調整金額	C	91,806,150円																																			
分配準備積立金額	D	32,717,818円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	153,977,138円																																			

当ファンドの期末残存口数	F	260,452,410口	当ファンドの期末残存口数	F	434,738,879口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	2,628円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,541円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 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。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第5期 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	2. 時価の算定方法 同左
派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般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 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
期首元本額 284,581,574円	期首元本額 260,452,410円
期中追加設定元本額 85,112,865円	期中追加設定元本額 264,299,332円
期中一部解約元本額 109,242,029円	期中一部解約元本額 90,012,863円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	48,909,872	35,606,291

合計	48,909,872	35,606,291

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第5期(2021年 4月22日現在)				第6期(2022年 4月22日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	24,642,885	—	24,725,636	△82,751	5,133,093	—	5,545,189	△412,096
米ドル	24,642,885	—	24,725,636	△82,751	5,133,093	—	5,545,189	△412,096
合計	24,642,885	—	24,725,636	△82,751	5,133,093	—	5,545,189	△412,096

（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。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	22,804,108	46,472,491	

親投資信託受益証券		外国債券マザーファンド	8,999,177	23,378,062	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	27,567,716	131,919,791	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	162,188,439	211,055,815	
		J-REITインデックスマザーファンド	5,369,198	14,476,968	
		海外REITインデックスマザーファンド	10,475,567	39,059,199	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	2,086,695	5,833,355	
		新興国株式マザーファンド	10,645,526	17,234,042	
		新興国債券マザーファンド	3,019,667	5,821,917	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	5,149,734	5,716,204	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	11,630,465	17,664,350	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	21,601,588	47,987,927	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：96.2%	291,537,880	566,620,121	100.0%
合計				566,620,121	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

【インデックス・ブレンド（タイプⅣ）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2021年 4月22日現在)	第6期 (2022年 4月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,022,732	1,759,964
親投資信託受益証券	93,451,218	126,218,961
派生商品評価勘定	31,999	-
未収入金	1,048,000	4,828,000
流動資産合計	95,553,949	132,806,925
資産合計	95,553,949	132,806,925
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	54,137	40,032
未払金	-	304,594
未払解約金	-	241,973
未払受託者報酬	15,326	19,858
未払委託者報酬	245,286	317,626
その他未払費用	1,464	1,911
流動負債合計	316,213	925,994
負債合計	316,213	925,994
純資産の部		
元本等		
元本	72,678,285	92,397,483
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	22,559,451	39,483,448
（分配準備積立金）	13,604,792	20,865,192
元本等合計	95,237,736	131,880,931
純資産合計	95,237,736	131,880,931
負債純資産合計	95,553,949	132,806,925

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	23,258,230	11,000,743
為替差損益	△120,204	△941,885
その他収益	-	2
営業収益合計	23,138,026	10,058,860
営業費用		
支払利息	165	103
受託者報酬	29,952	36,952
委託者報酬	479,273	591,035
その他費用	8,825	9,500
営業費用合計	518,215	637,590
営業利益又は営業損失（△）	22,619,811	9,421,270
経常利益又は経常損失（△）	22,619,811	9,421,270
当期純利益又は当期純損失（△）	22,619,811	9,421,270
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（△）	4,980,748	523,503
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,342,453	22,559,451
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,747,537	11,302,024
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,747,537	11,302,024
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,169,602	3,275,794
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,169,602	3,275,794
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	22,559,451	39,483,448

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 4月23日から2022年 4月22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 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 72,678,285口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 92,397,483口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3104円 (10,000口当たり純資産額) (13,104円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.4273円 (10,000口当たり純資産額) (14,273円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日																																				
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																				
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,762,931円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>10,342,091円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>8,954,659円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>1,499,770円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>22,559,451円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,762,931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	10,342,091円	収益調整金額	C	8,954,659円	分配準備積立金額	D	1,499,770円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,559,451円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>2,149,058円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>6,748,709円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>18,618,256円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>11,967,425円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>39,483,448円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,149,058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	6,748,709円	収益調整金額	C	18,618,256円	分配準備積立金額	D	11,967,425円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	39,483,448円
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	1,762,931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	10,342,091円																																			
収益調整金額	C	8,954,659円																																			
分配準備積立金額	D	1,499,770円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,559,451円																																			
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	2,149,058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	6,748,709円																																			
収益調整金額	C	18,618,256円																																			
分配準備積立金額	D	11,967,425円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	39,483,448円																																			

当ファンドの期末残存口数	F	72,678,285口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,103円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

2. その他費用

その他費用のうち5,940円は、L E I 取得費用であります。

当ファンドの期末残存口数	F	92,397,483口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,273円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

2. その他費用

その他費用のうち5,940円は、L E I 取得費用であります。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	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、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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 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。	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 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	2. 時価の算定方法 同左
派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般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 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
期首元本額 75,155,964円	期首元本額 72,678,285円
期中追加設定元本額 27,057,101円	期中追加設定元本額 30,084,394円
期中一部解約元本額 29,534,780円	期中一部解約元本額 10,365,196円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）

親投資信託受益証券	16,322,570	10,225,858
合計	16,322,570	10,225,858

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第5期(2021年 4月22日現在)				第6期(2022年 4月22日現在)			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	8,464,963	—	8,487,101	△22,138	1,217,200	—	1,257,232	△40,032
米ドル	8,464,963	—	8,487,101	△22,138	1,217,200	—	1,257,232	△40,032
合計	8,464,963	—	8,487,101	△22,138	1,217,200	—	1,257,232	△40,032

(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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考

親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	6,677,395	13,607,863	
		外国債券マザーファンド	1,508,021	3,917,536	
		外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド	7,255,121	34,717,930	
		国内債券NOMURA－BPI総合マザーファンド	25,895,984	33,698,443	
		J－REITインデックスマザーファンド	1,197,904	3,229,908	
		海外REITインデックスマザーファンド	2,879,283	10,735,694	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	460,052	1,286,075	
		新興国株式マザーファンド	3,170,095	5,132,066	
		新興国債券マザーファンド	677,196	1,305,633	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,150,183	1,276,703	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	3,027,008	4,597,419	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	5,723,021	12,713,691	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：95.7%	59,621,263	126,218,961	100.0%
合計				126,218,961	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

【インデックス・ブレンド（タイプV）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 (2021年 4月22日現在)	第6期 (2022年 4月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,037,203	5,172,140
親投資信託受益証券	286,372,513	438,218,325
派生商品評価勘定	121,004	-
未収入金	3,335,000	9,332,000
流動資産合計	292,865,720	452,722,465
資産合計	292,865,720	452,722,465
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	92,132	200,380
未払金	-	697,874
未払解約金	133	42,569
未払受託者報酬	44,644	66,138
未払委託者報酬	729,177	1,080,095
未払利息	1	1
その他未払費用	4,400	6,556
流動負債合計	870,487	2,093,613
負債合計	870,487	2,093,613
純資産の部		
元本等		
元本	209,264,486	286,206,040
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	82,730,747	164,422,812
（分配準備積立金）	56,208,541	92,177,718
元本等合計	291,995,233	450,628,852
純資産合計	291,995,233	450,628,852
負債純資産合計	292,865,720	452,722,465

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	82,711,085	48,339,812
為替差損益	△278,827	△2,565,287
その他収益	1,693	-
営業収益合計	82,433,951	45,774,525
営業費用		
支払利息	576	650
受託者報酬	84,797	120,428
委託者報酬	1,384,926	1,966,788
その他費用	14,297	17,866
営業費用合計	1,484,596	2,105,732
営業利益又は営業損失（△）	80,949,355	43,668,793
経常利益又は経常損失（△）	80,949,355	43,668,793
当期純利益又は当期純損失（△）	80,949,355	43,668,793
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	9,197,522	1,998,955
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,226,942	82,730,747
剰余金増加額又は欠損金減少額	10,062,973	50,807,249
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,062,973	50,807,249
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,311,001	10,785,022
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,311,001	10,785,022
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	82,730,747	164,422,812

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 4月23日から2022年 4月22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 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 209,264,486口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 286,206,040口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.3953円 (10,000口当たり純資産額) (13,953円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.5745円 (10,000口当たり純資産額) (15,745円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日																																				
1. 分配金の計算過程 <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>5,540,732円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>42,869,362円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>26,522,206円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>7,798,447円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>82,730,747円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	5,540,732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	42,869,362円	収益調整金額	C	26,522,206円	分配準備積立金額	D	7,798,447円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	82,730,747円	1. 分配金の計算過程 <table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>7,644,415円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>34,025,423円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>72,245,094円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>50,507,880円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>164,422,812円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	7,644,415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	34,025,423円	収益調整金額	C	72,245,094円	分配準備積立金額	D	50,507,880円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	164,422,812円
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	5,540,732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	42,869,362円																																			
収益調整金額	C	26,522,206円																																			
分配準備積立金額	D	7,798,447円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	82,730,747円																																			
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	7,644,415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	34,025,423円																																			
収益調整金額	C	72,245,094円																																			
分配準備積立金額	D	50,507,880円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	164,422,812円																																			

当ファンドの期末残存口数	F	209,264,486口	当ファンドの期末残存口数	F	286,206,040口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,953円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	5,744円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 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。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第5期 2021年 4月22日現在	第6期 2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	2. 時価の算定方法 同左
派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（関連当事者との取引に関する注記）

第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般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 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
期首元本額 208,589,259円	期首元本額 209,264,486円
期中追加設定元本額 47,688,078円	期中追加設定元本額 103,473,634円
期中一部解約元本額 47,012,851円	期中一部解約元本額 26,532,080円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2020年 4月23日 至 2021年 4月22日	第6期 自 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	68,384,155	44,169,718

合計	68,384,155	44,169,718

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第5期(2021年 4月22日現在)				第6期(2022年 4月22日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引 為替予約取引								
売建	21,933,376	—	21,904,504	28,872	4,072,852	—	4,273,232	△200,380
米ドル	21,933,376	—	21,904,504	28,872	4,072,852	—	4,273,232	△200,380
合計	21,933,376	—	21,904,504	28,872	4,072,852	—	4,273,232	△200,380

（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。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	30,476,455	62,107,967	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	7,385,065	19,184,921	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	33,673,665	161,138,589	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	28,699,235	37,346,314	
	J-REITインデックスマザーファンド	3,904,898	10,528,776	
	海外REITインデックスマザーファンド	10,581,917	39,455,735	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,499,280	4,191,237	
	新興国株式マザーファンド	12,944,982	20,956,631	
	新興国債券マザーファンド	2,212,107	4,264,942	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	3,732,854	4,143,467	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	15,744,212	23,912,309	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	22,951,806	50,987,437	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：97.2%	438,218,325 100.0%	
合計			438,218,325	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

(参考)

「インデックス・ブレンド（タイプⅠ）」、「インデックス・ブレンド（タイプⅡ）」、「インデックス・ブレンド（タイプⅢ）」、「インデックス・ブレンド（タイプⅣ）」、「インデックス・ブレンド（タイプⅤ）」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」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「米国株式配当貴族インデックスマザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」および「海外REITインデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	15,128,662,446
株式	413,339,146,070

(2022年 4月22日現在)

派生商品評価勘定	85,861,950
未収入金	15,537,310
未収配当金	4,824,743,675
未収利息	630,280
その他未収収益	32,408,973
差入委託証拠金	482,615,500
流動資産合計	433,909,606,204
資産合計	433,909,606,204
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	265,521,650
未払解約金	213,127,173
未払利息	4,530
有価証券貸借取引受入金	8,514,497,330
流動負債合計	8,993,150,683
負債合計	8,993,150,683
純資産の部	
元本等	
元本	208,506,265,181
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	216,410,190,340
元本等合計	424,916,455,521
純資産合計	424,916,455,521
負債純資産合計	433,909,606,204

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）

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0379円
(10,000口当たり純資産額)	(20,379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	
	8,034,424,230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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	204,152,848,138円
同期中における追加設定元本額	41,909,457,464円
同期中における一部解約元本額	37,556,040,421円
期末元本額	208,506,265,181円
期末元本額の内訳※	
バランスセレクト30	138,342,938円
バランスセレクト50	311,979,362円
バランスセレクト70	454,125,364円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,234,029,142円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,901,856,220円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	8,339,312,543円
野村資産設計ファンド2015	36,623,427円
野村資産設計ファンド2020	37,505,566円
野村資産設計ファンド2025	67,300,925円
野村資産設計ファンド2030	100,405,621円
野村資産設計ファンド2035	85,379,343円
野村資産設計ファンド2040	162,256,021円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	13,927,015,320円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,448,649,172円
のむラップ・ファンド（普通型）	13,235,346,882円
のむラップ・ファンド（積極型）	4,715,316,851円
野村資産設計ファンド2045	31,610,349円
野村インデックスファンド・TOPIX	2,172,361,995円
マイ・ロード	3,341,807,755円
ネクストコア	12,196,469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	1,520,144,851円
野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）	2,702,961,506円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	798,013,199円
野村資産設計ファンド2050	40,287,823円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	12,024,151円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	6,731,929円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,285,329円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	4,558,518円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	431,176,943円

のむラップ・ファンド（やや積極型）	712,413,018円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	4,147,612円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,392,977円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	22,804,108円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	6,677,395円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	30,476,455円
野村6資産均等バランス	2,886,929,408円
世界6資産分散ファンド	81,996,727円
野村資産設計ファンド2060	28,977,642円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	1,749,336,131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）	281,305,890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）	140,977,867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）	417,238,807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）	309,216,440円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	3,022,033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）	7,904,207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）	1,189,443円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,246,614,914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）	5,477,530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）	50,886,511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）	60,272,341円
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	13,146,197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）	89,686,281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）	190,549,447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）	4,242,660,170円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	44,965,815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）	244,763,847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）	1,841,165,001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）	22,444,937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）	40,075,923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）	2,515,960円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	5,836,957円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	27,565,694円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	34,178,712円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	116,316,904円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	9,074,528,000円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	25,259,806,349円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	29,141,457,617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）	35,405,325,688円
マイバランスDC30	3,395,461,107円
マイバランスDC50	5,855,138,773円
マイバランスDC70	6,334,478,045円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	11,232,037,537円
野村DC運用戦略ファンド	380,149,634円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	30,920,346円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,469,622,892円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	1,235,021,298円

マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	1,113,500,995円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	12,446,266円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	5,718,284円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	94,503,789円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	29,285,484円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	26,555,899円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	21,132,684円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	593,924,110円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	494,660,252円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	313,647,646円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	440,503,417円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	13,491,454円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	110,194,756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）	165,555,378円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	15,462,666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(2022年4月22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	7,500	3,245.00	24,337,500	
		日本水産	215,800	568.00	122,574,400	
		マルハニチロ	33,800	2,375.00	80,275,000	
		雪国まいたけ	15,700	1,113.00	17,474,100	
		カネコ種苗	6,100	1,629.00	9,936,900	
		サカタのタネ	25,700	4,225.00	108,582,500	貸付有価証券 100株
		ホクト	18,100	1,989.00	36,000,900	貸付有価証券 1,900株
		ホクリヨウ	2,900	678.00	1,966,200	
		住石ホールディングス	37,800	178.00	6,728,400	貸付有価証券 3,300株
		日鉄鉱業	4,900	6,690.00	32,781,000	
		三井松島ホールディングス	9,000	2,105.00	18,945,000	貸付有価証券 1,900株（1,200株）

INPEX	820,800	1,585.00	1,300,968,000	貸付有価証券 2,900株
石油資源開発	25,400	2,553.00	64,846,200	貸付有価証券 100株
K&Oエナジーグループ	9,800	1,654.00	16,209,200	
ヒノキヤグループ	4,700	2,337.00	10,983,900	
ショーボンドホールディングス	30,800	5,430.00	167,244,000	貸付有価証券 6,500株
ミライト・ホールディングス	69,500	1,797.00	124,891,500	
タマホーム	13,100	2,512.00	32,907,200	貸付有価証券 6,100株（100株）
サンヨーホームズ	2,500	745.00	1,862,500	
日本アクア	8,600	612.00	5,263,200	
ファーストコーポレーション	5,300	793.00	4,202,900	貸付有価証券 2,400株
ベステラ	4,400	1,217.00	5,354,800	貸付有価証券 500株（100株）
Robot Home	36,000	203.00	7,308,000	貸付有価証券 3,300株（3,300株）
キャンディル	3,700	518.00	1,916,600	貸付有価証券 1,500株
ダイセキ環境ソリューション	4,200	1,043.00	4,380,600	貸付有価証券 1,600株（1,500株）
第一カッター興業	5,300	1,324.00	7,017,200	
安藤・間	107,200	884.00	94,764,800	
東急建設	63,200	658.00	41,585,600	貸付有価証券 100株
コムシスホールディングス	69,600	2,678.00	186,388,800	貸付有価証券 300株
ビーアールホールディングス	29,400	288.00	8,467,200	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	12,000	2,164.00	25,968,000	
東建コーポレーション	6,000	8,680.00	52,080,000	貸付有価証券 2,800株（100株）
ソネック	2,200	990.00	2,178,000	貸付有価証券 900株
ヤマウラ	10,400	921.00	9,578,400	貸付有価証券 4,700株
オリエンタル白石	72,500	229.00	16,602,500	貸付有価証券

				100株
大成建設	144,000	3,500.00	504,000,000	貸付有価証券 1,300株
大林組	498,300	912.00	454,449,600	貸付有価証券 9,600株
清水建設	466,800	729.00	340,297,200	貸付有価証券 11,000株
飛鳥建設	13,300	1,013.00	13,472,900	
長谷工コーポレーション	148,400	1,408.00	208,947,200	貸付有価証券 100株
松井建設	19,600	650.00	12,740,000	
銭高組	2,200	3,780.00	8,316,000	
鹿島建設	365,100	1,452.00	530,125,200	貸付有価証券 7,500株
不動テトラ	10,600	1,538.00	16,302,800	
大末建設	5,200	1,308.00	6,801,600	
鉄建建設	10,800	1,834.00	19,807,200	
西松建設	30,200	3,855.00	116,421,000	貸付有価証券 400株
三井住友建設	112,300	423.00	47,502,900	
大豊建設	7,300	4,550.00	33,215,000	貸付有価証券 3,400株（3,400株）
佐田建設	10,700	452.00	4,836,400	
ナカノフドー建設	11,900	320.00	3,808,000	
奥村組	29,300	3,020.00	88,486,000	
東鉄工業	23,100	2,150.00	49,665,000	
イチケン	3,600	1,831.00	6,591,600	
富士ピー・エス	6,400	489.00	3,129,600	貸付有価証券 2,800株
浅沼組	5,600	5,210.00	29,176,000	
戸田建設	206,900	742.00	153,519,800	
熊谷組	25,400	2,692.00	68,376,800	貸付有価証券 100株
北野建設	3,000	2,061.00	6,183,000	
植木組	4,400	1,457.00	6,410,800	貸付有価証券 1,400株
矢作建設工業	22,000	794.00	17,468,000	
ピーエス三菱	16,400	567.00	9,298,800	
日本ハウスホールディング	34,000	446.00	15,164,000	貸付有価証券

グス				200株
大東建託	51,000	12,440.00	634,440,000	
新日本建設	21,200	720.00	15,264,000	
東亜道路工業	2,600	4,960.00	12,896,000	貸付有価証券 100株
日本道路	4,800	7,500.00	36,000,000	貸付有価証券 300株
東亜建設工業	12,200	2,818.00	34,379,600	
日本国土開発	48,500	538.00	26,093,000	
若築建設	8,300	1,960.00	16,268,000	
東洋建設	55,900	956.00	53,440,400	貸付有価証券 3,800株（2,200株）
五洋建設	197,500	638.00	126,005,000	貸付有価証券 32,300株
世紀東急工業	23,900	731.00	17,470,900	
福田組	5,300	4,460.00	23,638,000	貸付有価証券 2,400株
住友林業	127,500	2,060.00	262,650,000	貸付有価証券 39,100株
日本基礎技術	13,700	786.00	10,768,200	貸付有価証券 100株
巴コーポレーション	22,100	454.00	10,033,400	
大和ハウス工業	460,100	3,101.00	1,426,770,100	
ライト工業	30,100	1,899.00	57,159,900	
積水ハウス	540,400	2,242.50	1,211,847,000	貸付有価証券 6,100株
日特建設	10,300	694.00	7,148,200	
北陸電気工事	10,300	746.00	7,683,800	
ユアテック	28,500	654.00	18,639,000	
日本リーテック	10,400	1,245.00	12,948,000	
四電工	5,400	1,712.00	9,244,800	
中電工	22,900	2,056.00	47,082,400	貸付有価証券 1,300株
関電工	81,000	817.00	66,177,000	
きんでん	111,300	1,538.00	171,179,400	貸付有価証券 10,100株
東京エネシス	16,500	970.00	16,005,000	
トーエネック	5,000	3,260.00	16,300,000	
住友電設	12,300	2,189.00	26,924,700	

日本電設工業	27,300	1,589.00	43,379,700	
エクシオグループ	74,900	2,150.00	161,035,000	
新日本空調	13,200	1,828.00	24,129,600	
九電工	38,500	2,865.00	110,302,500	
三機工業	32,400	1,444.00	46,785,600	
日揮ホールディングス	153,500	1,505.00	231,017,500	貸付有価証券 100株
中外炉工業	5,000	1,519.00	7,595,000	
ヤマト	14,600	777.00	11,344,200	
太平電業	11,000	2,676.00	29,436,000	
高砂熱学工業	45,000	1,684.00	75,780,000	
三晃金属工業	2,000	2,487.00	4,974,000	
朝日工業社	6,700	1,522.00	10,197,400	
明星工業	32,200	680.00	21,896,000	
大気社	24,200	3,155.00	76,351,000	
ダイダン	11,100	2,066.00	22,932,600	
日比谷総合設備	16,000	1,884.00	30,144,000	貸付有価証券 100株
フィル・カンパニー	2,900	1,176.00	3,410,400	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
テスホールディングス	10,400	1,388.00	14,435,200	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
インフロニア・ホールディングス	212,400	966.00	205,178,400	貸付有価証券 2,500株
レイズネクスト	24,000	1,058.00	25,392,000	
ニッポン	46,700	1,669.00	77,942,300	
日清製粉グループ本社	180,200	1,726.00	311,025,200	貸付有価証券 2,400株
日東富士製粉	2,300	4,225.00	9,717,500	
昭和産業	15,100	2,590.00	39,109,000	
鳥越製粉	14,100	642.00	9,052,200	貸付有価証券 400株（400株）
中部飼料	18,000	1,019.00	18,342,000	
フィード・ワン	20,900	662.00	13,835,800	貸付有価証券 100株
東洋精糖	2,700	993.00	2,681,100	
日本甜菜製糖	8,300	1,642.00	13,628,600	
DM三井製糖ホールディングス	14,500	1,934.00	28,043,000	

塩水港精糖	19,000	210.00	3,990,000	貸付有価証券 1,100株（400株）
日新製糖	7,500	1,682.00	12,615,000	
森永製菓	37,400	3,995.00	149,413,000	
中村屋	3,800	3,125.00	11,875,000	
江崎グリコ	43,900	3,680.00	161,552,000	貸付有価証券 200株
名糖産業	7,000	1,620.00	11,340,000	
井村屋グループ	9,000	2,226.00	20,034,000	
不二家	8,900	2,365.00	21,048,500	貸付有価証券 4,100株
山崎製パン	119,500	1,566.00	187,137,000	貸付有価証券 1,800株
第一屋製パン	3,100	525.00	1,627,500	
モロゾフ	5,100	2,988.00	15,238,800	
亀田製菓	9,100	4,050.00	36,855,000	
寿スピリッツ	15,400	6,800.00	104,720,000	貸付有価証券 200株
カルビー	72,700	2,320.00	168,664,000	貸付有価証券 2,600株
森永乳業	29,500	5,100.00	150,450,000	
六甲バター	11,600	1,510.00	17,516,000	貸付有価証券 200株
ヤクルト本社	118,100	6,660.00	786,546,000	貸付有価証券 100株
明治ホールディングス	105,400	6,410.00	675,614,000	貸付有価証券 1,000株
雪印メグミルク	38,400	1,926.00	73,958,400	貸付有価証券 900株
プリマハム	19,900	2,164.00	43,063,600	
日本ハム	60,900	4,095.00	249,385,500	
林兼産業	4,800	498.00	2,390,400	
丸大食品	15,700	1,484.00	23,298,800	貸付有価証券 100株（100株）
S Foods	14,300	3,015.00	43,114,500	貸付有価証券 500株（500株）
柿安本店	5,500	2,343.00	12,886,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	102,700	659.00	67,679,300	貸付有価証券 300株
サッポロホールディング	54,400	2,415.00	131,376,000	貸付有価証券

ス				1,900株
アサヒグループホールディングス	375,100	4,548.00	1,705,954,800	貸付有価証券 3,700株
キリンホールディングス	586,100	1,817.00	1,064,943,700	貸付有価証券 16,900株
宝ホールディングス	108,400	1,060.00	114,904,000	貸付有価証券 6,000株
オエノンホールディングス	45,300	314.00	14,224,200	
養命酒製造	4,900	1,740.00	8,526,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	111,900	1,443.00	161,471,700	
サントリー食品インターナショナル	106,700	4,950.00	528,165,000	貸付有価証券 500株
ダイドーグループホールディングス	8,200	4,920.00	40,344,000	貸付有価証券 700株
伊藤園	48,400	5,320.00	257,488,000	貸付有価証券 700株
キーコーヒー	15,700	2,004.00	31,462,800	
ユニカフェ	4,800	925.00	4,440,000	貸付有価証券 2,200株（100株）
ジャパンフーズ	2,300	1,131.00	2,601,300	
日清オイリオグループ	20,000	2,936.00	58,720,000	
不二製油グループ本社	34,600	1,807.00	62,522,200	貸付有価証券 500株
かどや製油	1,700	3,565.00	6,060,500	
J-オイルミルズ	14,900	1,584.00	23,601,600	
キッコーマン	114,800	8,360.00	959,728,000	
味の素	352,200	3,393.00	1,195,014,600	
ブルドックソース	6,700	1,921.00	12,870,700	貸付有価証券 3,100株（200株）
キューピー	83,800	2,162.00	181,175,600	貸付有価証券 13,400株
ハウス食品グループ本社	59,600	2,956.00	176,177,600	
カゴメ	60,500	3,260.00	197,230,000	貸付有価証券 300株
焼津水産化学工業	7,700	891.00	6,860,700	
アリアケジャパン	14,600	4,945.00	72,197,000	
ピエトロ	2,100	1,772.00	3,721,200	貸付有価証券 900株

エバラ食品工業	3,500	2,811.00	9,838,500	貸付有価証券 100株（100株）
やまみ	1,400	1,677.00	2,347,800	
ニチレイ	72,700	2,306.00	167,646,200	貸付有価証券 700株
東洋水産	76,600	3,970.00	304,102,000	
イートアンドホールディングス	6,000	2,120.00	12,720,000	
大冷	1,800	1,880.00	3,384,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,200	535.00	4,387,000	貸付有価証券 800株
日清食品ホールディングス	61,700	8,900.00	549,130,000	
永谷園ホールディングス	7,100	1,927.00	13,681,700	
一正蒲鉾	6,900	815.00	5,623,500	
フジッコ	14,800	2,030.00	30,044,000	
ロック・フィールド	17,200	1,474.00	25,352,800	貸付有価証券 8,000株
日本たばこ産業	855,000	2,210.50	1,889,977,500	
ケンコーマヨネーズ	8,900	1,398.00	12,442,200	
わらべや日洋ホールディングス	10,400	1,682.00	17,492,800	貸付有価証券 900株
なとり	8,900	1,992.00	17,728,800	
イフジ産業	2,800	1,000.00	2,800,000	
ピクルスコーポレーション	7,600	1,302.00	9,895,200	
ファーマフーズ	15,100	1,723.00	26,017,300	貸付有価証券 7,000株（2,500株）
ユーグレナ	81,200	910.00	73,892,000	貸付有価証券 37,100株（32,200株）
紀文食品	9,300	1,042.00	9,690,600	
ミヨシ油脂	6,100	1,138.00	6,941,800	貸付有価証券 2,800株
理研ビタミン	16,600	1,649.00	27,373,400	
片倉工業	17,400	2,305.00	40,107,000	
グンゼ	9,900	3,730.00	36,927,000	
東洋紡	61,500	1,058.00	65,067,000	
ユニチカ	42,700	278.00	11,870,600	
富士紡ホールディングス	6,900	3,120.00	21,528,000	

倉敷紡績	13,300	1,724.00	22,929,200	
シキボウ	8,200	872.00	7,150,400	
日本毛織	46,900	948.00	44,461,200	貸付有価証券 2,300株（200株）
ダイトウボウ	25,200	90.00	2,268,000	貸付有価証券 1,700株（1,000株）
トーア紡コーポレーショ ン	5,700	378.00	2,154,600	
ダイドーリミテッド	20,500	136.00	2,788,000	貸付有価証券 9,100株
帝国繊維	17,600	1,631.00	28,705,600	
帝人	146,500	1,374.00	201,291,000	
東レ	1,126,700	623.70	702,722,790	貸付有価証券 2,300株
住江織物	3,000	1,873.00	5,619,000	貸付有価証券 1,400株
日本フェルト	8,800	423.00	3,722,400	
イチカワ	2,000	1,416.00	2,832,000	
日東製網	1,700	1,604.00	2,726,800	
アツギ	12,000	521.00	6,252,000	
ダイニツク	5,900	717.00	4,230,300	
セーレン	31,900	2,049.00	65,363,100	貸付有価証券 8,500株
ソトー	5,700	843.00	4,805,100	
東海染工	1,800	1,134.00	2,041,200	
小松マテーレ	25,500	1,440.00	36,720,000	
ワコールホールディング ス	38,800	1,845.00	71,586,000	
ホギメディカル	21,000	3,195.00	67,095,000	貸付有価証券 800株
クラウディアホールディ ングス	3,800	233.00	885,400	
T S I ホールディングス	52,000	309.00	16,068,000	
マツオカコーポレーショ ン	5,000	1,094.00	5,470,000	
ワールド	20,400	1,304.00	26,601,600	
三陽商会	7,500	853.00	6,397,500	
ナイガイ	5,300	303.00	1,605,900	貸付有価証券 100株
オンワードホールディン	93,500	250.00	23,375,000	貸付有価証券

グス				6,100株
ルックホールディングス	4,900	1,463.00	7,168,700	
ゴールドウイン	28,100	6,200.00	174,220,000	
デサント	30,400	2,605.00	79,192,000	貸付有価証券 100株
キング	7,300	506.00	3,693,800	
ヤマトインターナショナル	13,700	290.00	3,973,000	貸付有価証券 2,800株
特種東海製紙	9,600	3,480.00	33,408,000	
王子ホールディングス	650,500	623.00	405,261,500	貸付有価証券 300株
日本製紙	74,600	1,047.00	78,106,200	貸付有価証券 19,900株
三菱製紙	22,100	308.00	6,806,800	
北越コーポレーション	102,000	657.00	67,014,000	
中越パルプ工業	5,900	948.00	5,593,200	
巴川製紙所	4,600	805.00	3,703,000	
大王製紙	75,000	1,514.00	113,550,000	
阿波製紙	4,000	346.00	1,384,000	
レンゴー	147,100	780.00	114,738,000	貸付有価証券 6,600株
トモク	9,500	1,526.00	14,497,000	
ザ・パックス	11,800	2,501.00	29,511,800	貸付有価証券 100株
北の達人コーポレーション	55,700	178.00	9,914,600	貸付有価証券 25,800株（14,500株）
クラレ	227,600	1,044.00	237,614,400	貸付有価証券 600株
旭化成	1,031,400	1,085.50	1,119,584,700	貸付有価証券 1,700株
共和レザー	9,700	658.00	6,382,600	
昭和電工	135,000	2,432.00	328,320,000	
住友化学	1,143,300	556.00	635,674,800	貸付有価証券 3,700株
住友精化	6,900	3,040.00	20,976,000	
日産化学	84,600	6,990.00	591,354,000	
ラサ工業	5,500	1,456.00	8,008,000	
クレハ	12,300	10,120.00	124,476,000	
多木化学	6,100	5,010.00	30,561,000	貸付有価証券

				1,100株
テイカ	11,400	1,194.00	13,611,600	
石原産業	25,900	1,017.00	26,340,300	
片倉コープアグリ	3,500	1,276.00	4,466,000	
日本曹達	19,900	3,430.00	68,257,000	
東ソー	224,500	1,778.00	399,161,000	
トクヤマ	49,800	1,678.00	83,564,400	貸付有価証券 1,400株
セントラル硝子	25,400	2,350.00	59,690,000	
東亜合成	86,500	1,078.00	93,247,000	
大阪ソーダ	14,500	3,190.00	46,255,000	貸付有価証券 500株
関東電化工業	34,100	989.00	33,724,900	
デンカ	56,800	3,420.00	194,256,000	
信越化学工業	267,200	17,770.00	4,748,144,000	
日本カーバイド工業	5,600	1,377.00	7,711,200	
堺化学工業	10,900	1,852.00	20,186,800	貸付有価証券 3,500株
第一稀元素化学工業	14,400	967.00	13,924,800	
エア・ウォーター	147,300	1,671.00	246,138,300	
日本酸素ホールディングス	149,500	2,219.00	331,740,500	
日本化学工業	4,800	2,252.00	10,809,600	
東邦アセチレン	2,600	1,109.00	2,883,400	
日本パーカライジング	78,500	919.00	72,141,500	貸付有価証券 100株
高压ガス工業	24,700	645.00	15,931,500	貸付有価証券 100株
チタン工業	1,800	1,709.00	3,076,200	
四国化成工業	20,300	1,316.00	26,714,800	貸付有価証券 100株
戸田工業	3,300	2,525.00	8,332,500	貸付有価証券 100株
ステラ ケミファ	7,800	2,427.00	18,930,600	
保土谷化学工業	5,000	3,795.00	18,975,000	
日本触媒	26,200	5,320.00	139,384,000	貸付有価証券 3,100株
大日精化工業	12,900	1,953.00	25,193,700	
カネカ	40,300	3,505.00	141,251,500	

三菱瓦斯化学	144,800	1,878.00	271,934,400	貸付有価証券 11,200株
三井化学	141,300	2,931.00	414,150,300	
J S R	145,000	3,580.00	519,100,000	貸付有価証券 200株
東京応化工業	25,200	7,020.00	176,904,000	貸付有価証券 300株
大阪有機化学工業	13,300	2,809.00	37,359,700	貸付有価証券 100株
三菱ケミカルホールディ ングス	1,040,200	790.20	821,966,040	貸付有価証券 4,000株
KHネオケム	25,700	2,480.00	63,736,000	
ダイセル	224,200	780.00	174,876,000	
住友ベークライト	24,500	4,480.00	109,760,000	
積水化学工業	325,600	1,695.00	551,892,000	
日本ゼオン	140,300	1,305.00	183,091,500	貸付有価証券 1,400株
アイカ工業	43,300	2,960.00	128,168,000	貸付有価証券 10,300株（3,000株）
U B E	73,300	2,012.00	147,479,600	貸付有価証券 3,700株
積水樹脂	23,500	1,757.00	41,289,500	
タキロンシーアイ	33,700	544.00	18,332,800	
旭有機材	8,800	1,873.00	16,482,400	
ニチバン	9,200	1,703.00	15,667,600	貸付有価証券 500株
リケンテクノス	38,000	440.00	16,720,000	
大倉工業	8,000	1,831.00	14,648,000	
積水化成工業	20,900	429.00	8,966,100	
群栄化学工業	3,600	2,800.00	10,080,000	
タイガースポリマー	8,200	421.00	3,452,200	
ミライアル	5,000	1,694.00	8,470,000	
ダイキアクシス	6,100	724.00	4,416,400	貸付有価証券 2,600株
ダイキョーニシカワ	32,800	513.00	16,826,400	貸付有価証券 200株
竹本容器	5,600	835.00	4,676,000	
森六ホールディングス	8,400	1,767.00	14,842,800	
恵和	4,200	4,875.00	20,475,000	

日本化薬	117,800	1,128.00	132,878,400	
カーリットホールディングス	15,400	634.00	9,763,600	
日本精化	12,500	2,053.00	25,662,500	貸付有価証券 1,000株
扶桑化学工業	14,000	3,835.00	53,690,000	
トリケミカル研究所	16,000	2,529.00	40,464,000	
A D E K A	71,700	2,616.00	187,567,200	貸付有価証券 100株
日油	53,100	4,825.00	256,207,500	
新日本理化	25,800	256.00	6,604,800	
ハリマ化成グループ	11,600	787.00	9,129,200	
花王	351,500	5,203.00	1,828,854,500	貸付有価証券 25,500株
第一工業製薬	5,800	2,625.00	15,225,000	
石原ケミカル	7,800	1,259.00	9,820,200	
日華化学	5,200	786.00	4,087,200	貸付有価証券 100株
ニイタカ	3,200	2,330.00	7,456,000	
三洋化成工業	9,300	4,945.00	45,988,500	
有機合成薬品工業	10,800	268.00	2,894,400	
大日本塗料	19,100	768.00	14,668,800	
日本ペイントホールディングス	584,700	1,048.00	612,765,600	貸付有価証券 40,700株
関西ペイント	161,400	1,770.00	285,678,000	貸付有価証券 100株
神東塗料	12,200	154.00	1,878,800	貸付有価証券 1,000株
中国塗料	36,700	919.00	33,727,300	貸付有価証券 17,200株
日本特殊塗料	11,600	799.00	9,268,400	
藤倉化成	19,400	447.00	8,671,800	
太陽ホールディングス	22,900	3,105.00	71,104,500	
D I C	65,700	2,449.00	160,899,300	貸付有価証券 2,300株
サカティンクス	30,900	941.00	29,076,900	貸付有価証券 1,400株
東洋インキ S C ホールディングス	32,900	1,941.00	63,858,900	貸付有価証券 500株
T & K T O K A	12,500	797.00	9,962,500	

富士フイルムホールディングス	279,200	7,349.00	2,051,840,800	
資生堂	296,000	6,154.00	1,821,584,000	貸付有価証券 31,000株
ライオン	187,600	1,313.00	246,318,800	貸付有価証券 36,300株
高砂香料工業	10,900	2,591.00	28,241,900	
マンダム	33,300	1,296.00	43,156,800	
ミルボン	19,600	5,380.00	105,448,000	
ファンケル	64,300	2,543.00	163,514,900	貸付有価証券 700株
コーセー	29,900	12,900.00	385,710,000	貸付有価証券 2,500株
コタ	11,100	1,404.00	15,584,400	
シーボン	2,100	1,706.00	3,582,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	67,800	1,518.00	102,920,400	貸付有価証券 6,400株
ノエビアホールディングス	13,500	4,935.00	66,622,500	
アジュバンホールディングス	3,600	1,050.00	3,780,000	
新日本製薬	4,300	1,406.00	6,045,800	
エステー	10,200	1,481.00	15,106,200	貸付有価証券 300株
アグロ カネショウ	5,300	1,129.00	5,983,700	貸付有価証券 2,400株
コニシ	26,100	1,519.00	39,645,900	
長谷川香料	27,400	2,572.00	70,472,800	
星光PMC	9,000	576.00	5,184,000	
小林製薬	44,500	9,440.00	420,080,000	貸付有価証券 200株
荒川化学工業	13,200	1,042.00	13,754,400	
メック	11,900	2,645.00	31,475,500	
日本高純度化学	4,400	2,409.00	10,599,600	
タカラバイオ	41,600	2,157.00	89,731,200	貸付有価証券 1,400株
J C U	17,900	3,305.00	59,159,500	
新田ゼラチン	10,000	633.00	6,330,000	
O A Tアグリオ	6,600	1,163.00	7,675,800	
デクセリアルズ	41,400	2,978.00	123,289,200	貸付有価証券

				100株
アース製薬	13,100	5,330.00	69,823,000	
北興化学工業	14,800	1,015.00	15,022,000	
大成ラミック	4,900	2,606.00	12,769,400	
クミアイ化学工業	59,100	878.00	51,889,800	貸付有価証券 100株
日本農薬	28,300	602.00	17,036,600	
アキレス	10,200	1,306.00	13,321,200	
有沢製作所	23,200	912.00	21,158,400	貸付有価証券 300株
日東電工	96,000	8,770.00	841,920,000	
レック	20,700	873.00	18,071,100	
三光合成	18,200	340.00	6,188,000	
きもと	24,300	218.00	5,297,400	貸付有価証券 300株
藤森工業	14,300	3,550.00	50,765,000	
前澤化成工業	10,100	1,266.00	12,786,600	貸付有価証券 3,200株
未来工業	5,700	1,482.00	8,447,400	
ウェーブロックホール ディングス	6,000	672.00	4,032,000	
J S P	9,300	1,516.00	14,098,800	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	29,200	2,859.00	83,482,800	
天馬	12,500	2,256.00	28,200,000	貸付有価証券 5,800株
信越ポリマー	28,500	1,092.00	31,122,000	
東リ	39,600	221.00	8,751,600	
ニフコ	53,000	2,676.00	141,828,000	貸付有価証券 3,800株
バルカー	12,900	2,597.00	33,501,300	
ユニ・チャーム	306,200	4,368.00	1,337,481,600	貸付有価証券 100株
ショーエイコーポレー ション	4,300	572.00	2,459,600	貸付有価証券 700株（200株）
協和キリン	186,500	2,709.00	505,228,500	貸付有価証券 9,400株
武田薬品工業	1,248,800	3,738.00	4,668,014,400	貸付有価証券 5,900株
アステラス製薬	1,377,600	2,057.50	2,834,412,000	

住友ファーマ	98,100	1,123.00	110,166,300	貸付有価証券 1,200株
塩野義製薬	199,800	6,955.00	1,389,609,000	貸付有価証券 4,500株
わかもと製薬	18,900	282.00	5,329,800	貸付有価証券 1,200株
日本新薬	41,600	8,900.00	370,240,000	貸付有価証券 700株
中外製薬	497,000	4,141.00	2,058,077,000	貸付有価証券 20,700株
科研製薬	24,900	3,865.00	96,238,500	
エーザイ	190,200	5,653.00	1,075,200,600	
ロート製薬	81,600	3,370.00	274,992,000	
小野薬品工業	364,900	3,247.00	1,184,830,300	
久光製薬	42,000	3,375.00	141,750,000	
持田製薬	20,000	3,630.00	72,600,000	
参天製薬	296,500	1,052.00	311,918,000	貸付有価証券 200株
扶桑薬品工業	5,600	2,082.00	11,659,200	
日本ケミファ	1,900	1,990.00	3,781,000	
ツムラ	49,200	3,155.00	155,226,000	貸付有価証券 1,800株
日医工	49,300	769.00	37,911,700	
キッセイ薬品工業	28,100	2,504.00	70,362,400	
生化学工業	28,000	841.00	23,548,000	貸付有価証券 200株
栄研化学	27,900	1,692.00	47,206,800	
日水製薬	5,800	986.00	5,718,800	
鳥居薬品	8,500	3,195.00	27,157,500	
J C Rファーマ	44,800	2,350.00	105,280,000	
東和薬品	22,900	2,662.00	60,959,800	
富士製薬工業	9,800	937.00	9,182,600	
ゼリア新薬工業	28,800	1,931.00	55,612,800	貸付有価証券 1,200株
第一三共	1,248,600	2,940.00	3,670,884,000	
キョーリン製薬ホールディングス	31,900	1,795.00	57,260,500	
大幸薬品	23,900	595.00	14,220,500	貸付有価証券 10,700株（1,800株）

ダイト	10,400	2,571.00	26,738,400	
大塚ホールディングス	330,200	4,233.00	1,397,736,600	貸付有価証券 23,500株
大正製薬ホールディングス	37,800	4,865.00	183,897,000	貸付有価証券 900株
ペプチドリーム	83,400	1,929.00	160,878,600	貸付有価証券 300株
あすか製薬ホールディングス	18,100	1,158.00	20,959,800	
サワイグループホールディングス	34,800	4,300.00	149,640,000	貸付有価証券 3,300株
日本コークス工業	134,200	140.00	18,788,000	
ニチレキ	20,300	1,178.00	23,913,400	
ユシロ化学工業	8,200	1,015.00	8,323,000	
ビーピー・カストロール	5,700	1,266.00	7,216,200	
富士石油	42,400	288.00	12,211,200	
MORESCO	5,300	1,186.00	6,285,800	貸付有価証券 100株（100株）
出光興産	176,300	3,445.00	607,353,500	
ENEOSホールディングス	2,390,200	455.20	1,088,019,040	貸付有価証券 2,400株
コスモエネルギーホールディングス	46,000	3,240.00	149,040,000	貸付有価証券 3,400株
横浜ゴム	92,000	1,717.00	157,964,000	貸付有価証券 1,800株
TOYO TIRE	83,600	1,467.00	122,641,200	
ブリヂストン	457,700	4,687.00	2,145,239,900	貸付有価証券 94,100株
住友ゴム工業	142,700	1,125.00	160,537,500	貸付有価証券 40,800株
藤倉コンポジット	12,700	703.00	8,928,100	貸付有価証券 2,100株
オカモト	9,400	3,895.00	36,613,000	
フコク	6,900	925.00	6,382,500	
ニッタ	16,400	2,719.00	44,591,600	
住友理工	30,800	562.00	17,309,600	
三ツ星ベルト	19,300	1,983.00	38,271,900	
バンドー化学	25,600	840.00	21,504,000	
日東紡績	23,600	2,494.00	58,858,400	
AGC	145,900	4,905.00	715,639,500	貸付有価証券

			9,400株
日本板硝子	76,300	403.00	30,748,900 貸付有価証券 7,700株
石塚硝子	2,700	1,980.00	5,346,000
日本山村硝子	6,000	801.00	4,806,000
日本電気硝子	63,800	2,638.00	168,304,400 貸付有価証券 3,700株
オハラ	6,300	1,139.00	7,175,700 貸付有価証券 300株
住友大阪セメント	29,400	3,945.00	115,983,000 貸付有価証券 3,500株
太平洋セメント	90,300	2,061.00	186,108,300 貸付有価証券 5,200株
日本ヒューム	15,900	666.00	10,589,400
日本コンクリート工業	31,400	302.00	9,482,800 貸付有価証券 100株
三谷セキサン	7,400	5,320.00	39,368,000 貸付有価証券 3,200株
アジアパイルホールディ ングス	24,400	429.00	10,467,600
東海カーボン	133,200	1,061.00	141,325,200
日本カーボン	8,200	4,195.00	34,399,000
東洋炭素	10,400	2,898.00	30,139,200
ノリタケカンパニーリミ テド	8,800	4,130.00	36,344,000
TOTO	113,500	4,420.00	501,670,000 貸付有価証券 300株
日本碍子	172,100	1,735.00	298,593,500
日本特殊陶業	120,900	1,941.00	234,666,900 貸付有価証券 2,100株
ダントーホールディング ス	10,400	240.00	2,496,000 貸付有価証券 6,300株
MARUWA	5,500	15,300.00	84,150,000
品川リフラクトリーズ	3,700	3,660.00	13,542,000
黒崎播磨	2,700	4,075.00	11,002,500
ヨータイ	10,100	1,320.00	13,332,000
東京窯業	20,200	286.00	5,777,200 貸付有価証券 200株
ニッカトー	7,200	499.00	3,592,800
フジミインコーポレー	12,700	5,740.00	72,898,000

テッド				
クニミネ工業	5,000	997.00	4,985,000	
エーアンドエーマテリアル	2,700	876.00	2,365,200	
ニチアス	36,800	2,385.00	87,768,000	
ニチハ	22,100	2,338.00	51,669,800	
日本製鉄	703,200	2,081.50	1,463,710,800	貸付有価証券 7,100株
神戸製鋼所	293,300	574.00	168,354,200	貸付有価証券 1,800株
中山製鋼所	24,900	426.00	10,607,400	貸付有価証券 300株
合同製鐵	8,500	1,302.00	11,067,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	424,300	1,618.00	686,517,400	貸付有価証券 3,400株
東京製鐵	53,500	1,197.00	64,039,500	
共英製鋼	17,700	1,327.00	23,487,900	
大和工業	30,000	3,840.00	115,200,000	
東京鐵鋼	6,900	1,288.00	8,887,200	
大阪製鐵	8,300	1,507.00	12,508,100	貸付有価証券 2,000株
淀川製鋼所	20,600	2,599.00	53,539,400	
丸一鋼管	49,700	2,816.00	139,955,200	貸付有価証券 5,500株
モリ工業	4,600	2,527.00	11,624,200	
大同特殊鋼	25,700	3,585.00	92,134,500	
日本高周波鋼業	5,800	329.00	1,908,200	貸付有価証券 100株
日本冶金工業	11,500	2,589.00	29,773,500	
山陽特殊製鋼	16,100	2,063.00	33,214,300	
愛知製鋼	8,800	2,301.00	20,248,800	
日立金属	169,300	1,990.00	336,907,000	貸付有価証券 9,700株（9,000株）
日本金属	4,000	1,286.00	5,144,000	
大平洋金属	9,700	3,685.00	35,744,500	
新日本電工	101,400	319.00	32,346,600	貸付有価証券 1,600株
栗本鐵工所	7,100	1,595.00	11,324,500	
虹技	2,200	929.00	2,043,800	

日本鑄鉄管	1,600	1,040.00	1,664,000	
三菱製鋼	10,100	1,063.00	10,736,300	
日亜鋼業	20,400	261.00	5,324,400	
日本精線	2,600	4,275.00	11,115,000	
エンビプロ・ホールディングス	10,400	1,028.00	10,691,200	貸付有価証券 4,800株
シンニッタン	19,000	215.00	4,085,000	貸付有価証券 500株
新家工業	3,900	1,575.00	6,142,500	
大紀アルミニウム工業所	23,700	1,508.00	35,739,600	貸付有価証券 10,200株
日本軽金属ホールディングス	39,800	1,653.00	65,789,400	貸付有価証券 400株
三井金属鉱業	42,400	3,360.00	142,464,000	貸付有価証券 200株
東邦亜鉛	8,700	2,896.00	25,195,200	貸付有価証券 1,200株
三菱マテリアル	103,800	2,057.00	213,516,600	貸付有価証券 100株
住友金属鉱山	200,800	6,093.00	1,223,474,400	
DOWAホールディングス	42,800	5,810.00	248,668,000	貸付有価証券 1,200株
古河機械金属	25,900	1,265.00	32,763,500	貸付有価証券 100株
大阪チタニウムテクノロジーズ	18,200	1,377.00	25,061,400	
東邦チタニウム	28,100	1,497.00	42,065,700	
UACJ	23,800	2,168.00	51,598,400	貸付有価証券 8,900株
CKサンエツ	3,300	4,100.00	13,530,000	
古河電気工業	48,800	2,129.00	103,895,200	貸付有価証券 3,100株
住友電気工業	587,500	1,417.50	832,781,250	貸付有価証券 200株
フジクラ	175,100	577.00	101,032,700	貸付有価証券 4,400株
昭和電線ホールディングス	13,700	1,729.00	23,687,300	
東京特殊電線	2,400	2,648.00	6,355,200	
タツタ電線	27,700	463.00	12,825,100	
カナレ電気	2,300	1,622.00	3,730,600	貸付有価証券

				1,000株
平河ヒューテック	8,700	1,087.00	9,456,900	貸付有価証券 100株
リョービ	19,300	1,051.00	20,284,300	貸付有価証券 300株
アーレスティ	16,700	359.00	5,995,300	
アサヒホールディングス	62,900	2,146.00	134,983,400	
稲葉製作所	8,800	1,295.00	11,396,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,800	3,485.00	16,728,000	
トーカロ	40,500	1,282.00	51,921,000	
アルファC O	6,000	970.00	5,820,000	
SUMCO	241,800	1,930.00	466,674,000	貸付有価証券 57,800株
川田テクノロジーズ	3,200	3,545.00	11,344,000	
RS Technologies	5,100	5,960.00	30,396,000	貸付有価証券 100株
ジェイテックコーポレーション	2,000	1,709.00	3,418,000	貸付有価証券 400株（400株）
信和	9,700	780.00	7,566,000	
東洋製罐グループホールディングス	100,100	1,401.00	140,240,100	
ホッカンホールディングス	8,600	1,276.00	10,973,600	貸付有価証券 300株（300株）
コロナ	8,700	838.00	7,290,600	
横河ブリッジホールディングス	27,000	1,871.00	50,517,000	
駒井ハルテック	2,900	1,952.00	5,660,800	
高田機工	1,400	2,818.00	3,945,200	貸付有価証券 600株
三和ホールディングス	148,100	1,169.00	173,128,900	
文化シャッター	49,900	961.00	47,953,900	貸付有価証券 500株（500株）
三協立山	20,200	592.00	11,958,400	
アルインコ	11,400	853.00	9,724,200	
東洋シャッター	3,500	579.00	2,026,500	
LIXIL	247,300	2,232.00	551,973,600	
日本ファイルコン	10,900	510.00	5,559,000	
ノーリツ	30,100	1,502.00	45,210,200	
長府製作所	16,000	1,870.00	29,920,000	

リンナイ	29,600	8,250.00	244,200,000	貸付有価証券 1,100株
ダイニチ工業	7,500	647.00	4,852,500	
日東精工	19,700	492.00	9,692,400	
三洋工業	1,900	1,846.00	3,507,400	
岡部	30,000	662.00	19,860,000	貸付有価証券 300株
ジーテクト	19,500	1,276.00	24,882,000	
東プレ	29,300	1,111.00	32,552,300	
高周波熱錬	28,100	581.00	16,326,100	貸付有価証券 500株
東京製綱	9,600	866.00	8,313,600	
サンコール	13,400	493.00	6,606,200	
モリテック スチール	12,200	314.00	3,830,800	
パイオラックス	22,500	1,526.00	34,335,000	
エイチワン	15,400	594.00	9,147,600	
日本発條	144,500	843.00	121,813,500	貸付有価証券 1,400株
中央発條	7,600	703.00	5,342,800	
アドバネクス	2,000	1,731.00	3,462,000	
立川ブラインド工業	6,900	1,125.00	7,762,500	
三益半導体工業	12,300	2,360.00	29,028,000	
日本ドライケミカル	3,900	1,682.00	6,559,800	
日本製鋼所	47,700	3,655.00	174,343,500	
三浦工業	68,000	2,705.00	183,940,000	貸付有価証券 5,500株
タクマ	53,200	1,389.00	73,894,800	
ツガミ	34,500	1,213.00	41,848,500	
オークマ	18,300	4,725.00	86,467,500	貸付有価証券 400株
芝浦機械	17,700	3,180.00	56,286,000	
アマダ	248,000	1,018.00	252,464,000	
アイダエンジニアリング	41,100	975.00	40,072,500	貸付有価証券 2,600株
滝澤鉄工所	4,500	1,208.00	5,436,000	
F U J I	72,400	2,140.00	154,936,000	
牧野フライス製作所	17,200	3,975.00	68,370,000	
オーエスジー	72,700	1,636.00	118,937,200	

ダイジェット工業	1,800	953.00	1,715,400	貸付有価証券 800株（800株）
旭ダイヤモンド工業	41,200	567.00	23,360,400	貸付有価証券 200株
DMG森精機	93,200	1,665.00	155,178,000	
ソディック	34,500	716.00	24,702,000	
ディスコ	23,100	32,450.00	749,595,000	貸付有価証券 400株
日東工器	8,600	1,466.00	12,607,600	
日進工具	12,300	1,422.00	17,490,600	
パンチ工業	13,200	473.00	6,243,600	
富士ダイス	7,900	637.00	5,032,300	
豊和工業	8,000	790.00	6,320,000	
OKK	5,600	1,161.00	6,501,600	貸付有価証券 2,600株
東洋機械金属	10,200	583.00	5,946,600	
津田駒工業	3,000	607.00	1,821,000	貸付有価証券 100株
エンシュウ	3,400	688.00	2,339,200	
島精機製作所	23,000	1,859.00	42,757,000	貸付有価証券 400株
オプトラン	19,700	1,941.00	38,237,700	
NCホールディングス	4,400	1,654.00	7,277,600	
イワキポンプ	10,000	1,048.00	10,480,000	
フリュー	14,000	1,046.00	14,644,000	
ヤマシンフィルタ	31,700	354.00	11,221,800	貸付有価証券 300株
日阪製作所	19,400	770.00	14,938,000	
やまびこ	30,500	1,430.00	43,615,000	
野村マイクロ・サイエンス	4,100	3,575.00	14,657,500	貸付有価証券 1,900株
平田機工	7,400	4,855.00	35,927,000	貸付有価証券 100株
ペガサスミシン製造	15,900	624.00	9,921,600	
マルマエ	6,400	2,200.00	14,080,000	貸付有価証券 3,000株（1,400株）
タツモ	7,300	1,524.00	11,125,200	
ナブテスコ	89,600	3,130.00	280,448,000	貸付有価証券 1,500株

三井海洋開発	16,700	1,228.00	20,507,600	
レオン自動機	16,800	1,061.00	17,824,800	
SMC	46,500	65,920.00	3,065,280,000	
ホソカワミクロン	11,000	2,471.00	27,181,000	
ユニオンツール	5,900	3,680.00	21,712,000	
オイレス工業	22,000	1,484.00	32,648,000	貸付有価証券 100株
日精エー・エス・ビー機 械	5,300	2,937.00	15,566,100	
サトーホールディングス	20,700	1,731.00	35,831,700	
技研製作所	13,900	3,505.00	48,719,500	
日本エアーテック	7,200	1,045.00	7,524,000	貸付有価証券 500株（500株）
カワタ	5,000	998.00	4,990,000	
日精樹脂工業	11,000	946.00	10,406,000	
オカダアイヨン	5,000	1,584.00	7,920,000	
ワイエイシイホールディ ングス	6,300	1,538.00	9,689,400	
小松製作所	720,100	2,998.00	2,158,859,800	
住友重機械工業	90,900	2,754.00	250,338,600	貸付有価証券 300株
日立建機	63,700	3,230.00	205,751,000	貸付有価証券 200株
日工	21,700	605.00	13,128,500	
巴工業	6,200	2,289.00	14,191,800	貸付有価証券 1,500株
井関農機	14,700	1,248.00	18,345,600	
TOWA	13,600	2,143.00	29,144,800	貸付有価証券 6,000株
丸山製作所	3,200	1,549.00	4,956,800	
北川鉄工所	7,100	1,250.00	8,875,000	
ローツェ	7,800	12,040.00	93,912,000	
タカキタ	5,500	597.00	3,283,500	貸付有価証券 2,500株（200株）
クボタ	769,700	2,269.00	1,746,449,300	貸付有価証券 83,500株
荏原実業	7,300	2,365.00	17,264,500	
三菱化工機	5,100	1,930.00	9,843,000	
月島機械	29,300	1,010.00	29,593,000	貸付有価証券

				100株
帝国電機製作所	11,100	1,594.00	17,693,400	
東京機械製作所	6,500	759.00	4,933,500	貸付有価証券 2,700株
新東工業	35,000	681.00	23,835,000	
澁谷工業	13,900	2,326.00	32,331,400	
アイチ コーポレーショ ン	22,600	884.00	19,978,400	
小森コーポレーション	40,300	709.00	28,572,700	貸付有価証券 200株
鶴見製作所	12,200	1,834.00	22,374,800	
住友精密工業	2,400	2,064.00	4,953,600	
日本ギア工業	5,600	261.00	1,461,600	
酒井重工業	2,800	3,210.00	8,988,000	
荏原製作所	63,500	6,120.00	388,620,000	貸付有価証券 7,600株
石井鐵工所	2,200	2,955.00	6,501,000	
西島製作所	14,400	1,261.00	18,158,400	
北越工業	14,900	826.00	12,307,400	
ダイキン工業	202,400	20,535.00	4,156,284,000	
オルガノ	4,600	8,850.00	40,710,000	
トーヨーカネツ	6,000	2,409.00	14,454,000	
栗田工業	86,000	4,370.00	375,820,000	
椿本チエイン	20,800	2,949.00	61,339,200	
大同工業	7,000	919.00	6,433,000	貸付有価証券 100株
木村化工機	13,200	812.00	10,718,400	貸付有価証券 2,300株
アネスト岩田	24,700	823.00	20,328,100	
ダイフク	87,400	8,270.00	722,798,000	貸付有価証券 300株
サムコ	4,000	2,452.00	9,808,000	貸付有価証券 400株
加藤製作所	7,500	784.00	5,880,000	
油研工業	2,700	1,666.00	4,498,200	
タダノ	83,000	915.00	75,945,000	
フジテック	58,900	2,947.00	173,578,300	貸付有価証券 4,900株
C K D	46,900	1,697.00	79,589,300	

キトー	13,500	1,715.00	23,152,500	
平和	44,300	1,878.00	83,195,400	
理想科学工業	11,800	2,309.00	27,246,200	
SANKYO	34,300	3,590.00	123,137,000	
日本金銭機械	16,100	705.00	11,350,500	
マースグループホールディングス	10,100	1,706.00	17,230,600	
フクシマガリレイ	10,900	3,720.00	40,548,000	
オーイズミ	5,500	459.00	2,524,500	
ダイコク電機	7,300	1,242.00	9,066,600	貸付有価証券 2,600株
竹内製作所	24,200	2,329.00	56,361,800	
アマノ	41,600	2,090.00	86,944,000	貸付有価証券 400株
JUKI	22,100	839.00	18,541,900	
ジャノメ	13,500	681.00	9,193,500	
マックス	21,100	1,561.00	32,937,100	
グローリー	40,800	2,047.00	83,517,600	貸付有価証券 7,300株
新晃工業	14,800	1,605.00	23,754,000	
大和冷機工業	23,000	1,082.00	24,886,000	
セガサミーホールディングス	157,600	2,191.00	345,301,600	
日本ピストンリング	5,800	1,286.00	7,458,800	
リケン	6,800	2,393.00	16,272,400	
T P R	21,400	1,263.00	27,028,200	貸付有価証券 700株
ツバキ・ナカシマ	34,900	939.00	32,771,100	貸付有価証券 600株
ホシザキ	46,400	8,080.00	374,912,000	
大豊工業	13,000	654.00	8,502,000	
日本精工	299,100	721.00	215,651,100	貸付有価証券 13,800株
NTN	341,500	209.00	71,373,500	貸付有価証券 1,300株
ジェイテクト	152,400	901.00	137,312,400	
不二越	13,500	3,735.00	50,422,500	貸付有価証券 200株
日本トムソン	43,500	513.00	22,315,500	

THK	89,700	2,627.00	235,641,900	貸付有価証券 2,000株
ユーシン精機	12,300	639.00	7,859,700	
前澤給装工業	11,900	926.00	11,019,400	
イーグル工業	19,600	1,008.00	19,756,800	
前澤工業	10,600	619.00	6,561,400	
日本ピラー工業	16,100	2,664.00	42,890,400	
キッツ	53,500	659.00	35,256,500	貸付有価証券 1,100株
マキタ	193,400	3,805.00	735,887,000	貸付有価証券 200株
三井E&Sホールディングス	57,400	363.00	20,836,200	貸付有価証券 11,800株（5,700株）
日立造船	134,300	695.00	93,338,500	
三菱重工業	249,600	4,432.00	1,106,227,200	貸付有価証券 3,500株
I H I	99,200	3,035.00	301,072,000	貸付有価証券 700株
サノヤスホールディングス	19,600	126.00	2,469,600	貸付有価証券 200株
スター精密	23,600	1,490.00	35,164,000	
日清紡ホールディングス	97,200	976.00	94,867,200	貸付有価証券 4,300株
イビデン	83,400	5,450.00	454,530,000	
コニカミノルタ	347,100	484.00	167,996,400	貸付有価証券 1,000株
ブラザー工業	194,000	2,239.00	434,366,000	貸付有価証券 2,900株
ミネベアミツミ	273,900	2,564.00	702,279,600	
日立製作所	764,200	6,081.00	4,647,100,200	
東芝	277,700	5,400.00	1,499,580,000	貸付有価証券 6,100株
三菱電機	1,588,800	1,376.00	2,186,188,800	貸付有価証券 2,300株
富士電機	95,700	5,780.00	553,146,000	
東洋電機製造	5,800	939.00	5,446,200	貸付有価証券 100株
安川電機	171,000	4,530.00	774,630,000	貸付有価証券 2,600株
シンフォニアテクノロ	19,100	1,258.00	24,027,800	

ジー				
明電舎	26,900	2,333.00	62,757,700	
オリジン	4,000	1,394.00	5,576,000	
山洋電気	7,000	4,555.00	31,885,000	
デンヨー	13,500	1,620.00	21,870,000	
PHCホールディングス	18,300	1,793.00	32,811,900	貸付有価証券 300株
東芝テック	17,100	4,520.00	77,292,000	
芝浦メカトロニクス	2,800	7,550.00	21,140,000	
マブチモーター	36,800	3,655.00	134,504,000	貸付有価証券 1,400株
日本電産	411,800	8,960.00	3,689,728,000	貸付有価証券 400株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	7,000	399.00	2,793,000	貸付有価証券 600株（600株）
トレックス・セミコンダ クター	8,000	2,334.00	18,672,000	
東光高岳	8,800	1,581.00	13,912,800	貸付有価証券 600株
ダブル・スコープ	45,700	1,003.00	45,837,100	貸付有価証券 6,500株（4,800株）
ダイヘン	17,400	3,670.00	63,858,000	
ヤーマン	25,900	1,217.00	31,520,300	貸付有価証券 12,100株
JVCケンウッド	129,400	184.00	23,809,600	
ミマキエンジニアリング	14,200	670.00	9,514,000	
IPEX	7,400	1,409.00	10,426,600	貸付有価証券 100株
日新電機	37,200	1,360.00	50,592,000	
大崎電気工業	29,200	496.00	14,483,200	
オムロン	132,300	7,736.00	1,023,472,800	貸付有価証券 100株
日東工業	20,000	1,524.00	30,480,000	
IDEC	19,700	2,288.00	45,073,600	
正興電機製作所	5,000	1,154.00	5,770,000	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
不二電機工業	3,000	1,088.00	3,264,000	
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	51,700	2,277.00	117,720,900	貸付有価証券 1,800株
サクサホールディングス	3,700	1,505.00	5,568,500	

メルコホールディングス	3,500	3,840.00	13,440,000	
テクノメディカ	3,600	1,530.00	5,508,000	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	4,400	1,000.00	4,400,000	貸付有価証券 2,000株（1,700株）
日本電気	201,900	5,140.00	1,037,766,000	
富士通	143,000	19,005.00	2,717,715,000	
沖電気工業	64,500	838.00	54,051,000	
岩崎通信機	6,500	853.00	5,544,500	
電気興業	8,300	2,373.00	19,695,900	
サンケン電気	14,900	4,880.00	72,712,000	貸付有価証券 3,400株
ナカヨ	2,800	1,084.00	3,035,200	
アイホン	9,000	2,001.00	18,009,000	
ルネサスエレクトロニク ス	862,500	1,374.00	1,185,075,000	貸付有価証券 200株
セイコーエプソン	197,100	1,795.00	353,794,500	貸付有価証券 3,700株
ワコム	123,200	936.00	115,315,200	貸付有価証券 57,900株
アルバック	31,700	5,250.00	166,425,000	貸付有価証券 2,700株
アクセル	6,600	963.00	6,355,800	貸付有価証券 600株（600株）
E I Z O	12,300	3,380.00	41,574,000	
日本信号	40,500	903.00	36,571,500	貸付有価証券 100株
京三製作所	34,100	428.00	14,594,800	
能美防災	21,000	1,880.00	39,480,000	貸付有価証券 400株
ホーチキ	11,400	1,190.00	13,566,000	
星和電機	7,200	514.00	3,700,800	貸付有価証券 200株
エレコム	36,400	1,509.00	54,927,600	貸付有価証券 100株
パナソニック ホール ディングス	1,694,600	1,155.00	1,957,263,000	
シャープ	181,100	1,113.00	201,564,300	貸付有価証券 31,700株
アンリツ	102,300	1,625.00	166,237,500	貸付有価証券

				47,200株（100株）
富士通ゼネラル	43,100	2,325.00	100,207,500	貸付有価証券 100株
ソニーグループ	995,300	11,280.00	11,226,984,000	
T D K	230,100	4,070.00	936,507,000	
帝国通信工業	7,000	1,406.00	9,842,000	
タムラ製作所	61,200	560.00	34,272,000	貸付有価証券 10,700株
アルプスアルパイン	140,600	1,213.00	170,547,800	
池上通信機	4,700	610.00	2,867,000	
日本電波工業	15,900	1,168.00	18,571,200	貸付有価証券 700株
鈴木	7,800	742.00	5,787,600	
メイコー	12,900	3,435.00	44,311,500	
日本トリム	3,000	2,456.00	7,368,000	
ローランド ディー. ジー.	9,400	3,330.00	31,302,000	
フォスター電機	16,000	688.00	11,008,000	
SMK	3,700	2,165.00	8,010,500	
ヨコオ	11,800	2,473.00	29,181,400	
ティアック	25,700	116.00	2,981,200	貸付有価証券 1,000株（700株）
ホシデン	38,300	1,246.00	47,721,800	貸付有価証券 300株
ヒロセ電機	24,500	16,500.00	404,250,000	
日本航空電子工業	36,400	2,024.00	73,673,600	
T O A	17,000	687.00	11,679,000	貸付有価証券 100株
マクセル	31,600	1,165.00	36,814,000	
古野電気	18,900	951.00	17,973,900	
ユニデンホールディング ス	3,500	3,470.00	12,145,000	
スミダコーポレーション	14,900	832.00	12,396,800	
アイコム	5,900	2,374.00	14,006,600	
リオン	6,100	2,271.00	13,853,100	
本多通信工業	12,300	456.00	5,608,800	貸付有価証券 5,400株
横河電機	159,000	2,162.00	343,758,000	貸付有価証券 100株

新電元工業	6,100	2,972.00	18,129,200	
アズビル	93,100	3,985.00	371,003,500	
東亜ディーケーケー	7,800	928.00	7,238,400	貸付有価証券 200株（200株）
日本光電工業	65,700	3,080.00	202,356,000	
チノー	5,000	1,599.00	7,995,000	貸付有価証券 700株
共和電業	15,200	356.00	5,411,200	
日本電子材料	8,100	1,974.00	15,989,400	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
堀場製作所	29,400	6,170.00	181,398,000	貸付有価証券 600株
アドバンテスト	118,100	8,520.00	1,006,212,000	
小野測器	6,600	502.00	3,313,200	
エスベック	12,900	1,736.00	22,394,400	貸付有価証券 100株
キーエンス	144,000	53,440.00	7,695,360,000	
日置電機	7,600	8,110.00	61,636,000	
シスメックス	134,400	8,778.00	1,179,763,200	貸付有価証券 2,600株
日本マイクロニクス	27,600	1,538.00	42,448,800	貸付有価証券 300株
メガチップス	14,100	3,460.00	48,786,000	
OBARA GROUP	7,200	2,889.00	20,800,800	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
澤藤電機	1,900	1,459.00	2,772,100	
原田工業	7,500	896.00	6,720,000	貸付有価証券 3,400株
コーセル	17,600	757.00	13,323,200	
イリソ電子工業	13,300	3,045.00	40,498,500	
オブテックスグループ	26,100	1,734.00	45,257,400	貸付有価証券 100株
千代田インテグレ	6,700	2,154.00	14,431,800	
アイ・オー・データ機器	5,100	1,298.00	6,619,800	
レーザーテック	69,800	18,275.00	1,275,595,000	貸付有価証券 4,900株
スタンレー電気	110,900	2,200.00	243,980,000	貸付有価証券 6,600株
岩崎電気	5,800	2,302.00	13,351,600	
ウシオ電機	81,400	1,737.00	141,391,800	

岡谷電機産業	11,300	280.00	3,164,000	貸付有価証券 600株
ヘリオス テクノ ホールディング	13,500	288.00	3,888,000	
エノモト	4,400	1,524.00	6,705,600	
日本セラミック	14,800	2,366.00	35,016,800	
遠藤照明	7,300	905.00	6,606,500	
古河電池	11,300	1,214.00	13,718,200	貸付有価証券 1,400株（1,300株）
双信電機	7,600	600.00	4,560,000	
山一電機	11,500	1,680.00	19,320,000	貸付有価証券 100株
図研	10,300	2,910.00	29,973,000	
日本電子	33,000	5,960.00	196,680,000	貸付有価証券 100株
カシオ計算機	115,000	1,357.00	156,055,000	貸付有価証券 7,100株
ファナック	139,400	21,005.00	2,928,097,000	
日本シイエムケイ	31,100	541.00	16,825,100	貸付有価証券 100株
エンプラス	3,900	2,835.00	11,056,500	
大真空	21,400	1,181.00	25,273,400	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ローム	71,100	9,290.00	660,519,000	
浜松ホトニクス	114,000	5,850.00	666,900,000	
三井ハイテック	15,600	11,710.00	182,676,000	貸付有価証券 5,100株（5,100株）
新光電気工業	46,700	5,720.00	267,124,000	
京セラ	223,500	6,857.00	1,532,539,500	
太陽誘電	77,100	5,140.00	396,294,000	貸付有価証券 500株
村田製作所	466,700	7,819.00	3,649,127,300	
双葉電子工業	27,200	656.00	17,843,200	
北陸電気工業	5,900	1,143.00	6,743,700	
ニチコン	50,000	1,178.00	58,900,000	貸付有価証券 1,800株
日本ケミコン	15,000	1,825.00	27,375,000	
K O A	24,000	1,377.00	33,048,000	
市光工業	19,000	383.00	7,277,000	貸付有価証券

				600株
小糸製作所	87,200	4,700.00	409,840,000	
ミツバ	29,200	347.00	10,132,400	
S C R E E Nホールディングス	27,600	10,730.00	296,148,000	貸付有価証券 300株
キャノン電子	14,600	1,595.00	23,287,000	
キャノン	789,500	3,029.00	2,391,395,500	貸付有価証券 50,300株
リコー	440,900	940.00	414,446,000	貸付有価証券 9,200株
象印マホービン	43,000	1,355.00	58,265,000	貸付有価証券 600株
M U T O Hホールディングス	2,000	2,082.00	4,164,000	貸付有価証券 300株（100株）
東京エレクトロン	100,800	55,480.00	5,592,384,000	
トヨタ紡織	64,800	1,937.00	125,517,600	
芦森工業	3,000	909.00	2,727,000	
ユニプレス	23,700	752.00	17,822,400	貸付有価証券 300株
豊田自動織機	128,600	7,830.00	1,006,938,000	
モリタホールディングス	25,500	1,220.00	31,110,000	
三櫻工業	22,000	709.00	15,598,000	
デンソー	349,800	7,579.00	2,651,134,200	貸付有価証券 200株
東海理化電機製作所	41,800	1,472.00	61,529,600	貸付有価証券 200株
川崎重工業	116,000	2,363.00	274,108,000	貸付有価証券 1,300株
名村造船所	47,700	420.00	20,034,000	貸付有価証券 21,700株
日本車輛製造	5,800	2,162.00	12,539,600	
三菱ロジスネクスト	21,000	766.00	16,086,000	
近畿車輛	2,400	1,213.00	2,911,200	
日産自動車	1,873,800	536.90	1,006,043,220	貸付有価証券 5,100株
いすゞ自動車	498,600	1,542.00	768,841,200	
トヨタ自動車	8,048,000	2,210.00	17,786,080,000	
日野自動車	198,400	693.00	137,491,200	貸付有価証券 7,000株
三菱自動車工業	588,100	319.00	187,603,900	貸付有価証券

				111,900株
エフテック	11,100	531.00	5,894,100	貸付有価証券 300株
レシップホールディングス	6,300	571.00	3,597,300	
GMB	2,900	721.00	2,090,900	
ファルテック	2,800	640.00	1,792,000	
武蔵精密工業	35,400	1,348.00	47,719,200	貸付有価証券 9,000株
日産車体	23,300	537.00	12,512,100	貸付有価証券 900株
新明和工業	44,900	908.00	40,769,200	
極東開発工業	29,500	1,299.00	38,320,500	
トピー工業	13,100	1,018.00	13,335,800	
ティラド	4,500	2,291.00	10,309,500	
タチエス	27,800	1,005.00	27,939,000	貸付有価証券 200株
NOK	76,900	1,112.00	85,512,800	
フタバ産業	39,800	335.00	13,333,000	
KYB	16,500	2,894.00	47,751,000	
大同メタル工業	30,500	555.00	16,927,500	
プレス工業	78,700	377.00	29,669,900	貸付有価証券 1,200株
ミクニ	20,200	383.00	7,736,600	貸付有価証券 400株
太平洋工業	33,300	906.00	30,169,800	
河西工業	19,500	274.00	5,343,000	貸付有価証券 600株
アイシン	116,300	3,915.00	455,314,500	貸付有価証券 6,700株
マツダ	498,700	924.00	460,798,800	貸付有価証券 17,200株
今仙電機製作所	10,400	581.00	6,042,400	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,251,000	3,379.00	4,227,129,000	貸付有価証券 3,200株
スズキ	363,400	4,071.00	1,479,401,400	貸付有価証券 1,200株
SUBARU	455,300	1,944.00	885,103,200	
安永	7,700	730.00	5,621,000	

ヤマハ発動機	207,300	2,748.00	569,660,400	貸付有価証券 4,400株
T B K	17,400	349.00	6,072,600	
エクセディ	24,000	1,539.00	36,936,000	
豊田合成	51,300	1,858.00	95,315,400	
愛三工業	24,900	686.00	17,081,400	貸付有価証券 300株
盟和産業	2,200	1,021.00	2,246,200	
日本プラスト	12,400	487.00	6,038,800	
ヨロズ	14,800	803.00	11,884,400	貸付有価証券 400株
エフ・シー・シー	26,000	1,291.00	33,566,000	貸付有価証券 200株
シマノ	63,500	25,255.00	1,603,692,500	
テイ・エス テック	67,100	1,361.00	91,323,100	
ジャムコ	9,300	816.00	7,588,800	
テルモ	449,600	3,895.00	1,751,192,000	
クリエートメディック	4,800	998.00	4,790,400	
日機装	47,600	809.00	38,508,400	
日本エム・ディ・エム	9,100	1,630.00	14,833,000	
島津製作所	204,500	4,140.00	846,630,000	
J M S	13,400	591.00	7,919,400	
クボテック	3,400	255.00	867,000	貸付有価証券 100株（100株）
長野計器	11,500	1,129.00	12,983,500	
ブイ・テクノロジー	6,900	3,020.00	20,838,000	
東京計器	10,100	1,172.00	11,837,200	
愛知時計電機	6,800	1,507.00	10,247,600	
インターアクション	7,900	1,864.00	14,725,600	貸付有価証券 900株（900株）
オーバル	14,200	315.00	4,473,000	貸付有価証券 300株
東京精密	26,800	4,535.00	121,538,000	
マニー	63,300	1,489.00	94,253,700	
ニコン	242,600	1,501.00	364,142,600	貸付有価証券 5,400株
トプコン	74,700	1,737.00	129,753,900	
オリンパス	833,200	2,395.00	1,995,514,000	貸付有価証券 800株

理研計器	12,800	4,285.00	54,848,000	
タムロン	12,300	2,284.00	28,093,200	貸付有価証券 100株
HOYA	310,000	12,950.00	4,014,500,000	
シード	7,400	493.00	3,648,200	貸付有価証券 100株
ノーリツ銅機	14,300	2,160.00	30,888,000	貸付有価証券 1,500株
A&Dホロンホールディングス	17,900	893.00	15,984,700	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
朝日インテック	174,200	2,728.00	475,217,600	貸付有価証券 700株
シチズン時計	186,100	498.00	92,677,800	貸付有価証券 18,100株
リズム	5,000	1,577.00	7,885,000	
大研医器	12,600	510.00	6,426,000	
メニコン	52,700	2,776.00	146,295,200	貸付有価証券 1,100株
シンシア	1,700	464.00	788,800	
松風	6,600	1,555.00	10,263,000	
セイコーホールディングス	22,500	2,171.00	48,847,500	貸付有価証券 300株
ニプロ	118,400	1,014.00	120,057,600	
中本パックス	4,400	1,526.00	6,714,400	
スノーピーク	20,700	2,570.00	53,199,000	貸付有価証券 9,700株（200株）
パラマウントベッドホールディングス	30,500	2,100.00	64,050,000	貸付有価証券 1,900株
トランザクション	8,700	1,032.00	8,978,400	貸付有価証券 600株
粧美堂	4,600	416.00	1,913,600	貸付有価証券 2,000株
ニホンフラッシュ	13,600	964.00	13,110,400	貸付有価証券 200株
前田工織	17,500	2,859.00	50,032,500	貸付有価証券 3,300株
永大産業	20,800	287.00	5,969,600	
アートネイチャー	13,600	712.00	9,683,200	
バンダイナムコホールディングス	142,400	8,910.00	1,268,784,000	貸付有価証券 100株
アイフィスジャパン	4,000	633.00	2,532,000	貸付有価証券

				1,700株
共立印刷	26,600	134.00	3,564,400	貸付有価証券 100株
SHOEI	14,900	4,845.00	72,190,500	貸付有価証券 100株
フランスベッドホールディングス	20,400	871.00	17,768,400	貸付有価証券 300株
パイロットコーポレーション	26,800	5,250.00	140,700,000	貸付有価証券 100株
萩原工業	10,300	1,078.00	11,103,400	貸付有価証券 2,200株
フジシールインターナショナル	38,600	1,707.00	65,890,200	
タカラトミー	65,600	1,221.00	80,097,600	
広済堂ホールディングス	9,800	806.00	7,898,800	貸付有価証券 1,200株
エステールホールディングス	3,800	643.00	2,443,400	貸付有価証券 1,800株
タカノ	5,400	731.00	3,947,400	貸付有価証券 2,300株
プロネクサス	12,300	1,027.00	12,632,100	
ホクシン	11,200	203.00	2,273,600	貸付有価証券 500株
ウッドワン	4,900	1,496.00	7,330,400	
大建工業	9,400	2,093.00	19,674,200	
凸版印刷	241,500	2,132.00	514,878,000	
大日本印刷	187,800	2,687.00	504,618,600	貸付有価証券 2,800株
共同印刷	4,500	2,711.00	12,199,500	
NISSHA	32,600	1,409.00	45,933,400	
光村印刷	1,400	1,331.00	1,863,400	
TAKARA & COMPANY	9,700	1,835.00	17,799,500	貸付有価証券 2,100株
アシックス	140,500	2,150.00	302,075,000	貸付有価証券 200株
ツツミ	4,000	1,851.00	7,404,000	
ローランド	11,100	4,505.00	50,005,500	
小松ウオール工業	4,800	1,801.00	8,644,800	
ヤマハ	92,400	5,230.00	483,252,000	
河合楽器製作所	4,400	2,953.00	12,993,200	

クリナップ	14,800	521.00	7,710,800	
ピジョン	96,000	2,060.00	197,760,000	貸付有価証券 7,000株
兼松サステック	1,000	1,736.00	1,736,000	
キングジム	14,000	931.00	13,034,000	貸付有価証券 200株
リンテック	34,000	2,415.00	82,110,000	
イトーキ	29,300	342.00	10,020,600	
任天堂	89,700	63,520.00	5,697,744,000	
三菱鉛筆	26,200	1,245.00	32,619,000	
タカスタンダード	32,800	1,289.00	42,279,200	
コクヨ	76,200	1,663.00	126,720,600	貸付有価証券 100株
ナカバヤシ	14,200	487.00	6,915,400	
グローブライド	14,200	2,676.00	37,999,200	
オカムラ	54,600	1,167.00	63,718,200	
美津濃	15,700	2,102.00	33,001,400	
東京電力ホールディングス	1,189,100	464.00	551,742,400	
中部電力	486,100	1,310.00	636,791,000	
関西電力	602,000	1,210.00	728,420,000	
中国電力	248,300	871.00	216,269,300	貸付有価証券 300株
北陸電力	145,300	541.00	78,607,300	貸付有価証券 800株
東北電力	372,100	728.00	270,888,800	
四国電力	143,100	773.00	110,616,300	
九州電力	327,500	831.00	272,152,500	
北海道電力	138,100	495.00	68,359,500	貸付有価証券 300株
沖縄電力	33,700	1,306.00	44,012,200	
電源開発	135,400	1,785.00	241,689,000	貸付有価証券 100株
エフオン	9,600	549.00	5,270,400	貸付有価証券 4,300株
イーレックス	23,400	1,872.00	43,804,800	貸付有価証券 200株
レノバ	31,100	1,494.00	46,463,400	貸付有価証券 14,600株（400株）

東京瓦斯	304,600	2,319.00	706,367,400	貸付有価証券 200株
大阪瓦斯	287,800	2,135.00	614,453,000	貸付有価証券 600株
東邦瓦斯	72,700	2,556.00	185,821,200	
北海道瓦斯	7,900	1,463.00	11,557,700	
広島ガス	30,300	314.00	9,514,200	
西部ガスホールディングス	17,900	1,954.00	34,976,600	
静岡ガス	41,300	889.00	36,715,700	貸付有価証券 600株
メタウォーター	16,500	1,989.00	32,818,500	
S B Sホールディングス	11,800	3,030.00	35,754,000	
東武鉄道	155,200	2,983.00	462,961,600	
相鉄ホールディングス	50,800	2,296.00	116,636,800	
東急	400,700	1,608.00	644,325,600	
京浜急行電鉄	204,000	1,320.00	269,280,000	貸付有価証券 1,500株
小田急電鉄	236,300	2,033.00	480,397,900	貸付有価証券 5,400株
京王電鉄	82,400	4,995.00	411,588,000	貸付有価証券 1,400株
京成電鉄	110,600	3,400.00	376,040,000	
富士急行	19,000	4,070.00	77,330,000	
新京成電鉄	3,700	2,206.00	8,162,200	
東日本旅客鉄道	279,600	6,917.00	1,933,993,200	
西日本旅客鉄道	192,600	4,962.00	955,681,200	
東海旅客鉄道	132,100	16,170.00	2,136,057,000	
西武ホールディングス	207,400	1,306.00	270,864,400	
鴻池運輸	25,300	1,116.00	28,234,800	
西日本鉄道	44,000	2,627.00	115,588,000	
ハマキョウレックス	11,300	2,824.00	31,911,200	
サカイ引越センター	7,300	4,310.00	31,463,000	
近鉄グループホールディングス	150,500	3,745.00	563,622,500	
阪急阪神ホールディングス	188,200	3,485.00	655,877,000	
南海電気鉄道	67,100	2,379.00	159,630,900	
京阪ホールディングス	67,000	2,839.00	190,213,000	

神戸電鉄	3,600	3,250.00	11,700,000	貸付有価証券 1,500株
名古屋鉄道	123,700	2,109.00	260,883,300	
山陽電気鉄道	11,600	2,032.00	23,571,200	貸付有価証券 100株
アルプス物流	10,500	1,039.00	10,909,500	貸付有価証券 300株（300株）
ヤマトホールディングス	210,800	2,399.00	505,709,200	貸付有価証券 200株
山九	39,600	3,910.00	154,836,000	貸付有価証券 200株
丸運	8,600	238.00	2,046,800	貸付有価証券 100株
丸全昭和運輸	12,200	3,040.00	37,088,000	
センコーグループホール ディングス	75,400	867.00	65,371,800	
トナミホールディングス	3,600	3,610.00	12,996,000	
ニッコンホールディング ス	50,500	1,898.00	95,849,000	
日本石油輸送	1,600	2,559.00	4,094,400	
福山通運	24,800	3,560.00	88,288,000	
セイノーホールディング ス	102,400	1,028.00	105,267,200	貸付有価証券 100株
エスライン	4,500	895.00	4,027,500	
神奈川中央交通	3,700	3,315.00	12,265,500	貸付有価証券 1,500株
日立物流	29,000	7,760.00	225,040,000	貸付有価証券 2,100株
丸和運輸機関	31,800	1,430.00	45,474,000	貸付有価証券 5,900株
C & F ロジホールディン グス	15,200	1,083.00	16,461,600	
九州旅客鉄道	116,400	2,561.00	298,100,400	
S Gホールディングス	284,300	2,228.00	633,420,400	
N I P P O N E X P R E S Sホールディン	52,100	7,650.00	398,565,000	
日本郵船	125,800	9,750.00	1,226,550,000	貸付有価証券 200株
商船三井	249,900	3,175.00	793,432,500	貸付有価証券 63,000株
川崎汽船	46,300	7,300.00	337,990,000	貸付有価証券

				3,800株
N S ユナイテッド海運	8,300	3,925.00	32,577,500	貸付有価証券 400株
明治海運	17,800	747.00	13,296,600	貸付有価証券 8,300株
飯野海運	69,800	758.00	52,908,400	貸付有価証券 200株
共栄タンカー	2,600	1,219.00	3,169,400	
乾汽船	10,300	1,704.00	17,551,200	貸付有価証券 1,600株（300株）
日本航空	345,000	2,203.00	760,035,000	
A N Aホールディングス	382,200	2,495.00	953,589,000	貸付有価証券 46,900株
パスコ	2,800	1,395.00	3,906,000	
トランコム	4,200	6,930.00	29,106,000	貸付有価証券 1,900株
日新	12,000	1,533.00	18,396,000	
三菱倉庫	47,700	2,990.00	142,623,000	貸付有価証券 1,700株
三井倉庫ホールディングス	16,000	2,400.00	38,400,000	
住友倉庫	53,200	2,186.00	116,295,200	
澁澤倉庫	9,000	2,227.00	20,043,000	
東陽倉庫	25,200	310.00	7,812,000	
日本トランスシティ	33,100	575.00	19,032,500	貸付有価証券 200株
ケイヒン	2,600	1,370.00	3,562,000	
中央倉庫	9,200	946.00	8,703,200	
川西倉庫	2,700	1,119.00	3,021,300	貸付有価証券 1,200株
安田倉庫	12,400	973.00	12,065,200	貸付有価証券 100株
ファイズホールディングス	3,200	693.00	2,217,600	貸付有価証券 200株
東洋埠頭	4,600	1,482.00	6,817,200	
上組	82,800	2,186.00	181,000,800	
サンリツ	4,100	782.00	3,206,200	
キムラユニティー	3,900	1,321.00	5,151,900	
キューソー流通システム	7,500	1,051.00	7,882,500	貸付有価証券 3,500株

近鉄エクスプレス	28,400	3,155.00	89,602,000	貸付有価証券 300株
東海運	8,600	296.00	2,545,600	
エーアイテイー	9,400	1,499.00	14,090,600	貸付有価証券 300株（300株）
内外トランスライン	5,800	1,794.00	10,405,200	貸付有価証券 2,500株
日本コンセプト	4,800	1,362.00	6,537,600	貸付有価証券 100株（100株）
NEC ネットズエスアイ	51,600	1,745.00	90,042,000	
クロスキャット	8,200	973.00	7,978,600	貸付有価証券 3,200株（1,400株）
システナ	222,400	407.00	90,516,800	貸付有価証券 200株
デジタルアーツ	8,400	7,440.00	62,496,000	
日鉄ソリューションズ	22,600	3,810.00	86,106,000	
キューブシステム	7,900	888.00	7,015,200	貸付有価証券 3,400株
WOW WORLD	2,200	1,116.00	2,455,200	貸付有価証券 1,000株
コア	6,600	1,559.00	10,289,400	
手間いらず	2,200	4,610.00	10,142,000	貸付有価証券 400株（400株）
ラクーンホールディングス	13,200	1,328.00	17,529,600	貸付有価証券 1,300株
ソリトンシステムズ	7,800	1,460.00	11,388,000	貸付有価証券 200株（200株）
ソフトクリエイイトホールディングス	6,800	4,210.00	28,628,000	
T I S	148,700	2,817.00	418,887,900	貸付有価証券 200株
J N S ホールディングス	7,200	387.00	2,786,400	貸付有価証券 300株
グリー	70,900	1,019.00	72,247,100	貸付有価証券 33,300株（5,400株）
GMOペパボ	1,600	2,048.00	3,276,800	貸付有価証券 100株（100株）
コーエーテクモホールディングス	49,700	3,920.00	194,824,000	貸付有価証券 1,500株
三菱総合研究所	6,700	3,855.00	25,828,500	
ボルテージ	4,200	361.00	1,516,200	貸付有価証券

				400株（100株）
電算	1,700	2,255.00	3,833,500	
A G S	7,900	786.00	6,209,400	貸付有価証券 200株
ファインデックス	13,100	663.00	8,685,300	
ブレインパッド	13,200	1,105.00	14,586,000	貸付有価証券 600株（600株）
K L a b	28,600	428.00	12,240,800	
ポールトゥウィン・ピット クルーホールディ	22,600	1,018.00	23,006,800	
ネクソン	352,000	2,927.00	1,030,304,000	貸付有価証券 60,000株
アイスタイル	40,200	163.00	6,552,600	貸付有価証券 7,400株（7,200株）
エムアップホールディングス	18,000	993.00	17,874,000	
エイチーム	10,700	741.00	7,928,700	貸付有価証券 100株（100株）
エニグモ	16,800	530.00	8,904,000	
テクノスジャパン	12,100	434.00	5,251,400	
e n i s h	10,100	290.00	2,929,000	貸付有価証券 900株
コロプラ	51,300	639.00	32,780,700	貸付有価証券 1,300株
オルトプラス	12,000	306.00	3,672,000	貸付有価証券 1,600株（200株）
ブロードリーフ	77,300	364.00	28,137,200	貸付有価証券 43,600株
クロス・マーケティング グループ	5,900	878.00	5,180,200	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
デジタルハーツホール ディングス	7,100	1,687.00	11,977,700	
システム情報	11,700	934.00	10,927,800	
メディアドゥ	5,500	1,791.00	9,850,500	
じげん	44,100	301.00	13,274,100	貸付有価証券 200株
ブイキューブ	15,900	911.00	14,484,900	貸付有価証券 7,400株（5,400株）
エンカレッジ・テクノロ ジ	3,400	525.00	1,785,000	
サイバーリンクス	5,200	1,099.00	5,714,800	

ディー・エル・イー	10,400	294.00	3,057,600	貸付有価証券 4,800株（2,800株）
フィックスターズ	16,600	805.00	13,363,000	貸付有価証券 700株
CARTA HOLDINGS	6,300	2,327.00	14,660,100	貸付有価証券 200株（200株）
オブティム	10,900	869.00	9,472,100	貸付有価証券 3,400株（3,400株）
セレス	5,800	1,423.00	8,253,400	
SHIFT	7,900	23,570.00	186,203,000	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
ティーガイア	13,800	1,622.00	22,383,600	
セック	2,300	2,169.00	4,988,700	
テクマトリックス	26,400	1,977.00	52,192,800	
プロシップ	5,200	1,394.00	7,248,800	貸付有価証券 100株（100株）
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40,500	2,453.00	99,346,500	貸付有価証券 500株
GMOペイメントゲートウェイ	30,200	10,530.00	318,006,000	貸付有価証券 100株
ザッパラス	6,100	447.00	2,726,700	
システムリサーチ	4,500	1,910.00	8,595,000	
インターネットイニシアティブ	41,500	3,955.00	164,132,500	
さくらインターネット	16,700	533.00	8,901,100	
ヴィンクス	4,400	1,133.00	4,985,200	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,500	5,290.00	18,515,000	貸付有価証券 1,600株（1,100株）
SRAホールディングス	7,500	2,766.00	20,745,000	
システムインテグレータ	4,900	459.00	2,249,100	
朝日ネット	14,200	568.00	8,065,600	
eBASE	18,600	443.00	8,239,800	
アバント	16,700	1,162.00	19,405,400	貸付有価証券 100株
アドソル日進	5,600	1,564.00	8,758,400	貸付有価証券 100株（100株）
ODKソリューションズ	3,200	590.00	1,888,000	
フリービット	8,100	863.00	6,990,300	貸付有価証券 3,800株
コムチュア	17,500	2,820.00	49,350,000	

サイバーコム	2,400	1,141.00	2,738,400	
アステリア	11,200	935.00	10,472,000	貸付有価証券 400株
アイル	8,600	1,398.00	12,022,800	
マークラインズ	7,800	2,566.00	20,014,800	
メディカル・データ・ビ ジョン	19,700	1,014.00	19,975,800	貸付有価証券 2,800株
g u m i	21,600	539.00	11,642,400	貸付有価証券 7,500株（7,500株）
ショーケース	3,400	459.00	1,560,600	
モバイルファクトリー	3,500	942.00	3,297,000	貸付有価証券 1,000株（900株）
テラスカイ	5,700	1,374.00	7,831,800	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	6,900	1,188.00	8,197,200	
P C I ホールディングス	7,000	981.00	6,867,000	
パイプドHD	2,800	2,243.00	6,280,400	
アイビーシー	2,500	502.00	1,255,000	貸付有価証券 300株（300株）
ネオジャパン	4,400	1,112.00	4,892,800	貸付有価証券 700株（700株）
P R T I M E S	3,300	2,044.00	6,745,200	貸付有価証券 1,500株（1,200株）
ラクス	53,600	1,573.00	84,312,800	貸付有価証券 20,000株
ランドコンピュータ	3,500	869.00	3,041,500	
ダブルスタンダード	4,700	1,826.00	8,582,200	
オープンドア	9,300	1,949.00	18,125,700	貸付有価証券 2,900株（2,200株）
マイネット	5,600	515.00	2,884,000	
アカツキ	7,000	3,055.00	21,385,000	
ベネフィットジャパン	1,200	2,131.00	2,557,200	
U b i c o mホールディ ングス	4,100	2,809.00	11,516,900	貸付有価証券 1,300株
カナミックネットワーク	16,600	498.00	8,266,800	
ノムラシステムコーポ レーション	8,000	224.00	1,792,000	貸付有価証券 600株（600株）
チェンジ	28,800	1,733.00	49,910,400	貸付有価証券 13,500株（3,500株）

シンクロ・フード	8,000	265.00	2,120,000	
オークネット	8,300	1,557.00	12,923,100	貸付有価証券 3,500株
キャピタル・アセット・ プランニング	3,100	733.00	2,272,300	
セグエグループ	4,000	559.00	2,236,000	
エイトレッド	2,200	2,006.00	4,413,200	貸付有価証券 1,300株
マクロミル	33,900	1,209.00	40,985,100	貸付有価証券 100株
ビーグリー	3,700	1,366.00	5,054,200	貸付有価証券 900株
オロ	4,900	1,987.00	9,736,300	貸付有価証券 300株（300株）
ユーザーローカル	4,700	1,674.00	7,867,800	
テモナ	3,400	400.00	1,360,000	
ニーズウェル	3,500	651.00	2,278,500	
マネーフォワード	23,700	4,695.00	111,271,500	貸付有価証券 3,000株
サインポスト	5,000	954.00	4,770,000	貸付有価証券 2,300株（100株）
電算システムホールディ ングス	6,400	2,563.00	16,403,200	
ソルクシーズ	13,200	393.00	5,187,600	
フェイス	4,100	697.00	2,857,700	
プロトコーポレーション	16,500	1,019.00	16,813,500	
ハイマックス	4,100	1,231.00	5,047,100	貸付有価証券 100株
野村総合研究所	301,200	3,995.00	1,203,294,000	
サイバネットシステム	11,100	788.00	8,746,800	貸付有価証券 100株
C Eホールディングス	8,200	471.00	3,862,200	貸付有価証券 100株
日本システム技術	3,100	2,420.00	7,502,000	
インテージホールディ ングス	17,900	1,600.00	28,640,000	
東邦システムサイエンス	4,100	908.00	3,722,800	貸付有価証券 1,700株
ソースネクスト	67,200	185.00	12,432,000	貸付有価証券 20,300株（13,700株）
インフォコム	17,000	2,109.00	35,853,000	

シンプレクス・ホールディングス	18,400	1,692.00	31,132,800	貸付有価証券 800株
HEROZ	4,400	950.00	4,180,000	貸付有価証券 100株
ラクスル	17,100	2,662.00	45,520,200	貸付有価証券 6,100株
I P S	4,300	2,019.00	8,681,700	
F I G	16,900	278.00	4,698,200	貸付有価証券 7,400株
システムサポート	5,600	1,006.00	5,633,600	
イーソル	9,500	619.00	5,880,500	貸付有価証券 2,100株（500株）
アルテリア・ネットワークス	19,700	1,316.00	25,925,200	
東海ソフト	2,400	955.00	2,292,000	
ウイングアーク1st	8,900	1,255.00	11,169,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,500	1,603.00	5,610,500	
サーバーワークス	2,700	2,025.00	5,467,500	貸付有価証券 800株（200株）
東名	1,400	789.00	1,104,600	
ヴィッツ	1,400	1,235.00	1,729,000	貸付有価証券 100株
トビラシシステムズ	3,100	814.00	2,523,400	
S a n s a n	55,500	1,242.00	68,931,000	貸付有価証券 20,600株
L i n k - U	2,800	673.00	1,884,400	貸付有価証券 400株（400株）
ギフトィ	14,200	1,020.00	14,484,000	貸付有価証券 6,600株（6,500株）
ベース	2,700	6,150.00	16,605,000	
JMDC	14,600	6,360.00	92,856,000	貸付有価証券 200株
フォーカスシステムズ	10,400	889.00	9,245,600	
クレスコ	11,300	1,832.00	20,701,600	
フジ・メディア・ホールディングス	150,200	1,114.00	167,322,800	貸付有価証券 300株
オービック	49,100	18,060.00	886,746,000	貸付有価証券 100株
ジャストシステム	22,200	5,290.00	117,438,000	

TDCソフト	13,600	1,114.00	15,150,400	
Zホールディングス	2,248,300	511.90	1,150,904,770	
トレンドマイクロ	83,300	7,020.00	584,766,000	貸付有価証券 3,200株
IDホールディングス	9,800	822.00	8,055,600	
日本オラクル	25,300	8,310.00	210,243,000	
アルファシステムズ	4,200	3,655.00	15,351,000	
フューチャー	32,900	1,494.00	49,152,600	貸付有価証券 600株
CAC Holdings	9,100	1,337.00	12,166,700	
SBテクノロジー	6,700	2,451.00	16,421,700	
トーセ	4,200	699.00	2,935,800	
オービックビジネスコン サルタント	14,900	4,195.00	62,505,500	
伊藤忠テクノソリュー ションズ	71,000	3,010.00	213,710,000	
アイティフォー	18,900	798.00	15,082,200	
東計電算	1,800	5,410.00	9,738,000	
エックスネット	2,400	1,003.00	2,407,200	
大塚商会	84,400	4,170.00	351,948,000	
サイボウズ	20,800	1,257.00	26,145,600	
電通国際情報サービス	22,500	3,640.00	81,900,000	
ACCESS	17,600	559.00	9,838,400	
デジタルガレージ	25,800	4,310.00	111,198,000	
EMシステムズ	25,700	875.00	22,487,500	
ウェザーニューズ	5,300	7,450.00	39,485,000	貸付有価証券 300株
C I J	12,100	760.00	9,196,000	
ビジネスエンジニアリン グ	1,800	3,860.00	6,948,000	
日本エンタープライズ	15,800	165.00	2,607,000	
WOWOW	7,500	1,479.00	11,092,500	貸付有価証券 3,200株
スカラ	13,100	744.00	9,746,400	
インテリジェント ウェ イブ	7,800	573.00	4,469,400	
IMAGICA GROUP	13,200	682.00	9,002,400	

ネットワンシステムズ	59,400	3,040.00	180,576,000	貸付有価証券 200株
システムソフト	33,500	102.00	3,417,000	貸付有価証券 9,600株
アルゴグラフィックス	12,100	3,025.00	36,602,500	
マーベラス	24,600	740.00	18,204,000	
エイベックス	26,900	1,408.00	37,875,200	
B I P R O G Y	48,700	3,170.00	154,379,000	
兼松エレクトロニクス	8,500	3,815.00	32,427,500	
都築電気	8,000	1,480.00	11,840,000	
T B S ホールディングス	93,100	1,680.00	156,408,000	貸付有価証券 2,700株
日本テレビホールディングス	130,100	1,227.00	159,632,700	
朝日放送グループホールディングス	15,500	708.00	10,974,000	貸付有価証券 400株（400株）
テレビ朝日ホールディングス	37,500	1,449.00	54,337,500	
スカパー J S A T ホールディングス	132,000	411.00	54,252,000	
テレビ東京ホールディングス	11,000	1,990.00	21,890,000	
日本BS放送	5,300	1,012.00	5,363,600	貸付有価証券 2,400株
ビジョン	26,700	1,277.00	34,095,900	貸付有価証券 2,300株
スマートパリュウ	3,500	562.00	1,967,000	貸付有価証券 500株（500株）
U S E N - N E X T H O L D I N G S	14,800	2,067.00	30,591,600	貸付有価証券 5,500株（400株）
ワイヤレスゲート	6,400	301.00	1,926,400	
コネクシオ	11,000	1,364.00	15,004,000	
日本通信	129,600	184.00	23,846,400	貸付有価証券 7,700株
クロップス	2,800	952.00	2,665,600	
日本電信電話	1,631,000	3,772.00	6,152,132,000	
K D D I	1,136,600	4,270.00	4,853,282,000	貸付有価証券 5,700株
ソフトバンク	2,361,400	1,489.50	3,517,305,300	貸付有価証券 36,100株
光通信	18,000	14,800.00	266,400,000	

エムティーアイ	15,100	474.00	7,157,400	貸付有価証券 100株
GMOインターネット	55,200	2,530.00	139,656,000	
ファイバーゲート	7,100	1,166.00	8,278,600	貸付有価証券 800株（500株）
アイドママーケティング コミュニケーション	3,300	286.00	943,800	
KADOKAWA	85,100	3,220.00	274,022,000	
学研ホールディングス	22,000	894.00	19,668,000	貸付有価証券 1,100株
ゼンリン	25,400	945.00	24,003,000	
昭文社ホールディングス	6,300	401.00	2,526,300	貸付有価証券 300株（300株）
インプレスホールディン グス	12,900	216.00	2,786,400	
アイネット	8,000	1,212.00	9,696,000	
松竹	10,300	13,030.00	134,209,000	
東宝	92,000	4,830.00	444,360,000	
東映	5,100	17,030.00	86,853,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	415,100	2,369.00	983,371,900	
ピー・シー・エー	9,100	1,508.00	13,722,800	貸付有価証券 600株
ビジネスブレイン太田昭 和	5,300	1,384.00	7,335,200	
D T S	29,900	2,759.00	82,494,100	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	72,500	5,020.00	363,950,000	貸付有価証券 3,900株
シーイーシー	16,700	1,174.00	19,605,800	貸付有価証券 300株
カプコン	147,000	2,965.00	435,855,000	貸付有価証券 9,000株
アイ・エス・ビー	7,300	1,078.00	7,869,400	貸付有価証券 700株
ジャステック	9,000	1,108.00	9,972,000	貸付有価証券 900株
S C S K	107,900	2,037.00	219,792,300	
日本システムウエア	5,900	2,220.00	13,098,000	
アイネス	14,100	1,461.00	20,600,100	
T K C	26,400	3,255.00	85,932,000	貸付有価証券

				400株
富士ソフト	16,600	6,750.00	112,050,000	貸付有価証券 300株（300株）
N S D	50,100	2,249.00	112,674,900	
コナミホールディングス	56,600	8,020.00	453,932,000	
福井コンピュータホールディングス	7,100	3,130.00	22,223,000	
J B C Cホールディングス	10,500	1,464.00	15,372,000	
ミロク情報サービス	13,700	1,298.00	17,782,600	
ソフトバンクグループ	934,900	5,411.00	5,058,743,900	
ハウスイ	1,200	1,217.00	1,460,400	
高千穂交易	6,000	1,497.00	8,982,000	貸付有価証券 2,200株
オルバヘルスケアホールディングス	2,500	1,664.00	4,160,000	
伊藤忠食品	3,800	4,975.00	18,905,000	貸付有価証券 300株（300株）
エレマテック	12,500	1,098.00	13,725,000	
J A L U X	1,300	2,553.00	3,318,900	
あらた	12,400	3,435.00	42,594,000	
トーメンデバイス	2,300	5,920.00	13,616,000	
東京エレクトロン デバイス	4,600	4,990.00	22,954,000	
フィールズ	13,700	876.00	12,001,200	貸付有価証券 500株（500株）
双日	172,900	2,014.00	348,220,600	貸付有価証券 6,200株
アルフレッサ ホールディングス	173,900	1,719.00	298,934,100	貸付有価証券 3,500株
横浜冷凍	43,900	853.00	37,446,700	
神栄	2,100	897.00	1,883,700	
ラサ商事	7,700	986.00	7,592,200	
アルコニックス	19,400	1,410.00	27,354,000	
神戸物産	121,500	3,220.00	391,230,000	貸付有価証券 4,400株
ハイパー	3,900	461.00	1,797,900	
あい ホールディングス	22,300	1,677.00	37,397,100	
ディーブイエックス	5,300	1,004.00	5,321,200	
ダイワボウホールディン	76,100	1,571.00	119,553,100	

ダス				
マクニカ・富士エレホールディングス	37,300	2,622.00	97,800,600	貸付有価証券 700株
ラクト・ジャパン	5,400	2,020.00	10,908,000	貸付有価証券 100株（100株）
グリムス	7,000	1,702.00	11,914,000	貸付有価証券 3,200株（1,400株）
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,200	740.00	20,128,000	
八洲電機	11,300	929.00	10,497,700	貸付有価証券 5,100株
メディアスホールディングス	8,900	947.00	8,428,300	貸付有価証券 100株
レスターホールディングス	14,800	2,010.00	29,748,000	
ジューテックホールディングス	3,600	1,150.00	4,140,000	貸付有価証券 1,600株
大光	6,600	726.00	4,791,600	貸付有価証券 3,100株
OCH I ホールディングス	4,500	1,254.00	5,643,000	
TOKA I ホールディングス	75,800	863.00	65,415,400	
黒谷	4,200	588.00	2,469,600	貸付有価証券 1,100株
C o m i n i x	2,700	711.00	1,919,700	
三洋貿易	15,700	969.00	15,213,300	
ビューティガレージ	2,500	2,729.00	6,822,500	貸付有価証券 1,100株（1,000株）
ウイン・パートナーズ	11,300	990.00	11,187,000	
ミタチ産業	3,900	882.00	3,439,800	
シップヘルスケアホールディングス	50,200	2,110.00	105,922,000	
明治電機工業	5,100	1,018.00	5,191,800	
デリカフーズホールディングス	6,100	530.00	3,233,000	貸付有価証券 2,600株
スターティアホールディングス	3,500	551.00	1,928,500	貸付有価証券 300株
コメダホールディングス	34,200	2,243.00	76,710,600	
ピーバンドットコム	2,200	548.00	1,205,600	
アセンテック	5,300	704.00	3,731,200	貸付有価証券

				2,400株
富士興産	3,900	870.00	3,393,000	
協栄産業	1,600	1,405.00	2,248,000	
フルサト・マルカホールディングス	15,000	3,270.00	49,050,000	貸付有価証券 600株
ヤマエグループホールディングス	10,500	1,015.00	10,657,500	
小野建	15,200	1,525.00	23,180,000	
南陽	3,200	1,840.00	5,888,000	貸付有価証券 100株
佐島電機	9,700	1,206.00	11,698,200	
エコートレーディング	3,300	571.00	1,884,300	
伯東	9,500	2,336.00	22,192,000	
コンドーテック	11,700	1,074.00	12,565,800	貸付有価証券 200株
中山福	8,200	349.00	2,861,800	貸付有価証券 100株（100株）
ナガイレーベン	20,700	1,914.00	39,619,800	貸付有価証券 100株
三菱食品	15,000	3,125.00	46,875,000	
松田産業	11,400	2,324.00	26,493,600	
第一興商	29,700	3,555.00	105,583,500	貸付有価証券 1,600株
メディバルホールディングス	168,900	2,049.00	346,076,100	貸付有価証券 300株
S P K	6,200	1,300.00	8,060,000	
萩原電気ホールディングス	5,800	1,924.00	11,159,200	
アズワン	22,500	6,890.00	155,025,000	貸付有価証券 1,000株
スズデン	5,400	2,203.00	11,896,200	
尾家産業	4,100	978.00	4,009,800	
シモジマ	9,600	913.00	8,764,800	
ドウシシャ	14,700	1,509.00	22,182,300	貸付有価証券 6,800株
小津産業	3,400	1,996.00	6,786,400	貸付有価証券 1,500株
高速	9,300	1,483.00	13,791,900	
たけびし	5,800	1,450.00	8,410,000	
リックス	3,500	1,593.00	5,575,500	貸付有価証券

				200株
丸文	13,800	678.00	9,356,400	貸付有価証券 400株
ハピネット	13,000	1,482.00	19,266,000	
橋本総業ホールディングス	3,200	1,946.00	6,227,200	
日本ライフライン	46,400	1,114.00	51,689,600	貸付有価証券 200株
タカショー	11,900	705.00	8,389,500	貸付有価証券 4,300株
I DOM	47,500	624.00	29,640,000	
進和	9,200	1,998.00	18,381,600	
エスケイジャパン	3,800	430.00	1,634,000	貸付有価証券 1,700株
ダイトロン	6,600	1,866.00	12,315,600	
シークス	22,400	999.00	22,377,600	貸付有価証券 500株
田中商事	4,800	620.00	2,976,000	
オーハシテクニカ	8,400	1,282.00	10,768,800	
白銅	5,000	2,464.00	12,320,000	
ダイコー通産	1,800	1,315.00	2,367,000	
伊藤忠商事	1,094,500	3,974.00	4,349,543,000	貸付有価証券 200株
丸紅	1,543,600	1,456.50	2,248,253,400	貸付有価証券 71,700株
高島	2,200	2,261.00	4,974,200	
長瀬産業	83,500	1,853.00	154,725,500	
蝶理	8,700	1,756.00	15,277,200	
豊田通商	157,200	4,760.00	748,272,000	貸付有価証券 4,700株
三共生興	20,000	528.00	10,560,000	
兼松	58,400	1,330.00	77,672,000	
ツカモトコーポレーション	2,600	1,297.00	3,372,200	
三井物産	1,215,200	3,245.00	3,943,324,000	貸付有価証券 7,000株
日本紙パルプ商事	8,200	3,810.00	31,242,000	
カメイ	18,500	1,016.00	18,796,000	
東都水産	800	4,305.00	3,444,000	貸付有価証券 400株

OU Gホールディングス	2,300	2,653.00	6,101,900	
スターゼン	11,600	1,974.00	22,898,400	
山善	65,800	947.00	62,312,600	
椿本興業	3,200	3,550.00	11,360,000	
住友商事	987,700	2,084.00	2,058,366,800	貸付有価証券 5,200株
内田洋行	6,700	4,720.00	31,624,000	
三菱商事	1,172,600	4,426.00	5,189,927,600	貸付有価証券 1,800株
第一実業	7,100	3,785.00	26,873,500	
キャノンマーケティング ジャパン	38,800	2,612.00	101,345,600	
西華産業	8,200	1,608.00	13,185,600	
佐藤商事	12,900	1,107.00	14,280,300	
菱洋エレクトロ	9,300	2,041.00	18,981,300	貸付有価証券 3,100株
東京産業	14,100	705.00	9,940,500	
ユアサ商事	14,800	2,902.00	42,949,600	
神鋼商事	3,500	3,395.00	11,882,500	
トルク	8,300	213.00	1,767,900	
阪和興業	31,300	3,145.00	98,438,500	貸付有価証券 100株
正栄食品工業	10,100	3,990.00	40,299,000	貸付有価証券 4,700株
カナデン	12,700	946.00	12,014,200	
菱電商事	12,400	1,653.00	20,497,200	
岩谷産業	37,600	5,220.00	196,272,000	
ナイス	5,400	1,903.00	10,276,200	
ニチモウ	2,200	2,638.00	5,803,600	
極東貿易	4,500	2,106.00	9,477,000	
アステナホールディング ス	22,000	423.00	9,306,000	
三愛オブリ	38,500	954.00	36,729,000	
稲畑産業	33,000	2,140.00	70,620,000	
G S I クレオス	7,500	1,181.00	8,857,500	貸付有価証券 3,300株
明和産業	14,400	901.00	12,974,400	貸付有価証券 6,700株（100株）
クワザワホールディング	6,200	517.00	3,205,400	

ス				
ワキタ	33,400	1,047.00	34,969,800	貸付有価証券 200株
東邦ホールディングス	50,200	2,076.00	104,215,200	貸付有価証券 12,200株
サンゲツ	41,400	1,534.00	63,507,600	
ミツウロコグループホールディングス	23,100	1,008.00	23,284,800	
シナネンホールディングス	5,800	3,325.00	19,285,000	
伊藤忠エネクス	34,600	1,061.00	36,710,600	
サンリオ	48,300	2,719.00	131,327,700	貸付有価証券 300株
サンワテクノス	9,500	1,310.00	12,445,000	
リョーサン	17,300	2,273.00	39,322,900	
新光商事	23,400	937.00	21,925,800	
トーヨー	7,100	1,114.00	7,909,400	貸付有価証券 300株
三信電気	7,200	1,542.00	11,102,400	
東陽テクニカ	15,400	1,041.00	16,031,400	
モスフードサービス	20,500	2,922.00	59,901,000	貸付有価証券 100株（100株）
加賀電子	14,200	3,015.00	42,813,000	
ソーダニッカ	15,400	668.00	10,287,200	
立花エレクトック	12,000	1,612.00	19,344,000	
フォーバル	6,800	869.00	5,909,200	
PALTA C	21,900	4,540.00	99,426,000	
三谷産業	18,300	306.00	5,599,800	貸付有価証券 200株
太平洋興発	5,800	619.00	3,590,200	
西本Wismettac ホールディングス	3,500	2,681.00	9,383,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,400	2,053.00	2,874,200	貸付有価証券 200株
コーア商事ホールディングス	9,800	880.00	8,624,000	貸付有価証券 1,700株（400株）
国際紙パルプ商事	32,500	295.00	9,587,500	
ヤマタネ	7,300	1,617.00	11,804,100	
丸紅建材リース	1,400	1,727.00	2,417,800	
日鉄物産	11,200	5,290.00	59,248,000	

泉州電業	4,300	5,040.00	21,672,000	貸付有価証券 1,900株
トラスコ中山	32,600	2,082.00	67,873,200	
オートバックスセブン	52,600	1,346.00	70,799,600	
モリト	11,400	744.00	8,481,600	貸付有価証券 100株
加藤産業	22,600	3,260.00	73,676,000	貸付有価証券 100株
北恵	4,000	887.00	3,548,000	貸付有価証券 1,700株
イノテック	9,500	1,345.00	12,777,500	
イエローハット	27,100	1,583.00	42,899,300	
J Kホールディングス	12,600	1,152.00	14,515,200	
日伝	13,000	2,145.00	27,885,000	
北沢産業	10,600	214.00	2,268,400	
杉本商事	7,300	2,088.00	15,242,400	
因幡電機産業	41,700	2,533.00	105,626,100	貸付有価証券 400株
東テク	5,200	2,592.00	13,478,400	
ミスミグループ本社	196,400	3,345.00	656,958,000	
アルテック	10,500	245.00	2,572,500	
タキヒヨー	4,700	1,088.00	5,113,600	貸付有価証券 1,000株
蔵王産業	3,000	1,885.00	5,655,000	
スズケン	61,200	3,810.00	233,172,000	
ジェコス	10,800	794.00	8,575,200	
グローセル	18,300	407.00	7,448,100	貸付有価証券 1,100株
ローソン	34,600	4,625.00	160,025,000	貸付有価証券 2,000株
サンエー	11,800	4,030.00	47,554,000	
カワチ薬品	12,100	2,106.00	25,482,600	
エービーシー・マート	24,400	5,300.00	129,320,000	
ハードオフコーポレーション	6,900	804.00	5,547,600	
アスクル	35,400	1,579.00	55,896,600	貸付有価証券 1,100株
ゲオホールディングス	20,900	1,283.00	26,814,700	
アダストリア	16,900	2,110.00	35,659,000	貸付有価証券

				100株
ジーフット	9,400	307.00	2,885,800	貸付有価証券 4,400株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,200	377.00	829,400	
くら寿司	16,300	3,380.00	55,094,000	貸付有価証券 7,600株（1,400株）
キャンドウ	5,800	2,275.00	13,195,000	貸付有価証券 3,300株（1,000株）
アイケイ	4,900	572.00	2,802,800	貸付有価証券 1,700株（300株）
パルグループホールディ ングス	13,700	1,389.00	19,029,300	
エディオン	71,800	1,098.00	78,836,400	貸付有価証券 28,300株（9,700株）
サーラコーポレーション	31,800	615.00	19,557,000	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
ワッツ	7,500	725.00	5,437,500	貸付有価証券 3,300株
ハローズ	7,100	3,050.00	21,655,000	
フジオフードグループ本 社	13,200	1,329.00	17,542,800	貸付有価証券 5,800株
あみやき亭	3,700	2,872.00	10,626,400	
ひらまつ	33,200	192.00	6,374,400	貸付有価証券 3,700株
大黒天物産	5,000	4,825.00	24,125,000	貸付有価証券 2,300株（900株）
ハニーズホールディン グス	13,800	1,043.00	14,393,400	貸付有価証券 700株
ファーマライズホール ディングス	3,800	777.00	2,952,600	貸付有価証券 1,700株
アルペン	11,600	1,951.00	22,631,600	貸付有価証券 5,200株
ハブ	5,100	512.00	2,611,200	貸付有価証券 2,100株（1,100株）
クオールホールディン グス	19,200	1,089.00	20,908,800	貸付有価証券 200株
ジンスホールディングス	10,600	4,580.00	48,548,000	貸付有価証券 100株
ビックカメラ	92,800	1,105.00	102,544,000	貸付有価証券 35,200株
DCMホールディングス	96,500	1,041.00	100,456,500	

Monotaro	197,800	2,398.00	474,324,400	貸付有価証券 33,000株
東京一番フーズ	4,000	594.00	2,376,000	
DDホールディングス	8,200	505.00	4,141,000	貸付有価証券 100株（100株）
きちりホールディングス	4,200	372.00	1,562,400	貸付有価証券 1,900株
アークランドサービス ホールディングス	11,400	2,209.00	25,182,600	貸付有価証券 4,900株
J. フロント リテイ リング	186,900	967.00	180,732,300	貸付有価証券 100株
ドトール・日レスホール ディングス	27,000	1,464.00	39,528,000	
マツキヨココカラ&カン パニー	96,200	4,315.00	415,103,000	
ブロンコビリー	8,900	2,306.00	20,523,400	貸付有価証券 4,100株
ZOZO	107,600	3,125.00	336,250,000	
トレジャー・ファクト リー	4,600	983.00	4,521,800	
物語コーポレーション	7,700	5,210.00	40,117,000	貸付有価証券 3,600株
三越伊勢丹ホールディ ングス	274,000	956.00	261,944,000	
Hamee	5,600	1,090.00	6,104,000	貸付有価証券 2,600株
マーケットエンタープラ イズ	1,200	769.00	922,800	貸付有価証券 500株（400株）
ウエルシアホールディ ングス	82,700	2,611.00	215,929,700	貸付有価証券 100株
クリエイティブSDホー ルディングス	23,100	2,968.00	68,560,800	
丸善CH I ホールディ ングス	18,300	380.00	6,954,000	貸付有価証券 8,100株
ミサワ	3,200	609.00	1,948,800	貸付有価証券 1,500株
ティーライフ	2,100	1,390.00	2,919,000	
エー・ピーホールディ ングス	3,100	440.00	1,364,000	
チムニー	4,800	1,147.00	5,505,600	貸付有価証券 2,100株
シュッピン	13,000	1,233.00	16,029,000	貸付有価証券

				1,000株（800株）
オイシックス・ラ・大地	22,500	2,613.00	58,792,500	貸付有価証券 4,600株
ネクステージ	31,700	1,977.00	62,670,900	
ジョイフル本田	47,000	1,534.00	72,098,000	貸付有価証券 19,400株
鳥貴族ホールディングス	5,700	1,753.00	9,992,100	
ホットランド	11,700	1,333.00	15,596,100	貸付有価証券 5,200株（900株）
すかいらくホールディングス	202,000	1,522.00	307,444,000	貸付有価証券 87,300株（2,600株）
S F Pホールディングス	7,600	1,383.00	10,510,800	貸付有価証券 3,500株（200株）
綿半ホールディングス	11,800	1,304.00	15,387,200	
ヨシックスホールディングス	3,100	2,165.00	6,711,500	貸付有価証券 1,400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	45,500	1,083.00	49,276,500	貸付有価証券 400株
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,100	1,028.00	8,326,800	貸付有価証券 3,800株（100株）
B E E N O S	7,900	1,903.00	15,033,700	貸付有価証券 3,700株
あさひ	12,900	1,339.00	17,273,100	貸付有価証券 6,000株
日本調剤	9,500	1,230.00	11,685,000	
コスモス薬品	15,800	11,850.00	187,230,000	貸付有価証券 7,000株
トーエル	7,600	920.00	6,992,000	貸付有価証券 3,500株
セブン&アイ・ホールディングス	612,200	5,701.00	3,490,152,200	貸付有価証券 66,400株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	83,300	760.00	63,308,000	貸付有価証券 12,800株
ツルハホールディングス	34,100	6,600.00	225,060,000	貸付有価証券 200株
サンマルクホールディングス	12,400	1,486.00	18,426,400	
フェリシモ	3,500	1,120.00	3,920,000	貸付有価証券 200株（200株）
トリドールホールディングス	38,900	2,414.00	93,904,600	貸付有価証券 400株
T O K Y O B A S E	14,400	361.00	5,198,400	貸付有価証券

				3,000株（900株）
ウイルプラスホールディングス	2,900	924.00	2,679,600	
JMホールディングス	10,500	1,672.00	17,556,000	
サツドラホールディングス	7,000	685.00	4,795,000	貸付有価証券 3,200株
アレンザホールディングス	11,900	971.00	11,554,900	
串カツ田中ホールディングス	4,200	1,821.00	7,648,200	貸付有価証券 100株
バロックジャパンリミテッド	10,900	784.00	8,545,600	貸付有価証券 3,900株
クスリのアオキホールディングス	15,600	6,050.00	94,380,000	
力の源ホールディングス	8,000	554.00	4,432,000	貸付有価証券 3,700株（100株）
FOOD & LIFE COMPANIE	91,600	3,120.00	285,792,000	
メディカルシステムネットワーク	15,100	518.00	7,821,800	
一家ホールディングス	3,300	522.00	1,722,600	
藤久ホールディングス	4,900	670.00	3,283,000	貸付有価証券 300株
はるやまホールディングス	7,300	467.00	3,409,100	
ノジマ	25,300	2,513.00	63,578,900	
カップ・クリエイト	21,900	1,315.00	28,798,500	貸付有価証券 800株（200株）
ライトオン	11,700	695.00	8,131,500	貸付有価証券 2,800株（2,800株）
良品計画	180,100	1,209.00	217,740,900	貸付有価証券 47,900株
パリティホールディングス	19,400	256.00	4,966,400	
アドヴァングループ	15,900	819.00	13,022,100	貸付有価証券 300株
アルビス	5,000	2,225.00	11,125,000	
コナカ	18,400	331.00	6,090,400	貸付有価証券 400株
ハウス オブ ローゼ	1,900	1,643.00	3,121,700	
G-7ホールディングス	17,400	1,569.00	27,300,600	

イオン北海道	27,500	1,010.00	27,775,000	貸付有価証券 1,500株
コジマ	26,900	617.00	16,597,300	貸付有価証券 12,200株
ヒマラヤ	5,500	938.00	5,159,000	貸付有価証券 400株
コーナン商事	22,200	3,695.00	82,029,000	
エコス	5,700	1,891.00	10,778,700	
ワタミ	19,000	921.00	17,499,000	
マルシェ	3,800	449.00	1,706,200	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	312,900	1,915.00	599,203,500	
西松屋チェーン	34,300	1,555.00	53,336,500	貸付有価証券 16,100株
ゼンショーホールディン グス	76,400	2,949.00	225,303,600	貸付有価証券 3,000株
幸楽苑ホールディングス	9,900	1,246.00	12,335,400	貸付有価証券 1,900株
ハークスレイ	6,500	471.00	3,061,500	
サイゼリヤ	23,200	2,463.00	57,141,600	
VTホールディングス	58,900	459.00	27,035,100	貸付有価証券 500株
魚力	4,300	2,112.00	9,081,600	貸付有価証券 2,100株
ポプラ	4,100	143.00	586,300	
フジ・コーポレーション	8,300	1,132.00	9,395,600	貸付有価証券 1,300株
ユナイテッドアローズ	16,400	1,812.00	29,716,800	
ハイデイ日高	22,600	1,809.00	40,883,400	貸付有価証券 11,100株
YU-WA Creat ion Holdi	9,200	198.00	1,821,600	貸付有価証券 100株（100株）
コロワイド	64,300	1,645.00	105,773,500	貸付有価証券 30,200株（9,100株）
ピーシーデポコーポレー ション	18,200	307.00	5,587,400	貸付有価証券 600株
壺番屋	11,000	4,695.00	51,645,000	貸付有価証券 700株
トップカルチャー	5,600	279.00	1,562,400	
PLANT	4,000	664.00	2,656,000	

スギホールディングス	31,200	5,480.00	170,976,000	
薬王堂ホールディングス	7,800	1,799.00	14,032,200	貸付有価証券 600株（600株）
スクロール	24,100	806.00	19,424,600	貸付有価証券 2,300株
ヨンドシーホールディングス	14,400	1,687.00	24,292,800	貸付有価証券 1,700株
木曽路	21,400	2,039.00	43,634,600	貸付有価証券 8,800株
S R S ホールディングス	21,900	800.00	17,520,000	貸付有価証券 2,600株（900株）
千趣会	28,200	391.00	11,026,200	貸付有価証券 13,200株
タカキュー	12,100	105.00	1,270,500	貸付有価証券 5,400株
リテールパートナーズ	19,000	1,136.00	21,584,000	
ケーヨー	28,900	897.00	25,923,300	貸付有価証券 800株
上新電機	18,000	1,935.00	34,830,000	
日本瓦斯	76,100	1,539.00	117,117,900	
ロイヤルホールディングス	29,000	2,050.00	59,450,000	貸付有価証券 11,700株
東天紅	1,100	933.00	1,026,300	
いなげや	19,400	1,330.00	25,802,000	貸付有価証券 300株
チヨダ	15,200	697.00	10,594,400	貸付有価証券 6,700株（100株）
ライフコーポレーション	14,600	2,898.00	42,310,800	貸付有価証券 100株
リンガーハット	19,300	2,223.00	42,903,900	貸付有価証券 7,600株
MrMa xHD	19,500	594.00	11,583,000	貸付有価証券 100株
テンアライド	15,200	309.00	4,696,800	貸付有価証券 6,300株
A O K I ホールディングス	30,300	602.00	18,240,600	貸付有価証券 400株
オークワ	24,500	857.00	20,996,500	貸付有価証券 100株
コメリ	24,200	2,561.00	61,976,200	
青山商事	32,300	669.00	21,608,700	貸付有価証券

				3,700株
しまむら	18,200	11,520.00	209,664,000	
はせがわ	8,300	269.00	2,232,700	
高島屋	114,000	1,182.00	134,748,000	貸付有価証券 4,900株
松屋	31,500	743.00	23,404,500	
エイチ・ツー・オー リ テイリング	74,100	862.00	63,874,200	貸付有価証券 200株
近鉄百貨店	6,000	2,520.00	15,120,000	
丸井グループ	123,500	2,255.00	278,492,500	貸付有価証券 1,400株
アクシアル リテイリン グ	12,100	3,310.00	40,051,000	
井筒屋	7,400	323.00	2,390,200	貸付有価証券 3,400株（900株）
イオン	602,200	2,445.00	1,472,379,000	貸付有価証券 55,900株
イズミ	28,300	2,788.00	78,900,400	貸付有価証券 200株
平和堂	28,900	1,915.00	55,343,500	貸付有価証券 13,100株
フジ	42,800	2,128.00	91,078,400	貸付有価証券 1,700株（600株）
ヤオコー	17,800	6,740.00	119,972,000	貸付有価証券 300株
ゼビオホールディングス	21,300	914.00	19,468,200	
ケーズホールディングス	144,300	1,263.00	182,250,900	貸付有価証券 1,200株
O l y m p i c グループ	8,100	655.00	5,305,500	
日産東京販売ホールディ ングス	23,000	220.00	5,060,000	
シルバーライフ	3,200	1,424.00	4,556,800	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
Genky Drug S t o r e s	6,900	3,875.00	26,737,500	貸付有価証券 600株
ナルミヤ・インターナ ショナル	3,500	860.00	3,010,000	貸付有価証券 800株
ブックオフグループホー ルディングス	9,100	1,050.00	9,555,000	貸付有価証券 4,200株（500株）
ギフトホールディングス	2,500	2,392.00	5,980,000	貸付有価証券 1,100株

アインホールディングス	21,000	5,640.00	118,440,000	貸付有価証券 1,100株
元気寿司	4,400	2,447.00	10,766,800	
ヤマダホールディングス	572,200	379.00	216,863,800	貸付有価証券 200株
アークランドサカモト	24,500	1,507.00	36,921,500	
ニトリホールディングス	62,100	13,710.00	851,391,000	
グルメ杵屋	12,400	1,002.00	12,424,800	貸付有価証券 4,800株
愛眼	11,400	197.00	2,245,800	貸付有価証券 100株
ケーユーホールディングス	8,200	1,047.00	8,585,400	
吉野家ホールディングス	54,600	2,322.00	126,781,200	貸付有価証券 3,300株（2,400株）
松屋フーズホールディングス	7,500	3,720.00	27,900,000	貸付有価証券 100株
サガミホールディングス	23,900	1,093.00	26,122,700	貸付有価証券 10,600株
関西フードマーケット	11,800	1,265.00	14,927,000	貸付有価証券 100株
王将フードサービス	10,300	6,000.00	61,800,000	
プレナス	17,500	1,884.00	32,970,000	貸付有価証券 600株（600株）
ミニストップ	11,600	1,373.00	15,926,800	貸付有価証券 200株（200株）
アークス	29,900	2,031.00	60,726,900	
バローホールディングス	34,600	2,054.00	71,068,400	
ベルク	6,900	5,210.00	35,949,000	
大庄	8,400	1,004.00	8,433,600	貸付有価証券 2,300株
ファーストリテイリング	20,900	64,460.00	1,347,214,000	貸付有価証券 400株
サンドラッグ	58,900	2,956.00	174,108,400	貸付有価証券 2,100株
サックスパーホールディングス	14,700	488.00	7,173,600	貸付有価証券 1,400株（700株）
ヤマザワ	3,600	1,557.00	5,605,200	
やまや	3,200	2,451.00	7,843,200	貸付有価証券 700株
ベルーナ	33,600	722.00	24,259,200	貸付有価証券

				200株
島根銀行	5,000	521.00	2,605,000	
じもとホールディングス	11,200	604.00	6,764,800	
めぶきフィナンシャルグループ	814,300	261.00	212,532,300	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,700	1,777.00	35,006,900	
九州フィナンシャルグループ	320,000	397.00	127,040,000	貸付有価証券 200株
ゆうちょ銀行	369,900	978.00	361,762,200	貸付有価証券 173,800株
富山第一銀行	37,400	316.00	11,818,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	895,000	483.00	432,285,000	貸付有価証券 100株
西日本フィナンシャルホールディングス	102,300	801.00	81,942,300	貸付有価証券 2,300株
三十三フィナンシャルグループ	14,500	1,437.00	20,836,500	貸付有価証券 100株
第四北越フィナンシャルグループ	25,500	2,526.00	64,413,000	
ひろぎんホールディングス	231,100	644.00	148,828,400	
おきなわフィナンシャルグループ	14,100	2,180.00	30,738,000	
十六フィナンシャルグループ	21,000	2,152.00	45,192,000	
北國フィナンシャルホールディングス	14,600	3,155.00	46,063,000	
プロクレアホールディングス	16,800	1,773.00	29,786,400	
新生銀行	102,200	2,356.00	240,783,200	貸付有価証券 1,100株
あおぞら銀行	87,500	2,592.00	226,800,000	貸付有価証券 200株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,827,700	764.90	7,517,207,730	
りそなホールディングス	1,776,600	570.70	1,013,905,620	
三井住友トラスト・ホールディングス	296,200	4,049.00	1,199,313,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,084,700	3,967.00	4,303,004,900	貸付有価証券 4,800株
千葉銀行	523,000	778.00	406,894,000	貸付有価証券

				12,500株
群馬銀行	294,100	377.00	110,875,700	
武蔵野銀行	23,300	1,784.00	41,567,200	
千葉興業銀行	36,800	266.00	9,788,800	貸付有価証券 500株
筑波銀行	61,100	198.00	12,097,800	貸付有価証券 1,200株
七十七銀行	49,200	1,601.00	78,769,200	
秋田銀行	10,000	1,687.00	16,870,000	
山形銀行	17,600	840.00	14,784,000	貸付有価証券 200株
岩手銀行	10,300	1,906.00	19,631,800	
東邦銀行	130,800	203.00	26,552,400	貸付有価証券 800株
東北銀行	7,500	1,000.00	7,500,000	
ふくおかフィナンシャル グループ	132,000	2,454.00	323,928,000	
静岡銀行	381,600	866.00	330,465,600	貸付有価証券 13,000株
スルガ銀行	137,400	416.00	57,158,400	貸付有価証券 300株
八十二銀行	353,000	421.00	148,613,000	貸付有価証券 12,600株
山梨中央銀行	17,000	976.00	16,592,000	
大垣共立銀行	31,000	1,920.00	59,520,000	貸付有価証券 200株
福井銀行	13,400	1,359.00	18,210,600	
清水銀行	6,500	1,577.00	10,250,500	
富山銀行	2,800	2,056.00	5,756,800	
滋賀銀行	29,500	2,389.00	70,475,500	貸付有価証券 100株
南都銀行	24,400	2,010.00	49,044,000	
百五銀行	150,400	343.00	51,587,200	貸付有価証券 1,000株
京都銀行	56,100	5,300.00	297,330,000	
紀陽銀行	53,100	1,395.00	74,074,500	貸付有価証券 300株
ほくほくフィナンシャル グループ	97,800	880.00	86,064,000	貸付有価証券 300株
山陰合同銀行	92,900	653.00	60,663,700	貸付有価証券

				100株
中国銀行	125,200	956.00	119,691,200	貸付有価証券 200株
鳥取銀行	5,000	1,182.00	5,910,000	
伊予銀行	207,600	635.00	131,826,000	貸付有価証券 400株
百十四銀行	16,600	1,668.00	27,688,800	
四国銀行	23,800	738.00	17,564,400	貸付有価証券 200株
阿波銀行	24,000	2,158.00	51,792,000	
大分銀行	9,000	1,855.00	16,695,000	
宮崎銀行	9,800	2,052.00	20,109,600	
佐賀銀行	8,900	1,433.00	12,753,700	
琉球銀行	34,000	809.00	27,506,000	貸付有価証券 100株
セブン銀行	465,400	244.00	113,557,600	貸付有価証券 138,200株
みずほフィナンシャルグループ	2,004,100	1,590.50	3,187,521,050	貸付有価証券 19,700株
高知銀行	5,700	754.00	4,297,800	
山口フィナンシャルグループ	182,600	722.00	131,837,200	貸付有価証券 600株
長野銀行	5,100	1,290.00	6,579,000	
名古屋銀行	11,700	2,980.00	34,866,000	貸付有価証券 200株
北洋銀行	236,200	246.00	58,105,200	貸付有価証券 600株
愛知銀行	5,700	4,635.00	26,419,500	
中京銀行	5,600	1,692.00	9,475,200	
大光銀行	5,400	1,316.00	7,106,400	
愛媛銀行	21,900	906.00	19,841,400	貸付有価証券 100株
トマト銀行	5,600	1,022.00	5,723,200	
京葉銀行	65,400	505.00	33,027,000	貸付有価証券 300株
栃木銀行	75,700	240.00	18,168,000	
北日本銀行	4,900	1,539.00	7,541,100	
東和銀行	27,500	532.00	14,630,000	
福島銀行	18,000	224.00	4,032,000	貸付有価証券 300株

大東銀行	7,500	673.00	5,047,500	
トモニホールディングス	121,100	329.00	39,841,900	貸付有価証券 100株
フィデアホールディングス	14,300	1,300.00	18,590,000	貸付有価証券 100株
池田泉州ホールディングス	180,200	179.00	32,255,800	貸付有価証券 1,300株
F P G	52,700	755.00	39,788,500	貸付有価証券 900株
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,100	1,188.00	14,374,800	貸付有価証券 4,000株
マーキュリアホールディングス	6,200	565.00	3,503,000	
S B I ホールディングス	193,400	2,874.00	555,831,600	貸付有価証券 7,200株
日本アジア投資	12,400	236.00	2,926,400	
ジャフコ グループ	59,900	1,690.00	101,231,000	貸付有価証券 100株
大和証券グループ本社	1,173,600	657.50	771,642,000	貸付有価証券 6,800株
野村ホールディングス	2,392,600	515.00	1,232,189,000	
岡三証券グループ	123,300	366.00	45,127,800	貸付有価証券 300株
丸三証券	46,500	484.00	22,506,000	貸付有価証券 1,000株
東洋証券	51,700	167.00	8,633,900	貸付有価証券 300株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	180,000	403.00	72,540,000	貸付有価証券 400株
光世証券	3,300	469.00	1,547,700	
水戸証券	41,800	265.00	11,077,000	
いちよし証券	29,300	594.00	17,404,200	
松井証券	76,700	833.00	63,891,100	貸付有価証券 400株
マネックスグループ	127,800	613.00	78,341,400	貸付有価証券 46,000株
極東証券	21,000	700.00	14,700,000	
岩井コスモホールディングス	14,800	1,312.00	19,417,600	
アイザワ証券グループ	25,800	674.00	17,389,200	
マネーパートナーズグ	16,700	276.00	4,609,200	

ループ				
スパークス・グループ	72,400	263.00	19,041,200	
小林洋行	5,600	225.00	1,260,000	
かんぽ生命保険	157,700	2,145.00	338,266,500	
SOMPOホールディングス	257,300	5,200.00	1,337,960,000	
アニコム ホールディングス	48,100	629.00	30,254,900	
MS&ADインシュアランスグループホール	351,400	3,844.00	1,350,781,600	
第一生命ホールディングス	771,400	2,680.50	2,067,737,700	貸付有価証券 28,000株
東京海上ホールディングス	516,100	6,809.00	3,514,124,900	
T&Dホールディングス	406,800	1,726.00	702,136,800	
アドバンスクリエイト	7,500	896.00	6,720,000	貸付有価証券 3,300株
全国保証	37,400	4,625.00	172,975,000	貸付有価証券 7,500株
あんしん保証	4,700	282.00	1,325,400	貸付有価証券 400株
ジェイリース	5,300	1,551.00	8,220,300	貸付有価証券 1,500株（1,100株）
イントラスト	6,600	540.00	3,564,000	
日本モーゲージサービス	8,700	970.00	8,439,000	貸付有価証券 100株
C a s a	5,500	801.00	4,405,500	貸付有価証券 2,100株（200株）
アルヒ	23,100	1,002.00	23,146,200	貸付有価証券 9,700株（9,300株）
プレミアグループ	7,900	4,005.00	31,639,500	貸付有価証券 400株（400株）
ネットプロテクションズ ホールディングス	35,700	654.00	23,347,800	貸付有価証券 16,700株（11,300株）
クレディセゾン	100,600	1,553.00	156,231,800	貸付有価証券 1,700株
芙蓉総合リース	16,400	7,090.00	116,276,000	
みずほリース	24,200	3,035.00	73,447,000	
東京センチュリー	30,300	4,075.00	123,472,500	貸付有価証券 600株
日本証券金融	61,600	920.00	56,672,000	

アイフル	263,000	381.00	100,203,000	
リコーリース	13,900	3,415.00	47,468,500	
イオンフィナンシャルサービス	85,200	1,182.00	100,706,400	
アコム	309,100	342.00	105,712,200	
ジャックス	17,300	3,330.00	57,609,000	
オリエントコーポレーション	423,900	127.00	53,835,300	貸付有価証券 5,200株
オリックス	931,000	2,388.00	2,223,228,000	
三菱HCキャピタル	578,900	581.00	336,340,900	貸付有価証券 11,900株
九州リースサービス	7,700	578.00	4,450,600	貸付有価証券 2,000株
日本取引所グループ	391,100	2,129.50	832,847,450	貸付有価証券 8,400株
イー・ギャランティ	23,100	2,138.00	49,387,800	
アサックス	8,100	606.00	4,908,600	貸付有価証券 4,500株
NECキャピタルソリューション	6,400	2,088.00	13,363,200	貸付有価証券 800株
いちご	174,500	302.00	52,699,000	貸付有価証券 44,400株
日本駐車場開発	171,900	151.00	25,956,900	
スター・マイカ・ホールディングス	8,500	1,610.00	13,685,000	
SREホールディングス	3,900	2,924.00	11,403,600	貸付有価証券 400株（400株）
ADワークスグループ	32,500	148.00	4,810,000	貸付有価証券 13,900株
ヒューリック	374,300	1,080.00	404,244,000	貸付有価証券 72,100株
三栄建築設計	6,300	1,663.00	10,476,900	
野村不動産ホールディングス	81,100	3,005.00	243,705,500	
三重交通グループホールディングス	31,800	447.00	14,214,600	貸付有価証券 13,700株
サムティ	25,200	2,084.00	52,516,800	貸付有価証券 9,700株
ディア・ライフ	20,200	514.00	10,382,800	
コーセーアールイー	4,600	616.00	2,833,600	貸付有価証券 1,000株（400株）

地主	9,900	1,914.00	18,948,600	貸付有価証券 4,300株
プレサンスコーポレーション	20,600	1,628.00	33,536,800	貸付有価証券 100株
ハウスコム	2,700	1,166.00	3,148,200	
日本管理センター	7,500	994.00	7,455,000	
サンセイランディック	4,600	825.00	3,795,000	貸付有価証券 700株（700株）
エストラスト	1,800	565.00	1,017,000	
フージャースホールディングス	20,000	649.00	12,980,000	
オープンハウスグループ	49,800	5,290.00	263,442,000	貸付有価証券 100株
東急不動産ホールディングス	461,600	677.00	312,503,200	貸付有価証券 200株
飯田グループホールディングス	130,700	2,111.00	275,907,700	貸付有価証券 100株
イーグランド	2,500	1,340.00	3,350,000	
ムゲンエステート	9,600	508.00	4,876,800	貸付有価証券 600株（600株）
ビーロッド	10,600	490.00	5,194,000	
ファーストブラザーズ	3,600	842.00	3,031,200	貸付有価証券 1,600株
And Doホールディングス	7,700	911.00	7,014,700	貸付有価証券 600株（600株）
シーアールイー	4,300	1,654.00	7,112,200	貸付有価証券 1,400株
プロパティエージェント	1,800	1,625.00	2,925,000	貸付有価証券 1,100株
ケイアイスター不動産	7,000	5,440.00	38,080,000	
アグレ都市デザイン	2,500	1,702.00	4,255,000	
グッドコムアセット	6,800	1,066.00	7,248,800	
ジェイ・エス・ビー	3,200	3,360.00	10,752,000	
ロードスターキャピタル	3,900	1,588.00	6,193,200	貸付有価証券 1,800株
テンポイノベーション	4,400	817.00	3,594,800	貸付有価証券 300株
グローバル・リンク・マネジメント	2,700	849.00	2,292,300	
フェイスネットワーク	1,500	1,308.00	1,962,000	
パーク24	84,100	1,910.00	160,631,000	貸付有価証券

				30,300株（4,100株）
パラカ	4,100	1,740.00	7,134,000	貸付有価証券 1,700株
三井不動産	709,900	2,709.50	1,923,474,050	貸付有価証券 9,500株
三菱地所	1,029,600	1,841.00	1,895,493,600	貸付有価証券 15,000株
平和不動産	26,800	4,000.00	107,200,000	
東京建物	154,800	1,822.00	282,045,600	
京阪神ビルディング	24,200	1,351.00	32,694,200	
住友不動産	328,800	3,410.00	1,121,208,000	貸付有価証券 1,600株
テーオーシー	28,200	669.00	18,865,800	貸付有価証券 1,700株
東京楽天地	2,600	3,960.00	10,296,000	
レオパレス 2 1	162,500	197.00	32,012,500	
スターツコーポレーショ ン	21,300	2,363.00	50,331,900	
フジ住宅	18,200	616.00	11,211,200	
空港施設	15,700	535.00	8,399,500	
明和地所	7,400	591.00	4,373,400	貸付有価証券 100株
ゴールドクレスト	12,400	1,653.00	20,497,200	
エスリード	6,100	1,651.00	10,071,100	
日神グループホールディ ングス	25,500	462.00	11,781,000	
日本エスコン	29,200	810.00	23,652,000	
タカラレーベン	65,700	301.00	19,775,700	
A V A N T I A	8,100	839.00	6,795,900	貸付有価証券 300株
イオンモール	78,600	1,575.00	123,795,000	貸付有価証券 1,800株
毎日コムネット	5,300	702.00	3,720,600	
ファースト住建	5,800	1,131.00	6,559,800	貸付有価証券 2,700株
カチタス	38,800	3,385.00	131,338,000	
トーセイ	21,600	1,076.00	23,241,600	
穴吹興産	3,400	2,181.00	7,415,400	
サンフロンティア不動産	21,600	1,070.00	23,112,000	
F J ネクストホールディ	15,400	996.00	15,338,400	

ングス				
インテリックス	3,500	646.00	2,261,000	貸付有価証券 700株
ランドビジネス	6,600	244.00	1,610,400	
サンネクスタグループ	5,000	1,181.00	5,905,000	
グランディハウス	10,600	526.00	5,575,600	
日本空港ビルデング	59,700	5,560.00	331,932,000	貸付有価証券 400株
明豊ファシリティワーク ス	6,900	699.00	4,823,100	
日本工営	9,700	2,925.00	28,372,500	
L I F U L L	46,400	229.00	10,625,600	貸付有価証券 3,500株
ミクシィ	34,700	2,207.00	76,582,900	
ジェイエシーリクルー トメント	12,300	1,816.00	22,336,800	
日本M&Aセンターホー ルディングス	249,000	1,622.00	403,878,000	貸付有価証券 300株
メンバーズ	4,600	3,075.00	14,145,000	
中広	2,400	375.00	900,000	
UTグループ	21,900	2,948.00	64,561,200	
アイティメディア	7,200	1,653.00	11,901,600	
E・Jホールディングス	8,700	1,149.00	9,996,300	貸付有価証券 3,700株
夢真ビーネックスグルー プ	49,500	1,573.00	77,863,500	貸付有価証券 300株
コシダカホールディング ス	40,600	811.00	32,926,600	貸付有価証券 9,400株
アルトナー	3,700	823.00	3,045,100	
パソナグループ	16,500	2,092.00	34,518,000	
CDS	3,800	1,663.00	6,319,400	
リンクアンドモチベー ション	33,500	452.00	15,142,000	貸付有価証券 15,700株（5,500株）
エス・エム・エス	51,600	3,180.00	164,088,000	
サニーサイドアップグ ループ	5,200	783.00	4,071,600	貸付有価証券 300株（300株）
パーソルホールディング ス	151,800	2,590.00	393,162,000	
リニカル	8,500	802.00	6,817,000	
クックパッド	47,700	277.00	13,212,900	貸付有価証券

				1,100株
エスクリ	6,800	419.00	2,849,200	貸付有価証券 3,100株
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,400	591.00	4,373,400	貸付有価証券 3,400株
学情	6,100	965.00	5,886,500	貸付有価証券 2,800株
スタジオアリス	6,800	2,275.00	15,470,000	貸付有価証券 4,100株
シミックホールディングス	8,400	1,517.00	12,742,800	
エプコ	3,200	679.00	2,172,800	
N J S	3,300	2,055.00	6,781,500	
総合警備保障	60,400	3,585.00	216,534,000	貸付有価証券 1,000株
カカクコム	111,400	2,662.00	296,546,800	
セントケア・ホールディング	9,900	792.00	7,840,800	
サイネックス	2,600	589.00	1,531,400	
ルネサンス	10,500	932.00	9,786,000	貸付有価証券 600株
ディップ	26,700	3,915.00	104,530,500	貸付有価証券 500株
デジタルホールディングス	10,600	1,380.00	14,628,000	
新日本科学	18,500	1,466.00	27,121,000	
キャリアデザインセンター	3,800	1,072.00	4,073,600	
ベネフィット・ワン	55,200	2,124.00	117,244,800	貸付有価証券 8,000株
エムスリー	267,900	4,265.00	1,142,593,500	
ツカダ・グローバルホールディング	9,700	313.00	3,036,100	
プラス	2,000	738.00	1,476,000	
アウトソーシング	87,000	1,254.00	109,098,000	貸付有価証券 25,200株（25,200株）
ウェルネット	15,300	489.00	7,481,700	貸付有価証券 900株
ワールドホールディングス	6,100	2,393.00	14,597,300	
ディー・エヌ・エー	57,800	1,848.00	106,814,400	貸付有価証券

				2,300株
博報堂DYホールディングス	211,400	1,526.00	322,596,400	
ぐるなび	24,900	423.00	10,532,700	貸付有価証券 600株
タカミヤ	18,400	348.00	6,403,200	
ジャパンベストレス キューシステム	10,300	955.00	9,836,500	
ファンコミュニケーションズ	37,900	425.00	16,107,500	貸付有価証券 100株
ライク	5,000	2,203.00	11,015,000	貸付有価証券 1,200株（800株）
ビジネス・ブレークス ルー	5,600	409.00	2,290,400	貸付有価証券 1,500株
エスプール	42,900	1,343.00	57,614,700	
WDBホールディングス	6,900	2,771.00	19,119,900	
ティア	8,800	429.00	3,775,200	
CDG	1,600	1,285.00	2,056,000	
アドウェイズ	22,600	773.00	17,469,800	貸付有価証券 3,500株（3,100株）
バリューコマース	11,900	3,575.00	42,542,500	
インフォマート	166,400	659.00	109,657,600	貸付有価証券 4,300株
JPホールディングス	39,000	211.00	8,229,000	貸付有価証券 300株
CLホールディングス	3,200	1,113.00	3,561,600	
プレステージ・インター ナショナル	56,900	643.00	36,586,700	
アミューズ	8,300	1,931.00	16,027,300	
ドリームインキュベータ	4,100	1,946.00	7,978,600	貸付有価証券 1,300株
クイック	10,400	1,532.00	15,932,800	
TAC	8,200	212.00	1,738,400	
電通グループ	156,500	4,855.00	759,807,500	貸付有価証券 1,000株
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	7,100	1,290.00	9,159,000	貸付有価証券 100株
ぴあ	5,300	3,230.00	17,119,000	
イオンファンタジー	5,900	2,187.00	12,903,300	貸付有価証券 2,600株（200株）

シーティーエス	17,100	843.00	14,415,300	
ネクシィーズグループ	5,300	526.00	2,787,800	貸付有価証券 200株（200株）
H. U. グループホールディングス	39,700	2,862.00	113,621,400	貸付有価証券 100株
アルプス技研	11,800	1,916.00	22,608,800	
ダイオーズ	3,000	1,003.00	3,009,000	貸付有価証券 1,300株
日本空調サービス	15,900	803.00	12,767,700	
オリエンタルランド	179,400	22,550.00	4,045,470,000	貸付有価証券 900株
ダスキン	35,200	2,736.00	96,307,200	
明光ネットワークジャパン	17,800	568.00	10,110,400	
ファルコホールディングス	7,200	2,106.00	15,163,200	
秀英予備校	3,300	421.00	1,389,300	貸付有価証券 1,400株
ラウンドワン	42,400	1,476.00	62,582,400	
リゾートトラスト	69,600	2,182.00	151,867,200	
ビー・エム・エル	19,500	3,205.00	62,497,500	
りらいあコミュニケーションズ	22,400	1,044.00	23,385,600	
リソー教育	69,400	381.00	26,441,400	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
早稲田アカデミー	8,400	1,025.00	8,610,000	貸付有価証券 2,300株
ユー・エス・エス	170,000	2,098.00	356,660,000	貸付有価証券 1,600株
東京個別指導学院	13,400	574.00	7,691,600	貸付有価証券 1,300株（700株）
サイバーエージェント	374,200	1,402.00	524,628,400	貸付有価証券 9,600株
楽天グループ	780,700	929.00	725,270,300	貸付有価証券 63,100株
クリーク・アンド・リパー社	7,900	2,225.00	17,577,500	
モーニングスター	26,500	560.00	14,840,000	
テー・オー・ダブリュー	29,000	309.00	8,961,000	貸付有価証券 700株
山田コンサルティンググループ	7,900	1,224.00	9,669,600	

ループ				
セントラルスポーツ	5,700	2,372.00	13,520,400	貸付有価証券 2,500株
フルキャストホールディングス	12,900	2,417.00	31,179,300	
エン・ジャパン	24,500	3,110.00	76,195,000	
リソルホールディングス	1,600	4,360.00	6,976,000	貸付有価証券 600株
テクノプロ・ホールディングス	90,900	3,175.00	288,607,500	
アトラグループ	3,400	255.00	867,000	
インターワークス	4,400	369.00	1,623,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,000	4,165.00	29,155,000	貸付有価証券 100株
K e e P e r 技研	9,800	2,695.00	26,411,000	貸付有価証券 900株
ファーストロジック	2,900	792.00	2,296,800	
三機サービス	2,600	1,096.00	2,849,600	貸付有価証券 1,200株
G u n o s y	8,300	1,143.00	9,486,900	貸付有価証券 3,900株（3,900株）
デザインワン・ジャパン	3,700	185.00	684,500	
イー・ガーディアン	6,200	2,862.00	17,744,400	
リブセンス	8,300	162.00	1,344,600	貸付有価証券 400株
ジャパンマテリアル	46,700	1,911.00	89,243,700	
ベクトル	21,300	1,211.00	25,794,300	貸付有価証券 8,200株
ウチヤマホールディングス	7,500	317.00	2,377,500	貸付有価証券 1,300株
チャーム・ケア・コーポレーション	11,300	1,210.00	13,673,000	
キャリアリンク	5,600	1,374.00	7,694,400	貸付有価証券 500株
I B J	12,400	718.00	8,903,200	貸付有価証券 200株
アサンテ	6,700	1,452.00	9,728,400	
バリューHR	12,100	1,391.00	16,831,100	貸付有価証券 5,200株
M&Aキャピタルパートナーズ	12,500	4,200.00	52,500,000	

ライドオンエクスプレス ホールディングス	5,900	1,151.00	6,790,900	貸付有価証券 1,400株（1,300株）
E R I ホールディングス	4,200	1,310.00	5,502,000	貸付有価証券 700株（400株）
アビスト	2,400	2,711.00	6,506,400	
シグマクシス・ホール ディングス	18,300	1,035.00	18,940,500	
ウィルグループ	11,200	1,138.00	12,745,600	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	20,300	169.00	3,430,700	
メドピア	11,700	3,165.00	37,030,500	貸付有価証券 3,000株
レアジョブ	2,900	834.00	2,418,600	貸付有価証券 700株（200株）
リクルートホールディン グス	1,171,200	4,877.00	5,711,942,400	
エラン	20,900	982.00	20,523,800	
土木管理総合試験所	7,000	332.00	2,324,000	
ネットマーケティング	7,400	554.00	4,099,600	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
日本郵政	1,982,600	905.60	1,795,442,560	
ベルシステム24ホール ディングス	21,800	1,489.00	32,460,200	
鎌倉新書	17,300	591.00	10,224,300	貸付有価証券 6,800株（3,900株）
SMN	3,300	594.00	1,960,200	
一蔵	1,900	356.00	676,400	
グローバルキッズCOM PANY	2,800	710.00	1,988,000	
エアトリ	9,800	3,205.00	31,409,000	貸付有価証券 300株（300株）
アトラエ	10,600	1,788.00	18,952,800	貸付有価証券 100株
ストライク	5,700	4,035.00	22,999,500	
ソラスト	37,300	864.00	32,227,200	
セラク	4,800	1,179.00	5,659,200	貸付有価証券 300株
インソース	14,700	2,055.00	30,208,500	貸付有価証券 5,600株
ベйкаレント・コンサル ティング	10,700	39,350.00	421,045,000	

Orchestra Holdings	2,900	2,565.00	7,438,500	貸付有価証券 200株（200株）
アイモバイル	4,300	1,169.00	5,026,700	貸付有価証券 2,000株（1,100株）
キャリアインデックス	5,200	581.00	3,021,200	
MS-Japan	6,200	807.00	5,003,400	貸付有価証券 900株
船場	3,000	713.00	2,139,000	
ジャパンエレベーター サービスホールディン	48,200	1,516.00	73,071,200	
フルテック	2,100	1,404.00	2,948,400	
グリーンズ	5,700	605.00	3,448,500	
ツナググループ・ホール ディングス	3,400	277.00	941,800	
GameWith	4,500	502.00	2,259,000	貸付有価証券 2,100株
MS&Consulting	2,200	708.00	1,557,600	
ウェルビー	9,900	966.00	9,563,400	貸付有価証券 100株（100株）
エル・ティー・エス	1,900	2,773.00	5,268,700	貸付有価証券 800株（800株）
ミダックホールディング ス	6,900	2,190.00	15,111,000	貸付有価証券 2,800株
日総工産	11,900	667.00	7,937,300	貸付有価証券 1,200株
キュービーネットホール ディングス	7,000	1,410.00	9,870,000	
RPAホールディングス	21,400	334.00	7,147,600	貸付有価証券 9,700株（9,500株）
スプリックス	4,300	1,210.00	5,203,000	貸付有価証券 700株（700株）
マネジメントソリュー ションズ	7,400	4,560.00	33,744,000	
プロレド・パートナーズ	3,300	550.00	1,815,000	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
and factory	3,400	416.00	1,414,400	
テノ. ホールディングス	1,800	665.00	1,197,000	
フロンティア・マネジメ ント	3,900	954.00	3,720,600	
ピアラ	2,500	933.00	2,332,500	貸付有価証券

				1,100株（1,000株）
コプロ・ホールディングス	3,000	996.00	2,988,000	
ギークス	2,600	1,130.00	2,938,000	貸付有価証券 100株（100株）
カーブスホールディングス	41,700	785.00	32,734,500	
フォーラムエンジニアリング	10,500	819.00	8,599,500	貸付有価証券 200株
Fast Fitness Japan	2,100	1,796.00	3,771,600	
ダイレクトマーケティングミックス	17,500	1,552.00	27,160,000	貸付有価証券 400株
ポピンズ	3,500	2,022.00	7,077,000	
LITALICO	12,300	2,682.00	32,988,600	
アドバンテッジリスクマネジメント	7,700	534.00	4,111,800	貸付有価証券 700株
リロググループ	83,000	1,855.00	153,965,000	貸付有価証券 3,900株
東祥	11,300	1,730.00	19,549,000	貸付有価証券 600株（400株）
ビーウィズ	4,000	1,389.00	5,556,000	
TREホールディングス	20,800	2,085.00	43,368,000	
人・夢・技術グループ	6,000	2,084.00	12,504,000	
エイチ・アイ・エス	33,700	2,267.00	76,397,900	貸付有価証券 15,800株
ラックランド	4,600	2,964.00	13,634,400	貸付有価証券 1,000株
共立メンテナンス	27,100	4,640.00	125,744,000	貸付有価証券 11,200株（2,200株）
イチネンホールディングス	15,600	1,253.00	19,546,800	
建設技術研究所	9,100	2,310.00	21,021,000	
スペース	10,800	901.00	9,730,800	
燦ホールディングス	6,600	1,494.00	9,860,400	貸付有価証券 100株（100株）
スバル興業	900	8,200.00	7,380,000	貸付有価証券 400株
東京テアトル	5,900	1,226.00	7,233,400	
タナベ経営	5,800	659.00	3,822,200	
ナガワ	4,800	9,200.00	44,160,000	

東京都競馬	11,400	4,395.00	50,103,000	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
常磐興産	6,100	1,305.00	7,960,500	
カナモト	26,800	1,985.00	53,198,000	貸付有価証券 11,700株
西尾レントオール	14,000	2,748.00	38,472,000	
トランス・コスモス	19,300	3,080.00	59,444,000	貸付有価証券 1,500株
乃村工藝社	65,100	869.00	56,571,900	貸付有価証券 900株
藤田観光	6,600	2,394.00	15,800,400	貸付有価証券 2,900株
KNT－CTホールディングス	9,400	1,635.00	15,369,000	
日本管財	16,300	2,779.00	45,297,700	
トーカイ	13,300	1,710.00	22,743,000	
白洋舎	1,700	1,213.00	2,062,100	貸付有価証券 700株
セコム	149,600	8,909.00	1,332,786,400	
セントラル警備保障	7,300	2,145.00	15,658,500	貸付有価証券 300株（300株）
丹青社	31,100	794.00	24,693,400	
メイテック	18,300	6,900.00	126,270,000	
応用地質	17,100	1,953.00	33,396,300	貸付有価証券 100株
船井総研ホールディングス	31,100	2,119.00	65,900,900	
進学会ホールディングス	4,900	330.00	1,617,000	貸付有価証券 1,700株（200株）
オオバ	10,400	780.00	8,112,000	貸付有価証券 4,800株
いであ	4,100	1,770.00	7,257,000	貸付有価証券 200株（100株）
学究社	4,900	1,575.00	7,717,500	貸付有価証券 400株（400株）
ベネッセホールディングス	50,600	2,204.00	111,522,400	
イオンディライト	18,700	2,748.00	51,387,600	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
ナック	7,200	935.00	6,732,000	
ダイセキ	27,700	4,385.00	121,464,500	

	ステップ	5,600	1,741.00	9,749,600	
小計	銘柄数：2,157			413,339,146,070	
	組入時価比率：97.3%			100.0%	
合計				413,339,146,070	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 4月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	11,597,362,700	—	11,418,000,000	△179,659,700
合計	11,597,362,700	—	11,418,000,000	△179,659,700

(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)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	12,666,123,285
コール・ローン	861,002,706
株式	1,266,147,987,145
投資証券	33,526,308,088
派生商品評価勘定	361,702,819
未収入金	35,858,442
未収配当金	1,262,454,376

(2022年 4月22日現在)	
差入委託証拠金	6,404,342,074
流動資産合計	1,321,265,778,935
資産合計	1,321,265,778,935
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	230,055,338
未払解約金	365,477,828
未払利息	257
その他未払費用	3,034,600
流動負債合計	598,568,023
負債合計	598,568,023
純資産の部	
元本等	
元本	275,984,980,390
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,044,682,230,522
元本等合計	1,320,667,210,912
純資産合計	1,320,667,210,912
負債純資産合計	1,321,265,778,935

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）

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	4.7853円
(10,000口当たり純資産額)	(47,853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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考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

2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	244,745,148,929円
同期中における追加設定元本額	57,371,507,247円
同期中における一部解約元本額	26,131,675,786円
期末元本額	275,984,980,390円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	29,780,325円
バランスセレクト５０	92,892,822円
バランスセレクト７０	115,531,281円
野村外国株式インデックスファンド	486,860,096円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,937,314,434円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	3,815,135,815円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	3,654,858,838円
野村資産設計ファンド２０１５	9,149,011円
野村資産設計ファンド２０２０	9,369,382円
野村資産設計ファンド２０２５	16,853,963円
野村資産設計ファンド２０３０	25,244,764円
野村資産設計ファンド２０３５	21,430,631円
野村資産設計ファンド２０４０	40,925,521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）	45,737,578,713円
のむラップ・ファンド（保守型）	753,748,775円
のむラップ・ファンド（普通型）	9,135,855,250円
のむラップ・ファンド（積極型）	8,985,218,798円
野村資産設計ファンド２０４５	7,977,891円
野村インデックスファンド・外国株式	7,251,232,965円
マイ・ロード	903,921,663円
ネクストコア	5,741,029円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	152,201,747円
野村外国株インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	2,335,171,184円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	372,867,953円
野村資産設計ファンド２０５０	10,152,710円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	3,015,587円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	1,700,513円

野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,340,505円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,149,167円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	202,054,001円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	752,296,923円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,667,441円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,427,637円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	27,567,716円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	7,255,121円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	33,673,665円
野村6資産均等バランス	1,265,250,521円
野村つみたて外国株投信	10,734,553,535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）	4,799,369,639円
世界6資産分散ファンド	35,933,403円
野村資産設計ファンド2060	7,293,421円
野村スリーゼロ先進国株式投信	763,888,327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	6,097,418,702円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	4,845,406,809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）	123,278,407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）	61,781,595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）	549,534,934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）	678,366,965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）	1,324,375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）	4,233,604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）	1,146,851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）	960,275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）	14,866,635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）	377,371,194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）	4,320,855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）	26,202,513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）	83,511,833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）	2,125,051,408円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	19,706,145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）	772,262,132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）	11,470,573,865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）	1,102,667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）	8,274,561円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	1,359,850円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	8,342,841円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	8,352,545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）	86,167,938,403円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	2,048,927,231円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	7,796,898,565円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	7,509,857,170円

マイバランスDC30	773,884,799円
マイバランスDC50	1,787,745,203円
マイバランスDC70	1,577,332,126円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	33,598,273,553円
野村DC運用戦略ファンド	180,005,247円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	12,925,013円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	373,886,130円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	316,841,592円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	311,072,285円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	16,364,423円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	7,518,433円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	41,418,042円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	7,363,184円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	6,698,143円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	5,325,529円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	170,390,901円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	131,460,223円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	76,953,848円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	107,254,898円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	3,395,684円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	26,830,501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）	90,697,152円
みらいバランス・株式10（富士通企業年金基金DC向け）	4,517,868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(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	158,000	32.91	5,199,780.00	
		HALLIBURTON CO	167,000	38.95	6,504,650.00	
		SCHLUMBERGER LTD	264,000	40.65	10,731,600.00	
		CHENIERE ENERGY INC	45,900	136.58	6,269,022.00	
		CHEVRON CORP	362,800	164.58	59,709,624.00	
		CONOCOPHILLIPS	247,500	98.67	24,420,825.00	
		COTERRA ENERGY INC	145,000	29.97	4,345,650.00	
		DEVON ENERGY CORP	120,400	61.15	7,362,460.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	32,100	137.35	4,408,935.00	

EOG RESOURCES INC	109,900	119.49	13,131,951.00	
EXXON MOBIL CORP	796,700	87.03	69,336,801.00	
HESS CORP	52,400	110.17	5,772,908.00	
KINDER MORGAN INC	385,000	19.79	7,619,150.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	114,900	88.74	10,196,226.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	177,200	59.20	10,490,240.00	
ONEOK INC	85,100	71.47	6,082,097.00	
PHILLIPS 66	90,700	85.95	7,795,665.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	43,600	243.00	10,594,800.00	
VALERO ENERGY CORP	75,900	104.91	7,962,669.00	
WILLIAMS COS	231,000	35.68	8,242,080.00	
AIR PRODUCTS	42,000	251.14	10,547,880.00	
ALBEMARLE CORP	21,800	207.24	4,517,832.00	
CELANESE CORP-SERIES A	20,900	148.04	3,094,036.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	41,200	99.36	4,093,632.00	
CORTEVA INC	138,700	60.21	8,351,127.00	
DOW INC	140,500	69.51	9,766,155.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	96,900	69.67	6,751,023.00	
EASTMAN CHEMICAL CO.	25,000	110.46	2,761,500.00	
ECOLAB INC	48,600	180.02	8,748,972.00	
FMC CORP	23,200	137.01	3,178,632.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	48,100	124.85	6,005,285.00	
LINDE PLC	96,500	324.37	31,301,705.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	49,400	111.15	5,490,810.00	
MOSAIC CO/THE	69,000	68.66	4,737,540.00	
PPG INDUSTRIES	44,000	133.15	5,858,600.00	
RPM INTERNATIONAL INC	23,500	87.43	2,054,605.00	
SHERWIN-WILLIAMS	47,200	251.61	11,875,992.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	11,600	374.80	4,347,680.00	
VULCAN MATERIALS CO	24,700	181.37	4,479,839.00	
AMCOR PLC	286,000	11.93	3,411,980.00	
AVERY DENNISON CORP	15,600	172.54	2,691,624.00	
BALL CORP	61,800	88.63	5,477,334.00	
CROWN HOLDINGS INC	24,700	121.89	3,010,683.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	67,500	49.69	3,354,075.00	

PACKAGING CORP OP AMERICA	17,700	166.03	2,938,731.00	
SEALED AIR CORP	26,500	68.18	1,806,770.00	
WESTROCK CO	52,000	52.20	2,714,400.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	276,000	44.95	12,406,200.00	
NEWMONT CORP	151,100	77.06	11,643,766.00	
NUCOR CORP	53,900	175.59	9,464,301.00	
STEEL DYNAMICS	37,100	93.24	3,459,204.00	
BOEING CO	105,500	181.02	19,097,610.00	
GENERAL DYNAMICS	44,600	242.06	10,795,876.00	
HEICO CORP	7,900	150.78	1,191,162.00	
HEICO CORP-CLASS A	13,900	123.17	1,712,063.00	
HOWMET AEROSPACE INC	72,000	35.67	2,568,240.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	7,500	221.98	1,664,850.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	36,600	246.09	9,006,894.00	
LOCKHEED MARTIN	46,900	439.54	20,614,426.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	28,300	443.45	12,549,635.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	281,700	101.73	28,657,341.00	
TEXTRON INC	40,700	69.11	2,812,777.00	
TRANSDIGM GROUP INC	10,000	634.16	6,341,600.00	
ALLEGION PLC	16,300	112.09	1,827,067.00	
CARRIER GLOBAL CORP	153,000	42.82	6,551,460.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	25,600	72.71	1,861,376.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	131,600	65.14	8,572,424.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,400	252.28	1,614,592.00	
MASCO CORP	45,800	52.16	2,388,928.00	
OWENS CORNING INC	18,900	87.47	1,653,183.00	
SMITH (A.O.) CORP	24,700	66.30	1,637,610.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	45,200	152.81	6,907,012.00	
AMETEK INC	43,800	132.25	5,792,550.00	
EATON CORP PLC	74,900	149.95	11,231,255.00	
EMERSON ELEC	111,300	96.71	10,763,823.00	
GENERAC HOLDINGS INC	11,600	241.00	2,795,600.00	
PLUG POWER INC	94,000	22.85	2,147,900.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	21,900	271.76	5,951,544.00	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	28,300	49.36	1,396,888.00	
SUNRUN INC	36,000	21.03	757,080.00	
3M CORP	108,100	151.77	16,406,337.00	
GENERAL ELECTRIC CO	205,800	91.72	18,875,976.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	129,500	195.94	25,374,230.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	41,400	55.50	2,297,700.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	20,000	469.28	9,385,600.00	
CATERPILLAR INC DEL	101,600	232.57	23,629,112.00	
CUMMINS INC	26,700	206.86	5,523,162.00	
DEERE & COMPANY	55,200	424.36	23,424,672.00	
DOVER CORP	26,800	144.16	3,863,488.00	
FORTIVE CORP	64,800	59.70	3,868,560.00	
IDEX CORP	14,200	196.03	2,783,626.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	59,400	208.29	12,372,426.00	
INGERSOLL-RAND INC	76,400	47.77	3,649,628.00	
KORNIT DIGITAL LTD	8,200	69.09	566,538.00	
NORDSON CORP	9,600	224.13	2,151,648.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	75,300	75.21	5,663,313.00	
PACCAR	65,700	88.10	5,788,170.00	
PARKER HANNIFIN CORP	23,900	286.97	6,858,583.00	
PENTAIR PLC	30,000	53.39	1,601,700.00	
SNAP-ON INC	9,700	226.19	2,194,043.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	30,900	144.25	4,457,325.00	
WABTEC CORP	34,100	92.52	3,154,932.00	
XYLEM INC	33,800	86.48	2,923,024.00	
AERCAP HOLDINGS NV	25,100	53.01	1,330,551.00	
FASTENAL CO	108,900	57.71	6,284,619.00	
GRAINGER(W.W.) INC	8,300	511.99	4,249,517.00	
UNITED RENTALS INC	13,500	337.72	4,559,220.00	
CINTAS CORP	17,700	418.89	7,414,353.00	
COPART INC	40,800	118.85	4,849,080.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	41,800	134.81	5,635,058.00	
ROLLINS INC	41,000	34.51	1,414,910.00	
WASTE CONNECTIONS INC	49,600	139.37	6,912,752.00	
WASTE MANAGEMENT INC	79,200	161.16	12,763,872.00	

C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	24,300	103.24	2,508,732.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	32,700	99.53	3,254,631.00	
FEDEX CORPORATION	47,900	206.86	9,908,594.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	137,200	188.80	25,903,360.00	
DELTA AIR LINES INC	30,000	44.73	1,341,900.00	
SOUTHWEST AIRLINES	29,000	48.38	1,403,020.00	
AMERCO	1,720	556.37	956,956.40	
CSX CORP	419,000	36.30	15,209,700.00	
GRAB HOLDINGS LTD-CL A	203,000	2.86	580,580.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	15,700	171.34	2,690,038.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30,100	49.00	1,474,900.00	
LYFT INC-A	52,000	34.11	1,773,720.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	45,900	269.82	12,384,738.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18,100	275.08	4,978,948.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	274,000	31.68	8,680,320.00	
UNION PAC CORP	121,300	244.40	29,645,720.00	
APTIV PLC	50,200	109.46	5,494,892.00	
BORGWARNER INC	45,000	38.74	1,743,300.00	
LEAR CORP	10,900	134.08	1,461,472.00	
FORD MOTOR COMPANY	743,000	15.70	11,665,100.00	
GENERAL MOTORS CO	246,000	40.71	10,014,660.00	
LUCID GROUP INC	80,000	19.55	1,564,000.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	34,600	33.76	1,168,096.00	
TESLA INC	160,640	1,008.78	162,050,419.20	
DR HORTON INC	63,300	73.26	4,637,358.00	
GARMIN LTD	28,800	113.23	3,261,024.00	
LENNAR CORP-A	50,600	79.02	3,998,412.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	128.69	1,312,638.00	
NEWELL BRANDS INC	75,000	23.36	1,752,000.00	
NVR INC	607	4,411.74	2,677,926.18	
PULTEGROUP INC	47,000	43.31	2,035,570.00	
WHIRLPOOL CORP	11,300	178.10	2,012,530.00	
HASBRO INC	25,500	88.45	2,255,475.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	52,000	20.46	1,064,180.00	

LULULEMON ATHLETICA INC	22,000	377.25	8,299,500.00	
NIKE INC-B	240,500	135.46	32,578,130.00	
V F CORP	61,700	56.49	3,485,433.00	
AIRBNB INC-CLASS A	55,500	157.91	8,764,005.00	
ARAMARK	44,000	38.92	1,712,480.00	
BOOKING HOLDINGS INC	7,700	2,239.32	17,242,764.00	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	39,700	68.11	2,703,967.00	
CARNIVAL CORP	159,000	19.51	3,102,090.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,350	1,521.11	8,137,938.50	
DARDEN RESTAURANTS INC	25,000	138.03	3,450,750.00	
DOMINOS PIZZA INC	6,900	391.00	2,697,900.00	
DRAFTKINGS INC - CL A	58,400	14.36	838,624.00	
EXPEDIA GROUP INC	27,900	183.39	5,116,581.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	53,000	156.96	8,318,880.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	64,000	37.21	2,381,440.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	52,600	184.17	9,687,342.00	
MCDONALD'S CORP	140,600	255.25	35,888,150.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	6.17	209,780.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	42.17	2,994,070.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	43,700	83.40	3,644,580.00	
STARBUCKS CORP	221,700	78.96	17,505,432.00	
VAIL RESORTS INC	7,400	255.81	1,892,994.00	
WYNN RESORTS LTD	19,300	75.42	1,455,606.00	
YUM BRANDS INC	55,800	124.44	6,943,752.00	
GENUINE PARTS CO	26,600	138.13	3,674,258.00	
LKQ CORP	52,600	49.98	2,628,948.00	
POOL CORP	7,360	427.19	3,144,118.40	
AMAZON.COM INC	85,890	2,965.92	254,742,868.80	
CHEWY INC - CLASS A	15,100	37.13	560,663.00	
DOORDASH INC-A	19,600	91.95	1,802,220.00	
EBAY INC	116,800	54.77	6,397,136.00	
ETSY INC	24,400	101.79	2,483,676.00	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	5,200	56.38	293,176.00	
MERCADOLIBRE INC	8,550	1,014.01	8,669,785.50	
WAYFAIR INC - CLASS A	14,600	92.72	1,353,712.00	

DOLLAR GENERAL CORP	44,300	255.83	11,333,269.00	
DOLLAR TREE INC	42,200	173.06	7,303,132.00	
TARGET CORP	89,800	248.17	22,285,666.00	
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	225.56	2,706,720.00	
AUTOZONE	3,950	2,233.31	8,821,574.50	
BATH & BODY WORKS INC	50,400	55.43	2,793,672.00	
BEST BUY COMPANY INC	42,400	93.64	3,970,336.00	
BURLINGTON STORES INC	12,100	217.57	2,632,597.00	
CARMAX INC	31,300	90.67	2,837,971.00	
CARVANA CO	13,800	83.14	1,147,332.00	
HOME DEPOT	196,500	310.36	60,985,740.00	
LOWES COS INC	126,800	205.03	25,997,804.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	12,760	728.15	9,291,194.00	
ROSS STORES INC	66,300	107.18	7,106,034.00	
TJX COS INC	227,600	65.94	15,007,944.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	21,500	219.18	4,712,370.00	
ULTA BEAUTY INC	9,900	421.43	4,172,157.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	83,140	591.74	49,197,263.60	
KROGER CO	133,000	58.18	7,737,940.00	
SYSCO CORP	95,600	89.74	8,579,144.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	139,000	46.81	6,506,590.00	
WALMART INC	288,600	159.87	46,138,482.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	58,500	68.82	4,025,970.00	
COCA COLA CO	772,200	66.21	51,127,362.00	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	39,300	51.36	2,018,448.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	31,200	254.21	7,931,352.00	
KEURIG DR PEPPER INC	131,000	37.51	4,913,810.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	35,000	55.87	1,955,450.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	75,000	86.88	6,516,000.00	
PEPSICO INC	260,200	174.84	45,493,368.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	104,500	96.05	10,037,225.00	
BUNGE LIMITED	26,800	122.33	3,278,444.00	
CAMPBELL SOUP CO	36,000	47.48	1,709,280.00	
CONAGRA BRANDS INC	93,000	36.56	3,400,080.00	
GENERAL MILLS	113,300	73.19	8,292,427.00	

HERSHEY CO/THE	27,500	228.79	6,291,725.00	
HORMEL FOODS CORP	55,000	54.81	3,014,550.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	20,100	143.66	2,887,566.00	
KELLOGG CO	49,400	69.72	3,444,168.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	125,000	44.00	5,500,000.00	
MCCORMICK & CO INC.	47,700	104.28	4,974,156.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	263,700	65.84	17,362,008.00	
TYSON FOODS INC-CL A	54,900	97.79	5,368,671.00	
ALTRIA GROUP INC	344,400	56.53	19,468,932.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	293,000	105.06	30,782,580.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	45,000	102.96	4,633,200.00	
CLOROX CO	22,500	148.15	3,333,375.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	150,400	82.10	12,347,840.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	64,000	128.10	8,198,400.00	
PROCTER & GAMBLE CO	455,400	162.61	74,052,594.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	43,300	271.95	11,775,435.00	
ABBOTT LABORATORIES	332,800	123.37	41,057,536.00	
ABIOMED INC	8,700	315.64	2,746,068.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	14,300	383.63	5,485,909.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	93,300	77.98	7,275,534.00	
BECTON,DICKINSON	53,400	264.89	14,145,126.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	268,000	46.31	12,411,080.00	
DENTSPLY SIRONA INC	42,200	42.09	1,776,198.00	
DEXCOM INC	18,100	472.41	8,550,621.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	117,200	125.61	14,721,492.00	
HOLOGIC INC	46,100	77.07	3,552,927.00	
IDEXX LABORATORIES INC	15,880	492.52	7,821,217.60	
INMODE LTD	8,800	28.54	251,152.00	
INSULET CORP	13,300	261.95	3,483,935.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	67,200	294.57	19,795,104.00	
MASIMO CORP	9,300	130.39	1,212,627.00	
MEDTRONIC PLC	253,100	113.09	28,623,079.00	
NOVOCURE LTD	16,400	83.65	1,371,860.00	
RESMED INC	27,500	239.00	6,572,500.00	
STERIS PLC	19,100	247.91	4,735,081.00	

STRYKER CORP	63,700	270.03	17,200,911.00	
TELEFLEX INC	8,700	338.51	2,945,037.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	9,300	409.45	3,807,885.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	40,000	131.66	5,266,400.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	28,900	165.02	4,769,078.00	
ANTHEM INC	45,700	522.87	23,895,159.00	
CARDINAL HEALTH INC	55,300	63.75	3,525,375.00	
CENTENE CORP	110,700	87.84	9,723,888.00	
CIGNA CORP	62,200	264.61	16,458,742.00	
CVS HEALTH CORP	248,400	105.18	26,126,712.00	
DAVITA INC	12,500	122.66	1,533,250.00	
HCA HEALTHCARE INC	46,700	269.44	12,582,848.00	
HENRY SCHEIN INC	25,700	90.77	2,332,789.00	
HUMANA INC	24,400	455.92	11,124,448.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	18,300	276.30	5,056,290.00	
MCKESSON CORP	28,700	331.45	9,512,615.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	11,100	340.76	3,782,436.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	23,700	141.64	3,356,868.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	177,240	537.44	95,255,865.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	14,400	154.49	2,224,656.00	
ABBVIE INC	332,700	158.52	52,739,604.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	23,000	168.75	3,881,250.00	
AMGEN INC	106,000	255.46	27,078,760.00	
BIOGEN INC	27,700	218.40	6,049,680.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	33,400	80.50	2,688,700.00	
EXACT SCIENCES CORP	32,300	60.98	1,969,654.00	
GILEAD SCIENCES INC	235,400	63.75	15,006,750.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	41,100	110.49	4,541,139.00	
INCYTE CORP	36,500	76.86	2,805,390.00	
MODERNA INC	64,800	144.50	9,363,600.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	17,000	95.76	1,627,920.00	
NOVAVAX INC	13,000	48.80	634,400.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	20,020	706.11	14,136,322.20	
SEAGEN INC	25,800	141.44	3,649,152.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	48,200	281.71	13,578,422.00	

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	417,700	77.56	32,396,812.00	
CATALENT INC	32,300	92.28	2,980,644.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	81,000	26.05	2,110,050.00	
ELI LILLY & CO.	153,000	289.61	44,310,330.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12,000	165.55	1,986,600.00	
JOHNSON & JOHNSON	495,400	183.36	90,836,544.00	
MERCK & CO INC	475,300	86.23	40,985,119.00	
PFIZER INC	1,056,300	49.11	51,874,893.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	63,000	43.59	2,746,170.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	215,000	9.38	2,016,700.00	
VIATRIS INC	229,000	10.65	2,438,850.00	
ZOETIS INC	89,400	184.72	16,513,968.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,386,000	38.91	53,929,260.00	
CITIGROUP	373,400	52.63	19,652,042.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	93,800	43.03	4,036,214.00	
FIFTH THIRD BANCORP	127,000	39.63	5,033,010.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,250	641.29	1,442,902.50	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	33,700	159.39	5,371,443.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	271,000	14.10	3,821,100.00	
JPMORGAN CHASE & CO	556,100	130.56	72,604,416.00	
KEYCORP	178,000	21.08	3,752,240.00	
M & T BANK CORP	33,700	177.78	5,991,186.00	
PNC FINANCIAL	80,000	177.58	14,206,400.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	180,000	21.54	3,877,200.00	
SIGNATURE BANK	11,500	266.19	3,061,185.00	
SVB FINANCIAL GROUP	10,890	503.13	5,479,085.70	
TRUIST FINANCIAL CORP	250,400	52.11	13,048,344.00	
US BANCORP	264,300	52.64	13,912,752.00	
WEBSTER FINANCIAL CORP	33,000	51.86	1,711,380.00	
WELLS FARGO CO	750,300	47.78	35,849,334.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	66,500	56.16	3,734,640.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	245,300	343.60	84,285,080.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	69,000	31.86	2,198,340.00	
AFLAC INC	116,900	65.50	7,656,950.00	
ALLEGHANY CORP	2,590	836.00	2,165,240.00	

ALLSTATE CORP	53,500	141.13	7,550,455.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	13,900	147.79	2,054,281.00	
AMERICAN INTL GROUP	154,900	63.13	9,778,837.00	
AON PLC	41,400	333.46	13,805,244.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	75,000	49.25	3,693,750.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	39,500	184.15	7,273,925.00	
ASSURANT INC	10,200	190.33	1,941,366.00	
BROWN & BROWN INC	46,000	70.68	3,251,280.00	
CHUBB LTD	80,800	211.53	17,091,624.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	28,500	140.28	3,997,980.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	4,400	177.86	782,584.00	
EVEREST RE GROUP LTD	7,100	293.06	2,080,726.00	
FNF GROUP	50,000	41.89	2,094,500.00	
GLOBE LIFE INC	17,700	105.91	1,874,607.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	65,300	73.11	4,774,083.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	33,200	67.54	2,242,328.00	
LOEWS CORP	41,800	66.66	2,786,388.00	
MARKEL CORP	2,500	1,483.21	3,708,025.00	
MARSH & MCLENNAN COS	94,700	178.70	16,922,890.00	
METLIFE INC	133,400	71.58	9,548,772.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	50,700	75.02	3,803,514.00	
PROGRESSIVE CO	109,900	113.02	12,420,898.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	70,600	119.86	8,462,116.00	
TRAVELERS COS INC/THE	46,600	176.26	8,213,716.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	23,800	242.73	5,776,974.00	
WR BERKLEY CORP	39,900	69.52	2,773,848.00	
ACCENTURE PLC-CL A	118,900	322.31	38,322,659.00	
AFFIRM HOLDINGS INC	33,000	32.90	1,085,700.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	31,300	119.96	3,754,748.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	79,000	230.18	18,184,220.00	
BLOCK INC	95,500	107.71	10,286,305.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	21,800	154.47	3,367,446.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	49,300	98.49	4,855,557.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	99,700	86.42	8,616,074.00	
EPAM SYSTEMS INC	10,310	286.84	2,957,320.40	

FIDELITY NATIONAL INFORMATION	113,900	103.00	11,731,700.00	
FISERV INC	112,600	101.44	11,422,144.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	14,200	258.69	3,673,398.00	
GARTNER INC	15,300	304.76	4,662,828.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	54,900	142.00	7,795,800.00	
GODADDY INC - CLASS A	32,300	85.51	2,761,973.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	168,800	139.85	23,606,680.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	13,900	203.65	2,830,735.00	
MASTERCARD INC	165,100	364.44	60,169,044.00	
MONGODB INC	11,300	377.87	4,269,931.00	
OKTA INC	28,000	138.77	3,885,560.00	
PAYCHEX INC	60,500	138.32	8,368,360.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	210,000	89.40	18,774,000.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	39,200	175.14	6,865,488.00	
TWILIO INC - A	32,200	124.84	4,019,848.00	
VERISIGN INC	18,500	212.55	3,932,175.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	314,200	216.45	68,008,590.00	
WESTERN UNION CO	75,000	19.82	1,486,500.00	
WIX.COM LTD	10,200	83.87	855,474.00	
ADOBE INC	89,550	417.48	37,385,334.00	
ANSYS INC	16,400	284.19	4,660,716.00	
ASANA INC - CL A	11,900	29.48	350,812.00	
AUTODESK INC.	41,000	195.13	8,000,330.00	
AVALARA INC	17,200	84.77	1,458,044.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	33,000	43.54	1,436,820.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	14,200	178.28	2,531,576.00	
BLACK KNIGHT INC	29,800	67.26	2,004,348.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	51,700	151.86	7,851,162.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	26,800	58.13	1,557,884.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	20,100	140.56	2,825,256.00	
CITRIX SYSTEMS INC	23,800	101.56	2,417,128.00	
COUPA SOFTWARE INC	14,200	91.33	1,296,886.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	36,900	209.85	7,743,465.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	7,100	163.13	1,158,223.00	

DATADOG INC - CLASS A	41,300	121.82	5,031,166.00	
DOCUSIGN INC	36,400	87.42	3,182,088.00	
DROPBOX INC-CLASS A	57,000	22.01	1,254,570.00	
DYNATRACE INC	33,000	41.06	1,354,980.00	
FAIR ISAAC CORP	5,120	386.67	1,979,750.40	
FORTINET INC	25,900	321.26	8,320,634.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	15,800	91.76	1,449,808.00	
HUBSPOT INC	8,400	404.28	3,395,952.00	
INTUIT INC	50,610	465.65	23,566,546.50	
MICROSOFT CORP	1,342,200	280.81	376,903,182.00	
NORTONLIFELOCK INC	110,000	26.25	2,887,500.00	
ORACLE CORPORATION	308,700	79.48	24,535,476.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	309,000	12.33	3,809,970.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	18,550	592.00	10,981,600.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	9,600	303.89	2,917,344.00	
PTC INC	20,300	101.45	2,059,435.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	14,500	93.12	1,350,240.00	
SALESFORCE INC	184,240	177.23	32,652,855.20	
SERVICENOW INC	37,450	491.67	18,413,041.50	
SPLUNK INC	30,400	125.86	3,826,144.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	42,700	71.17	3,038,959.00	
SYNOPSYS INC	28,500	295.50	8,421,750.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	82,300	63.47	5,223,581.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	7,510	396.85	2,980,343.50	
UNITY SOFTWARE INC	11,200	78.70	881,440.00	
VMWARE INC - CLASS A	39,800	110.32	4,390,736.00	
WORKDAY INC-CLASS A	36,400	212.45	7,733,180.00	
ZENDESK INC	22,600	122.89	2,777,314.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	40,600	100.95	4,098,570.00	
ZSCALER INC	15,400	211.47	3,256,638.00	
ARISTA NETWORKS INC	44,000	120.19	5,288,360.00	
CISCO SYSTEMS	793,700	52.78	41,891,486.00	
F5 INC	11,300	203.22	2,296,386.00	
JUNIPER NETWORKS INC	60,000	36.15	2,169,000.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	31,600	232.93	7,360,588.00	

APPLE INC	3,087,400	166.42	513,805,108.00	
DELL TECHNOLOGIES-C	55,800	48.21	2,690,118.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	246,000	16.32	4,014,720.00	
HP INC	217,000	38.29	8,308,930.00	
NETAPP INC	43,100	77.98	3,360,938.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	38,400	84.25	3,235,200.00	
WESTERN DIGITAL CORP	58,600	50.24	2,944,064.00	
AMPHENOL CORP-CL A	112,600	71.62	8,064,412.00	
ARROW ELECTRS INC	13,700	115.79	1,586,323.00	
CDW CORPORATION	25,000	176.41	4,410,250.00	
COGNEX CORP	33,600	71.02	2,386,272.00	
CORNING INC	155,000	34.64	5,369,200.00	
IPG PHOTONICS CORP	6,900	98.82	681,858.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	34,900	149.35	5,212,315.00	
TE CONNECTIVITY LTD	61,400	126.02	7,737,628.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	8,600	479.41	4,122,926.00	
TRIMBLE INC	47,300	68.95	3,261,335.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	10,300	390.04	4,017,412.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	307,648	89.85	27,642,172.80	
ANALOG DEVICES INC	101,400	158.71	16,093,194.00	
APPLIED MATERIALS	169,900	115.69	19,655,731.00	
BROADCOM INC	77,460	592.73	45,912,865.80	
ENPHASE ENERGY INC	24,600	156.56	3,851,376.00	
ENTEGRIS INC	25,700	115.60	2,970,920.00	
INTEL CORP	765,500	47.50	36,361,250.00	
KLA CORP	28,400	335.99	9,542,116.00	
LAM RESEARCH	26,380	469.51	12,385,673.80	
MARVELL TECHNOLOGY INC	156,200	59.95	9,364,190.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	105,600	67.62	7,140,672.00	
MICRON TECHNOLOGY	211,500	70.92	14,999,580.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,400	415.56	3,490,704.00	
NVIDIA CORP	470,440	201.83	94,948,905.20	
NXP SEMICONDUCTORS NV	50,000	174.85	8,742,500.00	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	81,700	53.26	4,351,342.00	
QORVO INC	20,700	113.59	2,351,313.00	

QUALCOMM INC	210,800	136.11	28,691,988.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	31,700	118.13	3,744,721.00	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	10,000	254.15	2,541,500.00	
TERADYNE INC	30,200	111.20	3,358,240.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	173,800	177.23	30,802,574.00	
AT & T INC	1,344,000	20.21	27,162,240.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	24.39	756,090.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	25.20	1,612,800.00	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	162,000	11.61	1,880,820.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	779,100	55.01	42,858,291.00	
T-MOBILE US INC	117,200	132.10	15,482,120.00	
ALLIANT ENERGY CORP	48,400	64.45	3,119,380.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	94,900	102.12	9,691,188.00	
CONSTELLATION ENERGY	62,900	62.67	3,941,943.00	
DUKE ENERGY CORP	144,400	115.28	16,646,432.00	
EDISON INTERNATIONAL	72,700	72.71	5,286,017.00	
ENTERGY CORP	37,600	125.33	4,712,408.00	
EVERGY INC	42,900	72.12	3,093,948.00	
EVERSOURCE ENERGY	64,400	93.10	5,995,640.00	
EXELON CORPORATION	183,000	49.74	9,102,420.00	
FIRSTENERGY CORP	104,000	48.12	5,004,480.00	
NEXTERA ENERGY INC	369,200	76.18	28,125,656.00	
NRG ENERGY INC	45,000	39.74	1,788,300.00	
PG&E CORP	277,000	12.37	3,426,490.00	
PPL CORPORATION	142,000	30.37	4,312,540.00	
SOUTHERN CO.	200,600	76.46	15,337,876.00	
XCEL ENERGY INC	102,500	75.30	7,718,250.00	
ATMOS ENERGY CORP	24,400	121.16	2,956,304.00	
UGI CORP	40,000	37.35	1,494,000.00	
AMEREN CORPORATION	49,400	97.81	4,831,814.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	120,000	32.26	3,871,200.00	
CMS ENERGY CORP	54,300	72.84	3,955,212.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	66,300	98.19	6,509,997.00	
DOMINION ENERGY INC	153,400	86.55	13,276,770.00	
DTE ENERGY COMPANY	36,200	138.28	5,005,736.00	

NISOURCE INC	73,000	31.39	2,291,470.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	95,600	74.67	7,138,452.00	
SEMPRA ENERGY	60,600	170.43	10,328,058.00	
WEC ENERGY GROUP INC	60,200	105.76	6,366,752.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	34,700	165.31	5,736,257.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	44,000	49.22	2,165,680.00	
ALLY FINANCIAL INC	67,000	43.11	2,888,370.00	
AMERICAN EXPRESS CO	123,900	185.74	23,013,186.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	79,900	139.98	11,184,402.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	55,600	116.53	6,479,068.00	
SOFI TECHNOLOGIES INC	92,000	6.60	607,200.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	39.80	4,131,240.00	
UPSTART HOLDINGS INC	8,200	75.30	617,460.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	21,300	291.71	6,213,423.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	146,400	46.15	6,756,360.00	
BLACKROCK INC	28,590	681.46	19,482,941.40	
BLACKSTONE INC	129,900	112.62	14,629,338.00	
CARLYLE GROUP INC/THE	29,000	41.46	1,202,340.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	19,500	115.00	2,242,500.00	
CME GROUP INC	67,400	228.37	15,392,138.00	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	7,800	137.32	1,071,096.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6,900	438.41	3,025,029.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	57,000	26.48	1,509,360.00	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	8,200	31.04	254,528.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	63,500	334.30	21,228,050.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	106,600	120.71	12,867,686.00	
INVESCO LTD	65,000	21.30	1,384,500.00	
KKR & CO INC-A	97,400	53.87	5,246,938.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	7,200	272.88	1,964,736.00	
MOODYS CORP	31,700	329.92	10,458,464.00	
MORGAN STANLEY	253,300	88.91	22,520,903.00	
MSCI INC	15,390	474.78	7,306,864.20	
NASDAQ INC	22,500	169.44	3,812,400.00	
NORTHERN TRUST CORP	36,300	110.34	4,005,342.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	34,200	109.76	3,753,792.00	

ROBINHOOD MARKETS INC -A	32,000	10.44	334,080.00
S&P GLOBAL INC	66,695	390.83	26,066,406.85
SCHWAB(CHARLES)CORP	272,700	73.27	19,980,729.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	22,500	57.04	1,283,400.00
STATE STREET CORP	69,800	74.58	5,205,684.00
T ROWE PRICE GROUP INC	42,100	139.58	5,876,318.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	18,700	81.33	1,520,871.00
AES CORP	127,000	23.01	2,922,270.00
VISTRA CORP	80,000	25.74	2,059,200.00
CERNER CORP	54,500	93.34	5,087,030.00
TELADOC HEALTH INC	27,600	59.05	1,629,780.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	26,500	185.98	4,928,470.00
10X GENOMICS INC-CLASS A	14,400	55.71	802,224.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	56,600	125.29	7,091,414.00
AVANTOR INC	105,000	31.32	3,288,600.00
BIO TECHNE CORP	7,500	412.09	3,090,675.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	4,300	545.24	2,344,532.00
CHARLES RIVER LABORATORIES	9,600	292.00	2,803,200.00
DANAHER CORP	121,000	278.24	33,667,040.00
ILLUMINA INC	28,000	335.79	9,402,120.00
IQVIA HOLDINGS INC	35,700	236.17	8,431,269.00
METTLER-TOLEDO INTL	4,380	1,326.23	5,808,887.40
PERKINELMER INC	21,200	159.47	3,380,764.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	74,150	580.43	43,038,884.50
WATERS CORP	11,200	307.38	3,442,656.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	14,000	365.14	5,111,960.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	24,800	89.90	2,229,520.00
CLARIVATE PLC	65,000	16.32	1,060,800.00
COSTAR GROUP INC	75,700	62.00	4,693,400.00
EQUIFAX INC	23,300	202.95	4,728,735.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	24,500	148.16	3,629,920.00
LEIDOS HOLDINGS INC	25,800	109.78	2,832,324.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	20,300	115.17	2,337,951.00
TRUNSUMION	35,200	91.17	3,209,184.00
VERISK ANALYTICS INC	28,500	215.45	6,140,325.00
CBRE GROUP INC	62,300	86.54	5,391,442.00

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	4.72	1,038,400.00	
ZILLOW GROUP INC - A	9,800	41.79	409,542.00	
ZILLOW GROUP INC - C	33,200	43.42	1,441,544.00	
CABLE ONE INC	980	1,356.39	1,329,262.20	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	23,550	519.03	12,223,156.50	
COMCAST CORP-CL A	858,100	46.94	40,279,214.00	
DISH NETWORK CORP-A	43,400	31.32	1,359,288.00	
FOX CORP-CLASS A	62,000	38.93	2,413,660.00	
FOX CORP-CLASS B	30,000	35.88	1,076,400.00	
INTERPUBRIC GROUP	73,000	35.91	2,621,430.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-A	4,000	126.43	505,720.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	26,400	131.40	3,468,960.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	29,900	44.43	1,328,457.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	17,000	44.49	756,330.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	75,000	21.35	1,601,250.00	
OMNICOM GROUP	40,000	81.42	3,256,800.00	
PARAMOUNT GLOBAL	114,000	32.31	3,683,340.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	175,000	6.35	1,111,250.00	
WARNER BROS DISCOVERY INC	414,136	21.45	8,883,217.20	
ACTIVISION BLIZZARD INC	147,500	78.90	11,637,750.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	91,000	16.85	1,533,350.00	
DISNEY (WALT) CO	342,100	121.66	41,619,886.00	
ELECTRONIC ARTS	53,200	123.74	6,582,968.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	37,100	69.35	2,572,885.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	30,900	106.76	3,298,884.00	
NETFLIX INC	83,320	218.22	18,182,090.40	
ROKU INC	22,000	99.55	2,190,100.00	
SEA LTD-ADR	60,300	91.22	5,500,566.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	21,900	131.53	2,880,507.00	
ALPHABET INC-CL A	56,610	2,496.29	141,314,976.90	
ALPHABET INC-CL C	53,810	2,498.75	134,457,737.50	
IAC/INTERACTIVECORP	15,000	91.42	1,371,300.00	
MATCH GROUP INC	50,900	77.66	3,952,894.00	
META PLATFORMS INC	445,300	188.07	83,747,571.00	
PINTEREST INC- CLASS A	103,000	20.23	2,083,690.00	

小計	銘柄数：605			7,184,868,468.83 (924,333,328,514)	
	組入時価比率：70.0%			73.0%	
カナダドル	GAMECO CORP	72,000	35.57	2,561,040.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	220,500	83.09	18,321,345.00	
	CENOVUS ENERGY INC	252,000	21.91	5,521,320.00	
	ENBRIDGE INC	380,000	58.29	22,150,200.00	
	IMPERIAL OIL	46,000	62.41	2,870,860.00	
	KEYERA CORP	41,000	33.26	1,363,660.00	
	PARKLAND CORP	28,000	35.21	985,880.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	102,000	50.07	5,107,140.00	
	SUNCOR ENERGY INC	272,000	41.89	11,394,080.00	
	TC ENERGY CORP	186,000	73.15	13,605,900.00	
	TOURMALINE OIL CORP	61,000	63.42	3,868,620.00	
	NUTRIEN LTD	108,200	135.78	14,691,396.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	28,200	57.04	1,608,528.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	86,800	77.65	6,740,020.00	
	BARRICK GOLD	336,000	30.44	10,227,840.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	111,000	39.32	4,364,520.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	36,500	204.39	7,460,235.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	122,000	11.42	1,393,240.00	
	KINROSS GOLD CORP	250,000	7.17	1,792,500.00	
	LUNDIN MINING CORP	118,000	12.99	1,532,820.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	43,000	34.37	1,477,910.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	87,000	50.41	4,385,670.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	85,000	61.77	5,250,450.00	
	WEST FRASER TIMBER	17,800	110.29	1,963,162.00	
	CAE INC	60,000	33.38	2,002,800.00	
	WSP GLOBAL INC	22,800	163.20	3,720,960.00	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	37,000	11.57	428,090.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	15,000	123.32	1,849,800.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	30,000	41.77	1,253,100.00	

RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	21,100	71.27	1,503,797.00	
AIR CANADA	32,000	24.66	789,120.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	132,600	160.23	21,246,498.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	175,900	97.56	17,160,804.00	
TFI INTERNATIONAL INC	14,900	108.50	1,616,650.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	52,800	80.29	4,239,312.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	45.43	1,680,910.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	52,400	76.13	3,989,212.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	10,200	191.22	1,950,444.00	
DOLLARAMA INC	55,600	75.50	4,197,800.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	161,000	57.32	9,228,520.00	
EMPIRE CO LTD A	32,000	42.99	1,375,680.00	
LOBLAW COMPANIES	31,400	116.35	3,653,390.00	
METRO INC	46,700	70.27	3,281,609.00	
WESTON(GEORGE)LTD	14,100	157.47	2,220,327.00	
SAPUTO INC	50,000	30.71	1,535,500.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	58,000	27.94	1,620,520.00	
CANOPY GROWTH CORP	35,000	7.21	252,350.00	
BANK OF MONTREAL	121,400	146.03	17,728,042.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	229,700	86.42	19,850,674.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	84,600	147.18	12,451,428.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	63,400	94.85	6,013,490.00	
ROYAL BANK OF CANADA	268,200	138.57	37,164,474.00	
TORONTO DOMINION BANK	343,000	94.67	32,471,810.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,640	699.49	3,245,633.60	
GREAT-WEST LIFE CO INC	50,000	37.05	1,852,500.00	
IA FINANCIAL CORP INC	21,100	74.70	1,576,170.00	
INTACT FINANCIAL CORP	32,900	182.66	6,009,514.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	370,000	26.73	9,890,100.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	103,000	39.09	4,026,270.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	110,800	67.97	7,531,076.00	
CGI INC	42,100	103.78	4,369,138.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	14,000	77.96	1,091,440.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	21,320	604.58	12,889,645.60	

		BLACKBERRY LTD	94,000	7.75	728,500.00	
		CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,810	2,129.85	8,114,728.50	
		LIGHTSPEED COMMERCE INC	19,400	28.58	554,452.00	
		OPEN TEXT CORP	51,000	52.94	2,699,940.00	
		BCE INC	14,400	73.13	1,053,072.00	
		TELUS CORP	78,600	33.71	2,649,606.00	
		ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	67,000	74.73	5,006,910.00	
		EMERA INC	47,000	64.40	3,026,800.00	
		FORTIS INC	89,000	63.98	5,694,220.00	
		HYDRO ONE LTD	63,000	35.38	2,228,940.00	
		ALTAGAS LTD	52,000	30.04	1,562,080.00	
		ALGONQUIN POWER & UTILITIES	126,000	19.66	2,477,160.00	
		CANADIAN UTILITIES LTD A	27,000	39.42	1,064,340.00	
		BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	267,100	68.43	18,277,653.00	
		IGM FINANCIAL INC	15,000	43.02	645,300.00	
		ONEX CORPORATION	13,200	80.13	1,057,716.00	
		TMX GROUP LTD	11,300	127.24	1,437,812.00	
		BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	47.27	1,134,480.00	
		NORTHLAND POWER INC	40,000	40.25	1,610,000.00	
		THOMSON REUTERS CORP	32,600	131.75	4,295,050.00	
		FIRSTSERVICE CORP	7,200	169.86	1,222,992.00	
		QUEBECOR INC-CL B	34,000	32.46	1,103,640.00	
		SHAW COMMUNICATIONS INC-B	84,000	38.77	3,256,680.00	
	小計	銘柄数：86			490,499,005.70	
					(50,109,378,422)	
		組入時価比率：3.8%			4.0%	
ユーロ		TENARIS SA	88,000	14.99	1,319,120.00	
		ENI SPA	472,000	14.00	6,608,000.00	
		GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	96,000	11.65	1,118,400.00	
		NESTE OYJ	78,000	44.51	3,471,780.00	
		OMV AG	28,100	46.66	1,311,146.00	
		REPSOL SA	274,000	13.67	3,746,950.00	
		TOTALENERGIES SE	473,600	47.15	22,330,240.00	
		AIR LIQUIDE SA	89,700	162.66	14,590,602.00	
		AKZO NOBEL	34,500	83.88	2,893,860.00	

ARKEMA	11,600	113.25	1,313,700.00	
BASF SE	172,600	53.62	9,254,812.00	
COVESTRO AG	38,000	46.37	1,762,060.00	
EVONIK INDUSTRIES AG	39,000	25.80	1,006,200.00	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	15,000	31.72	475,800.00	
KONINKLIJKE DSM NV	33,300	157.30	5,238,090.00	
LANXESS	15,500	39.22	607,910.00	
SOLVAY SA	14,200	91.94	1,305,548.00	
SYMRISE AG	25,500	109.35	2,788,425.00	
UMICORE	39,000	37.78	1,473,420.00	
CRH PLC	146,000	39.20	5,723,930.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	27,400	53.50	1,465,900.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	46,200	40.32	1,862,784.00	
ARCELORMITTAL	119,000	30.77	3,662,225.00	
VOESTALPINE AG	20,000	25.68	513,600.00	
STORA ENSO OYJ-R	108,000	19.42	2,097,900.00	
UPM-KYMMENE OYJ	102,000	32.61	3,326,220.00	
AIRBUS SE	110,600	108.52	12,002,312.00	
DASSAULT AVIATION SA	5,000	158.90	794,500.00	
MTU AERO ENGINES AG	10,100	199.25	2,012,425.00	
SAFRAN SA	64,400	109.46	7,049,224.00	
THALES SA	20,600	125.20	2,579,120.00	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	93,900	54.87	5,152,293.00	
KINGSPAN GROUP PLC	29,900	90.88	2,717,312.00	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	46,168	24.97	1,152,814.96	
BOUYGUES	46,000	32.29	1,485,340.00	
EIFFAGE SA	15,900	96.98	1,541,982.00	
FERROVIAL SA	95,000	25.56	2,428,200.00	
VINCI	101,200	94.65	9,578,580.00	
LEGRAND SA	51,200	86.88	4,448,256.00	
PRYSMIAN SPA	48,000	30.76	1,476,480.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	102,300	147.34	15,072,882.00	
SIEMENS ENERGY AG	73,000	19.15	1,397,950.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	45,000	15.70	706,500.00	
SIEMENS AG	143,300	123.00	17,625,900.00	

ALSTOM	61,000	22.00	1,342,000.00	
CNH INDUSTRIAL NV	193,000	14.70	2,837,100.00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	75,900	25.97	1,971,502.50	
GEA GROUP AG	29,000	38.81	1,125,490.00	
KION GROUP AG	13,100	59.06	773,686.00	
KNORR-BREMSE AG	12,700	71.32	905,764.00	
KONE OYJ	63,500	46.91	2,978,785.00	
RATIONAL AG	1,050	640.50	672,525.00	
WARTSILA OYJ	82,000	8.62	707,004.00	
BRENNTAG SE	29,000	76.10	2,206,900.00	
IMCD NV	10,200	154.75	1,578,450.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	184,600	42.39	7,825,194.00	
INPOST SA	34,000	6.02	204,952.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	112,000	7.49	838,992.00	
ADP	6,100	144.75	882,975.00	
AENA SME SA	14,400	150.95	2,173,680.00	
ATLANTIA SPA	89,000	22.79	2,028,310.00	
GETLINK	83,000	17.69	1,468,270.00	
CONTINENTAL AG	20,600	68.18	1,404,508.00	
FAURECIA	20,688	24.02	496,925.76	
MICHELIN (CGDE)	31,200	121.45	3,789,240.00	
VALEO SA	44,000	17.85	785,400.00	
BAYER MOTOREN WERK	62,000	80.08	4,964,960.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	70.60	720,120.00	
FERRARI NV	24,100	204.20	4,921,220.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	160,700	65.85	10,582,095.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	29,400	83.90	2,466,660.00	
RENAULT SA	33,700	23.52	792,792.50	
STELLANTIS NV	384,000	13.55	5,203,200.00	
VOLKSWAGEN AG	5,800	221.60	1,285,280.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	34,400	156.74	5,391,856.00	
SEB SA	5,400	124.70	673,380.00	
ADIDAS AG	36,200	207.45	7,509,690.00	
ESSILORLUXOTTICA	54,100	171.70	9,288,970.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,970	1,254.50	7,489,365.00	

KERING SA	14,110	553.10	7,804,241.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	52,240	653.40	34,133,616.00	
MONCLER SPA	37,600	51.16	1,923,616.00	
PUMA SE	18,900	77.80	1,470,420.00	
ACCOR SA	32,000	31.69	1,014,080.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	31,100	100.55	3,127,105.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	20,000	36.84	736,800.00	
SODEXO	15,900	73.58	1,169,922.00	
DELIVERY HERO SE	29,000	34.18	991,220.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	32,900	25.62	842,898.00	
PROSUS NV	175,400	43.17	7,572,895.00	
ZALANDO SE	40,200	42.33	1,701,666.00	
INDITEX SA	209,000	21.09	4,407,810.00	
CARREFOUR SUPERMARCHÉ	119,000	19.77	2,352,630.00	
COLRUYT SA	8,700	35.01	304,587.00	
HELLOFRESH SE	31,800	38.93	1,237,974.00	
JERONIMO MARTINS	55,000	20.22	1,112,100.00	
KESKO OYJ-B SHS	50,000	24.50	1,225,000.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	199,000	28.17	5,605,830.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	163,300	57.52	9,393,016.00	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	91,000	10.78	980,980.00	
HEINEKEN HOLDING NV	22,000	75.95	1,670,900.00	
HEINEKEN NV	49,600	94.82	4,703,072.00	
PERNOD RICARD SA	39,100	195.35	7,638,185.00	
REMY COINTREAU	3,900	189.40	738,660.00	
DANONE	124,400	55.34	6,884,296.00	
JDE PEET'S BV	21,000	27.52	577,920.00	
KERRY GROUP PLC-A	29,300	102.00	2,988,600.00	
HENKEL AG & CO KGAA	20,300	60.45	1,227,135.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	33,200	60.72	2,015,904.00	
BEIERSDORF AG	19,800	95.62	1,893,276.00	
LOREAL-ORD	47,000	360.95	16,964,650.00	
BIOMERIEUX	6,900	93.68	646,392.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	7,200	135.25	973,800.00	
DIASORIN SPA	4,800	130.10	624,480.00	

KONINKLIJKE PHILIPS NV	174,000	28.37	4,937,250.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,100	395.50	2,017,050.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	53,900	57.30	3,088,470.00	
AMPLIFON SPA	24,000	39.53	948,720.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	39,900	63.56	2,536,044.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	78,000	35.00	2,730,000.00	
ORPEA	9,300	35.12	326,616.00	
ARGENX SE	8,300	295.80	2,455,140.00	
GRIFOLS SA	54,000	16.66	899,640.00	
BAYER AG-REG	186,300	66.30	12,351,690.00	
IPSEN	7,300	111.70	815,410.00	
MERCK KGAA	24,300	181.85	4,418,955.00	
ORION OYJ	21,000	40.66	853,860.00	
RECORDATI SPA	19,900	47.88	952,812.00	
SANOFI	214,800	103.24	22,175,952.00	
UCB SA	24,500	111.75	2,737,875.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	82,000	12.64	1,036,480.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,245,000	5.15	6,414,240.00	
BANCO SANTANDER SA	3,260,000	3.23	10,529,800.00	
BNP PARIBAS	211,200	52.40	11,066,880.00	
CAIXABANK	830,000	3.13	2,598,730.00	
COMMERZBANK AG	188,000	6.89	1,295,696.00	
CREDIT AGRICOLE SA	226,000	10.51	2,377,068.00	
ERSTE GROUP BANK AG	65,000	32.76	2,129,400.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	111,000	14.10	1,565,100.00	
ING GROEP NV	727,000	9.85	7,164,585.00	
INTESA SANPAOLO	3,080,000	2.02	6,237,000.00	
KBC GROEP NV	46,000	66.72	3,069,120.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	124,000	9.57	1,187,424.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	29,000	11.61	336,690.00	
SOCIETE GENERALE	151,000	24.30	3,670,055.00	
UNICREDIT SPA	406,000	9.46	3,841,166.00	
EURAZEO SE	7,800	79.40	619,320.00	
EXOR NV	19,500	70.78	1,380,210.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	21,400	95.38	2,041,132.00	

SOFINA SA	2,900	320.20	928,580.00	
WENDEL	4,300	96.90	416,670.00	
AEGON NV	329,000	5.33	1,754,886.00	
AGEAS	32,000	48.78	1,560,960.00	
ALLIANZ SE-REG	77,200	222.40	17,169,280.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	208,000	18.67	3,883,360.00	
AXA SA	366,000	27.09	9,914,940.00	
CNP ASSURANCES	36,000	21.80	784,800.00	
HANNOVER RUECK SE	10,900	150.45	1,639,905.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	26,700	243.50	6,501,450.00	
NN GROUP NV	49,400	48.51	2,396,394.00	
POSTE ITALIANE SPA	103,000	9.87	1,017,228.00	
SAMPO OYJ-A SHS	95,000	48.01	4,560,950.00	
ADYEN NV	3,700	1,728.00	6,393,600.00	
AMADEUS IT GROUP SA	86,100	60.20	5,183,220.00	
BECHTLE AG	15,700	45.18	709,326.00	
CAPGEMINI SA	30,000	195.20	5,856,000.00	
EDENRED	47,000	49.07	2,306,290.00	
NEXI SPA	104,000	9.17	954,304.00	
WORLDLINE SA	44,800	35.75	1,601,600.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	125,000	40.84	5,105,625.00	
NEMETSCHEK SE	11,000	81.96	901,560.00	
SAP SE	197,300	99.56	19,643,188.00	
NOKIA OYJ	1,002,000	4.98	4,993,467.00	
ASM INTERNATIONAL NV	9,000	321.15	2,890,350.00	
ASML HOLDING NV	77,780	584.00	45,423,520.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	244,000	28.54	6,963,760.00	
STMICROELECTRONICS NV	128,000	35.97	4,604,800.00	
CELLNEX TELECOM SA	95,000	45.58	4,330,100.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	615,000	17.48	10,750,200.00	
ELISA OYJ	25,700	54.32	1,396,024.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	55,000	10.31	567,325.00	
KONINKLIJKE KPN NV	610,000	3.31	2,019,710.00	
ORANGE SA	382,000	11.08	4,234,088.00	
PROXIMUS	26,000	17.34	450,840.00	

TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.30	579,193.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.83	596,190.00	
TELEFONICA SA	990,000	4.83	4,790,610.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	31.03	521,304.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	91,152	8.77	799,767.64	
ELIA GROUP SA/NV	6,200	149.20	925,040.00	
ENDESA S.A.	57,000	19.86	1,132,020.00	
ENEL SPA	1,529,000	6.11	9,342,190.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	509,000	4.62	2,353,616.00	
FORTUM OYJ	89,000	16.33	1,453,370.00	
IBERDROLA SA	1,094,000	10.52	11,508,880.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	79,000	18.47	1,459,130.00	
TERNA SPA	275,000	7.85	2,158,750.00	
VERBUND AG	12,700	95.10	1,207,770.00	
ENAGAS SA	48,000	20.51	984,480.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	34,000	28.94	983,960.00	
SNAM SPA	384,000	5.23	2,011,392.00	
E.ON SE	425,000	10.20	4,335,000.00	
ENGIE	337,000	12.16	4,099,268.00	
RWE AG	119,000	40.14	4,776,660.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	125,000	29.06	3,632,500.00	
AMUNDI SA	12,800	61.65	789,120.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	387,000	11.36	4,397,094.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	35,900	163.55	5,871,445.00	
EURONEXT NV	15,300	80.06	1,224,918.00	
EDP RENOVAVEIS SA	58,000	22.77	1,320,660.00	
UNIPER SE	15,100	24.20	365,420.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	25,500	89.80	2,289,900.00	
QIAGEN N.V.	44,000	43.10	1,896,400.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,950	344.90	1,707,255.00	
BUREAU VERITAS SA	54,000	25.80	1,393,200.00	
RANDSTAD NV	21,400	54.02	1,156,028.00	
TELEPERFORMANCE	11,300	345.00	3,898,500.00	
WOLTERS KLUWER	50,300	97.22	4,890,166.00	
AROUNDTOWN SA	173,000	5.14	889,220.00	

小計	LEG IMMOBILIEN SE	14,000	100.05	1,400,700.00	
	VONOVIA SE	139,200	39.83	5,544,336.00	
	PUBLICIS GROUPE	43,300	58.66	2,539,978.00	
	VIVENDI SE	145,000	11.77	1,706,650.00	
	BOLLORE SE	168,000	4.65	781,200.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	34.56	597,888.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	135,000	24.12	3,256,200.00	
	SCOUT24 SE	15,200	57.86	879,472.00	
	銘柄数：227			860,494,331.36	
				(119,927,094,961)	
	組入時価比率：9.1%			9.5%	
英ポンド	BP PLC	3,730,000	4.03	15,037,495.00	
	SHELL PLC-NEW	1,449,000	22.22	32,196,780.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	26,300	76.78	2,019,314.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	34,800	19.18	667,464.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	242,300	36.79	8,914,217.00	
	ANTOFAGASTA PLC	70,000	15.20	1,064,000.00	
	GLENCORE PLC	1,861,000	4.89	9,113,317.00	
	RIO TINTO PLC-REG	210,700	57.45	12,104,715.00	
	MONDI PLC	91,000	15.06	1,370,915.00	
	BAE SYSTEMS PLC	599,000	7.41	4,439,788.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,520,000	0.96	1,468,320.00	
	DCC PLC	18,400	60.00	1,104,000.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	870,000	1.28	1,119,255.00	
	SMITHS GROUP PLC	71,000	14.82	1,052,575.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	14,100	127.20	1,793,520.00	
	ASHTED GROUP PLC	83,200	48.17	4,007,744.00	
	BUNZLE	66,000	31.63	2,087,580.00	
	FERGUSON PLC	41,800	107.90	4,510,220.00	
	RENTOKIL INTIAL PLC	345,000	5.24	1,807,800.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	181,000	5.26	952,060.00	
	PERSIMMON PLC	58,000	22.47	1,303,260.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	710,000	1.34	954,950.00	
	THE BERKELEY GRP HOLDINGS	20,871	40.74	850,284.54	
	BURBERRY GROUP PLC	73,000	16.71	1,220,195.00	

COMPASS GROUP PLC	333,000	17.49	5,824,170.00
ENTAIN PLC	110,000	15.38	1,692,350.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	35,400	53.06	1,878,324.00
WHITBREAD PLC	36,300	29.96	1,087,548.00
NEXT PLC	26,000	63.58	1,653,080.00
JD SPORTS FASHION PLC	465,000	1.47	684,712.50
KINGFISHER PLC	390,000	2.68	1,047,150.00
OCADO GROUP PLC	92,000	10.90	1,002,800.00
SAINSBURY	340,000	2.42	824,840.00
TESCO PLC	1,470,000	2.65	3,896,970.00
COCA-COLA HBC AG-DI	39,000	16.53	644,670.00
DIAGEO PLC	439,000	39.21	17,213,190.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	68,000	16.56	1,126,420.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	412,000	33.44	13,779,340.00
IMPERIAL BRANDS PLC	180,000	16.85	3,033,000.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	135,500	61.68	8,357,640.00
UNILEVER PLC	483,600	35.15	16,998,540.00
SMITH & NEPHEW PLC	170,000	13.02	2,214,250.00
NMC HEALTH PLC	13,300	0.00	53.20
ASTRAZENECA PLC	291,480	105.04	30,617,059.20
GLAXOSMITHKLINE PLC	943,000	17.44	16,453,464.00
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	29,600	20.50	606,800.00
BARCLAYS PLC	3,190,000	1.50	4,786,914.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,829,000	5.36	20,557,901.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	13,370,000	0.46	6,273,872.50
NATWEST GROUP PLC	1,070,000	2.26	2,422,480.00
STANDARD CHARTERED PLC	479,000	5.24	2,510,918.00
M&G PLC	500,000	2.17	1,086,500.00
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	25.34	886,900.00
AVIVA PLC	712,000	4.44	3,161,280.00
LEGAL & GENERAL	1,140,000	2.65	3,023,280.00
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	122,000	6.26	763,964.00
PRUDENTIAL PLC	518,000	10.71	5,550,370.00
AVEVA GROUP PLC	19,911	25.21	501,956.31
SAGE GROUP PLC (THE)	197,000	7.27	1,432,584.00

	HALMA PLC	70,000	25.21	1,764,700.00	
	BT GROUP PLC	1,700,000	1.88	3,201,950.00	
	VODAFONE GROUP PLC	5,120,000	1.28	6,579,200.00	
	SSE PLC	204,000	18.14	3,700,560.00	
	NATIONAL GRID PLC	680,000	11.62	7,905,000.00	
	SEVERN TRENT PLC	48,000	30.21	1,450,080.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	122,000	11.21	1,367,620.00	
	3I GROUP PLC	178,000	13.73	2,444,830.00	
	ABRDN PLC	420,000	2.00	840,000.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	9.86	641,030.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	62,700	80.10	5,022,270.00	
	SCHRODERS PLC	24,000	31.62	758,880.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	104,000	13.68	1,422,720.00	
	EXPERIAN PLC	172,000	27.84	4,788,480.00	
	INTERTEK GROUP PLC	31,000	50.62	1,569,220.00	
	RELX PLC	364,000	23.99	8,732,360.00	
	INFORMA PLC	275,000	5.99	1,648,900.00	
	PEARSON	148,000	7.89	1,167,720.00	
	WPP PLC	218,000	10.25	2,235,590.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	171,000	6.36	1,088,586.00	
小計	銘柄数：79			353,084,755.25	
				(59,138,165,656)	
	組入時価比率：4.5%			4.7%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	16.11	660,510.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,370	878.50	1,203,545.00	
	GIVAUDAN-REG	1,740	3,857.00	6,711,180.00	
	SIKA AG-REG	27,000	315.40	8,515,800.00	
	HOLCIM LTD	96,500	45.85	4,424,525.00	
	GEBERIT AG-REG	6,880	554.40	3,814,272.00	
	ABB LTD	309,000	31.55	9,748,950.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,700	192.20	711,140.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	7,400	192.35	1,423,390.00	
	VAT GROUP AG	5,300	332.80	1,763,840.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	10,100	277.40	2,801,740.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	98,900	120.50	11,917,450.00	

		THE SWATCH GROUP AG-B	5,500	264.50	1,454,750.00	
		THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	50.55	530,775.00	
		BARRY CALLEBAUT AG	710	2,262.00	1,606,020.00	
		CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	195	10,960.00	2,137,200.00	
		CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	20	113,000.00	2,260,000.00	
		NESTLE SA-REG	529,700	122.68	64,983,596.00	
		ALCON INC	95,100	77.00	7,322,700.00	
		SONOVA HOLDING AG-REG	10,300	374.70	3,859,410.00	
		STRAUMANN HOLDING AG-REG	19,000	131.50	2,498,500.00	
		NOVARTIS AG-REG	412,300	86.24	35,556,752.00	
		ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	132,200	366.30	48,424,860.00	
		ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,800	393.80	2,284,040.00	
		VIFOR PHARMA AG/NEW	9,100	169.35	1,541,085.00	
		BALOISE HOLDING AG	8,600	176.00	1,513,600.00	
		SWISS LIFE HOLDING AG	6,010	624.80	3,755,048.00	
		SWISS RE LTD	57,100	83.94	4,792,974.00	
		ZURICH INSURANCE GROUP AG	28,500	452.80	12,904,800.00	
		TEMENOS AG-REG	12,000	93.20	1,118,400.00	
		LOGITECH INTERNATIONAL-REG	31,600	67.70	2,139,320.00	
		SWISSCOM AG-REG	4,850	559.80	2,715,030.00	
		CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	504,000	7.13	3,596,544.00	
		JULIUS BAER GROUP LTD	42,200	48.95	2,065,690.00	
		PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,290	1,161.00	4,980,690.00	
		UBS GROUP AG	661,000	16.96	11,213,865.00	
		BACHEM HOLDING AG-REG B	1,100	468.00	514,800.00	
		LONZA AG-REG	13,890	629.20	8,739,588.00	
		ADECCO GROUP AG-REG	28,100	39.70	1,115,570.00	
		SGS SA-REG	1,140	2,503.00	2,853,420.00	
		SWISS PRIME SITE-REG	13,500	94.30	1,273,050.00	
		小計銘柄数：41			293,448,419.00	
					(39,550,977,912)	
		組入時価比率：3.0%			3.1%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN ENERGY AB	37,000	429.10	15,876,700.00		
	BOLIDEN AB	53,000	482.20	25,556,600.00		
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	112,000	195.90	21,940,800.00		

ASSA ABLOY AB-B	190,000	259.20	49,248,000.00	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	273,000	104.80	28,610,400.00	
SKANSKA AB-B SHS	66,000	202.40	13,358,400.00	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	26,000	283.20	7,363,200.00	
LIFCO AB-B SHS	42,000	220.10	9,244,200.00	
ALFA LAVAL AB	57,000	328.00	18,696,000.00	
ATLAS COPCO AB-A	126,900	491.50	62,371,350.00	
ATLAS COPCO AB-B	73,100	427.10	31,221,010.00	
EPIROC AB - A	121,000	211.80	25,627,800.00	
EPIROC AB - B	69,000	177.00	12,213,000.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	73,000	96.44	7,040,120.00	
SANDVIK AB	210,000	208.00	43,680,000.00	
SKF AB-B SHARES	68,000	164.70	11,199,600.00	
VOLVO AB-A SHS	40,000	169.20	6,768,000.00	
VOLVO AB-B SHS	269,000	164.18	44,164,420.00	
SECURITAS AB-B SHS	54,000	118.85	6,417,900.00	
ELECTROLUX AB-B	41,000	157.40	6,453,400.00	
EVOLUTION AB	32,900	924.70	30,422,630.00	
HENNES&MAURITZ AB-B	133,000	130.46	17,351,180.00	
SWEDISH MATCH AB	308,000	78.00	24,024,000.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	116,000	231.40	26,842,400.00	
GETINGE AB-B SHS	45,000	350.40	15,768,000.00	
NORDEA BANK ABP	607,000	102.04	61,938,280.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	314,000	111.40	34,979,600.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	283,000	94.34	26,698,220.00	
SWEDBANK AB	170,000	160.00	27,200,000.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	270.80	6,524,113.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	32,000	265.10	8,483,200.00	
INVESTOR AB-A SHS	96,000	221.60	21,273,600.00	
INVESTOR AB-B SHS	344,000	205.30	70,623,200.00	
KINNEVIK AB - B	44,000	203.90	8,971,600.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	15,500	472.20	7,319,100.00	
SINCH AB	92,000	56.96	5,240,320.00	
ERICSSON LM-B	547,000	82.03	44,870,410.00	
HEXAGON AB-B SHS	363,000	132.25	48,006,750.00	

		TELIA CO AB	480,000	38.58	18,518,400.00	
		TELE 2 AB-B SHS	92,000	145.20	13,358,400.00	
		EQT AB	59,000	344.90	20,349,100.00	
		FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	18,700	528.80	9,888,560.00	
		SAGAX AB-B	29,000	258.10	7,484,900.00	
		EMBRACER GROUP AB	110,000	68.27	7,509,700.00	
		小計 銘柄数：44			1,010,696,563.60	
		組入時価比率：1.0%			(13,644,403,608)	1.1%
	ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	22,000	360.00	7,920,000.00	
		EQUINOR ASA	185,000	335.00	61,975,000.00	
		YARA INTERNATIONAL ASA	33,100	492.90	16,314,990.00	
		NORSK HYDRO	246,000	89.22	21,948,120.00	
		MOWI ASA	84,000	256.20	21,520,800.00	
		ORKLA ASA	133,000	75.18	9,998,940.00	
		DNB BANK ASA	174,000	200.30	34,852,200.00	
		GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40,000	215.40	8,616,000.00	
		TELENOR ASA	129,000	132.00	17,028,000.00	
		SCHIBSTED ASA-B SHS	18,100	178.90	3,238,090.00	
		SCHIBSTED ASA-CL A	14,400	198.20	2,854,080.00	
		ADEVINTA ASA	63,000	70.15	4,419,450.00	
		小計 銘柄数：12			210,685,670.00	
		組入時価比率：0.2%			(3,044,407,931)	0.2%
	デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	20,400	540.80	11,032,320.00	
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	37,600	460.50	17,314,800.00	
		ROCKWOOL A/S-B SHS	1,700	2,094.00	3,559,800.00	
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	191,000	201.40	38,467,400.00	
		DSV A/S	38,800	1,157.00	44,891,600.00	
		A P MOLLER - MAERSK A/S-A	560	19,140.00	10,718,400.00	
		AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,090	19,640.00	21,407,600.00	
		PANDORA A/S	17,700	676.00	11,965,200.00	
		CARLSBERG B	19,300	899.80	17,366,140.00	
		AMBU A/S-B	29,000	112.05	3,249,450.00	

小計	COLOPLAST-B	22,100	1,028.00	22,718,800.00	
	DEMANT A/S	20,100	308.60	6,202,860.00	
	GN STORE NORD A/S	24,100	284.90	6,866,090.00	
	GENMAB A/S	12,600	2,587.00	32,596,200.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	316,900	770.90	244,298,210.00	
	DANSKE BANK AS	132,000	119.85	15,820,200.00	
	TRYG A/S	68,000	171.45	11,658,600.00	
	ORSTED A/S	35,100	812.70	28,525,770.00	
	銘柄数：18			548,659,440.00	
				(10,276,391,311)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	AMPOL LTD	40,000	32.99	1,319,600.00	
	SANTOS LTD.	610,000	8.37	5,105,700.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	38,000	28.14	1,069,320.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	185,000	32.97	6,099,450.00	
	ORICA LTD	79,000	16.60	1,311,400.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	85,000	41.04	3,488,400.00	
	BHP GROUP LIMITED	953,000	50.70	48,317,100.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	90,000	22.25	2,002,500.00	
	EVOLUTION MINING LTD	340,000	4.34	1,475,600.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	313,000	21.48	6,723,240.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	34,000	62.05	2,109,700.00	
	NEWCREST MINING	164,000	28.80	4,723,200.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	194,000	11.22	2,176,680.00	
	RIO TINTO LTD	70,200	116.36	8,168,472.00	
	SOUTH32 LTD	870,000	5.09	4,428,300.00	
	REECE LTD	49,000	17.35	850,150.00	
	BRAMBLES LTD	270,000	10.82	2,921,400.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	5.64	958,800.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	380,000	3.92	1,489,600.00	
	TRANSURBAN GROUP	586,000	13.95	8,174,700.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	110,000	33.16	3,647,600.00	
	CROWN RESORTS LTD	77,000	12.84	988,680.00	
	DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	10,300	80.34	827,502.00	
	TABCORP HOLDINGS	420,000	5.42	2,276,400.00	

	WESFARMERS LIMITED	212,000	49.35	10,462,200.00	
	COLES GROUP LTD	243,000	18.68	4,539,240.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	253,000	7.61	1,925,330.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	233,000	39.47	9,196,510.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	135,000	11.19	1,510,650.00	
	COCHLEAR LTD	12,800	236.16	3,022,848.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	33,000	82.99	2,738,670.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	84,000	37.15	3,120,600.00	
	CSL LIMITED	90,500	266.98	24,161,690.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	530,000	28.00	14,840,000.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	321,100	108.35	34,791,185.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	619,000	33.60	20,798,400.00	
	WESTPAC BANKING CORP	695,000	24.51	17,034,450.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	480,000	4.46	2,140,800.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	520,000	3.22	1,674,400.00	
	QBE INSURANCE	266,000	12.24	3,255,840.00	
	SUNCORP GROUP LTD	245,000	11.33	2,775,850.00	
	COMPUTERSHARE LTD	101,000	25.66	2,591,660.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	28,000	46.08	1,290,240.00	
	XERO LIMITED	25,500	99.30	2,532,150.00	
	TELSTRA CORP LTD	790,000	4.04	3,191,600.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	330,000	6.78	2,237,400.00	
	APA GROUP	229,000	11.47	2,626,630.00	
	ASX LTD	37,800	83.63	3,161,214.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	63,200	210.95	13,332,040.00	
	IDP EDUCATION LTD	37,000	28.15	1,041,550.00	
	REA GROUP LTD	10,400	125.50	1,305,200.00	
	SEEK LTD	60,000	27.89	1,673,400.00	
	小計銘柄数：52			313,625,241.00	
				(29,675,220,303)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	223,000	7.90	1,761,700.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	109,000	22.60	2,463,400.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	74,000	8.95	662,300.00	

小計	SPARK NEW ZEALAND LTD	380,000	4.93	1,873,400.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	5.95	815,150.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	250,000	4.90	1,225,000.00	
	銘柄数：6			8,800,950.00	
				(760,402,080)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	16.94	5,590,200.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	509,040	57.90	29,473,416.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	262,000	114.80	30,077,600.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	230,000	25.90	5,957,000.00	
	MTR CORP	307,000	42.50	13,047,500.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	409,000	45.75	18,711,750.00	
	SANDS CHINA LTD	432,000	17.72	7,655,040.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	410,000	12.98	5,321,800.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	350,000	20.40	7,140,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,538,306	5.44	8,368,384.64	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	670,000	29.90	20,033,000.00	
	HANG SENG BANK	140,000	154.00	21,560,000.00	
	AIA GROUP LTD	2,284,000	79.30	181,121,200.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	719,600	10.90	7,843,640.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	134,000	54.30	7,276,200.00	
	CLP HLDGS	317,000	77.25	24,488,250.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	254,000	52.90	13,436,600.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,070,383	9.00	18,633,447.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	228,000	322.80	73,598,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	383,040	54.70	20,952,288.00	
	ESR CAYMAN LTD	380,000	24.55	9,329,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	16.52	5,947,200.00	
	HENDERSON LAND	267,443	33.30	8,905,851.90	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	268,916	31.20	8,390,179.20	
	SINO LAND CO.LTD	620,000	10.68	6,621,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	250,000	94.60	23,650,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	44.75	4,654,000.00	

	小計	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	20.00	4,600,000.00	
		WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	311,000	38.35	11,926,850.00	
		銘柄数：29			604,310,396.74	
		組入時価比率：0.8%			(9,910,690,506)	0.8%
	シンガポール ド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	310,000	4.15	1,286,500.00	
		KEPPEL CORP.	280,000	6.65	1,862,000.00	
		SINGAPORE AIRLINES LTD	240,000	5.52	1,324,800.00	
		GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.81	920,950.00	
		WILMAR INTERNATIONAL LTD	380,000	4.59	1,744,200.00	
		DBS GROUP HLDGS	338,000	33.39	11,285,820.00	
		OCBC-ORD	649,000	12.08	7,839,920.00	
		UNITED OVERSEAS BANK	220,000	31.15	6,853,000.00	
		VENTURE CORP LTD	58,000	17.16	995,280.00	
		SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,540,000	2.66	4,096,400.00	
		SINGAPORE EXCHANGE LTD	148,000	9.90	1,465,200.00	
		CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	480,000	4.02	1,929,600.00	
		CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	8.43	590,100.00	
		UOL GROUP LIMITED	87,000	7.13	620,310.00	
		銘柄数：14			42,814,080.00	
		組入時価比率：0.3%			(4,033,514,476)	0.3%
	新シェケル	ICL GROUP LTD	139,000	40.65	5,650,350.00	
		ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	714.70	3,573,500.00	
		BANK HAPOLIM BM	224,000	31.51	7,058,240.00	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	267,000	35.70	9,531,900.00	
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	213,000	19.92	4,242,960.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	28,000	124.30	3,480,400.00	
		NICE LTD	11,600	688.40	7,985,440.00	
		AZRIELI GROUP	8,600	294.50	2,532,700.00	
		銘柄数：8			44,055,490.00	
		組入時価比率：0.1%			(1,744,011,465)	0.1%
	合計				1,266,147,987,145	

(1,266,147,987,145)

(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(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	93,000	1,103,910.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,100	5,610,446.00	
		AMERICAN TOWER CORP	86,000	22,940,500.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	267,000	1,780,890.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,600	6,809,866.00	
		BOSTON PROPERTIES	28,600	3,635,918.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,800	3,207,844.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	81,100	15,928,040.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	54,000	8,118,360.00	
		DUKE REALTY CORP	70,100	4,276,801.00	
		EQUINIX INC	16,910	12,811,523.30	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,100	2,655,954.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	67,400	6,284,376.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,000	4,311,720.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	24,900	5,403,549.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	100,000	3,540,000.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	135,000	2,786,400.00	
		INVITATION HOMES INC	113,000	4,944,880.00	
		IRON MOUNTAIN INC	54,000	3,109,320.00	
		KIMCO REALTY CORP	115,000	2,985,400.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	108,000	2,195,640.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,400	4,546,644.00	
		PROLOGIS INC	139,100	23,755,498.00	
		PUBLIC STORAGE	29,700	12,253,329.00	
		REALTY INCOME CORP	106,800	7,963,008.00	
		REGENCY CENTERS CORP	28,800	2,088,288.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	20,500	7,588,280.00	

小計	SIMON PROPERTY GROUP INC	61,300	8,021,105.00	
	SUN COMMUNITIES INC	21,300	4,059,567.00	
	UDR INC	59,100	3,513,495.00	
	VENTAS INC	73,600	4,417,472.00	
	VICI PROPERTIES INC	120,000	3,614,400.00	
	VORNADO REALTY TRUST	32,000	1,341,760.00	
	WELLTOWER INC	82,200	7,998,060.00	
	WEYERHAEUSER CO	143,000	5,967,390.00	
	WP CAREY INC	34,000	2,903,600.00	
	銘柄数：36	2,504,410	224,473,233.30	
カナダドル			(28,878,481,464)	
			86.2%	
	組入時価比率：2.2%			
小計	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	775,098.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	695,800.00	
	銘柄数：2	42,900	1,470,898.00	
			(150,266,939)	
ユーロ			0.4%	
	組入時価比率：0.0%			
小計	COVIVIO	10,900	809,870.00	
	GECINA SA	8,100	918,540.00	
	KLEPIERRE	40,000	946,000.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,900	1,711,240.00	
英ポンド	銘柄数：4	82,900	4,385,650.00	
			(611,228,040)	
	組入時価比率：0.0%		1.8%	
小計	BRITISH LAND	159,000	833,478.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	132,000	1,011,648.00	
	SEGRO PLC	231,000	3,180,870.00	
	銘柄数：3	522,000	5,025,996.00	
豪ドル			(841,804,070)	
	組入時価比率：0.1%		2.5%	
小計	DEXUS/AU	196,000	2,142,280.00	
	GOODMAN GROUP	319,000	7,455,030.00	
	GPT GROUP	380,000	1,953,200.00	
	LENDLEASE GROUP	135,000	1,628,100.00	
	MIRVAC GROUP	750,000	1,845,000.00	
	SCENTRE GROUP	1,010,000	3,080,500.00	

小計		STOCKLAND TRUST GROUP	460,000	1,932,000.00	
		VICINITY CENTRES	670,000	1,289,750.00	
		銘柄数：8	3,920,000	21,325,860.00	
		組入時価比率：0.2%		(2,017,852,873)	6.0%
香港ドル		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,633,100.00	
		LINK REIT	392,000	26,656,000.00	
	小計	銘柄数：2	862,000	30,289,100.00	
		組入時価比率：0.0%		(496,741,240)	1.5%
シンガポールドル		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	620,040	1,804,316.40	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	904,221	2,079,708.30	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	703,000.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	570,329	1,037,998.78	
	小計	銘柄数：4	2,464,590	5,625,023.48	
		組入時価比率：0.0%		(529,933,462)	1.6%
	合計			33,526,308,088	
				(33,526,308,088)	

(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	2022年 4月22日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	20,072,169,650	—	20,202,700,363	130,530,713
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	371,932,102	—	373,048,870	1,116,768
米ドル	371,932,102	—	373,048,870	1,116,768

合計	—	—	—	131,647,481

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	119,321,812
コール・ローン	2,569,882,327
株式	97,075,774,676
投資証券	2,578,101,486
派生商品評価勘定	15,452,221
未収入金	2,804,071
未収配当金	97,199,308
差入委託証拠金	1,499,001,037
流動資産合計	103,957,536,938
資産合計	103,957,536,938
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,939,851,097
未払解約金	27,445,532
未払利息	769
その他未払費用	252,200
流動負債合計	4,967,549,598
負債合計	4,967,549,598
純資産の部	
元本等	
元本	35,410,314,778
剰余金	

(2022年 4月22日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（△）	63,579,672,562
元本等合計	98,989,987,340
純資産合計	98,989,987,340
負債純資産合計	103,957,536,938

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。 配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
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)

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2,7955円
(10,000口当たり純資産額)	(27,955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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 当ファンドは、信託財産に属する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

2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	29,321,030,343円
同期中における追加設定元本額	12,604,288,242円
同期中における一部解約元本額	6,515,003,807円
期末元本額	35,410,314,778円
期末元本額の内訳＊	
野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型	2,585,036,944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	1,087,782,675円
野村外国株インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	1,606,835,129円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	605,756円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	659,589円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	2,086,695円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	460,052円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	1,499,280円
野村外国株インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	16,701,013,907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）	4,448,582,599円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジあり）連動型上場投信	2,328,642,699円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	118,310,842円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	4,822,886,330円
野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	1,130,648,684円
ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	492,364,457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）	7,921,607円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスオープン投信・為替ヘッジ型（適格機関投資家専用）	592,204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）	14,524,888円
先進8ヵ国国債入替型プラス外国株式戦略30オープン（為替ヘッジあり）（適格機関投資家専用）	59,860,441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(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	11,800	32.91	388,338.00	
		HALLIBURTON CO	11,800	38.95	459,610.00	
		SCHLUMBERGER LTD	20,620	40.65	838,203.00	
		CHENIERE ENERGY INC	3,450	136.58	471,201.00	
		CHEVRON CORP	27,910	164.58	4,593,427.80	
		CONOCOPHILLIPS	19,190	98.67	1,893,477.30	
		COTERRA ENERGY INC	10,800	29.97	323,676.00	
		DEVON ENERGY CORP	9,610	61.15	587,651.50	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	2,450	137.35	336,507.50	
		EOG RESOURCES INC	8,570	119.49	1,024,029.30	
		EXXON MOBIL CORP	61,270	87.03	5,332,328.10	
		HESS CORP	3,660	110.17	403,222.20	
		KINDER MORGAN INC	29,600	19.79	585,784.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	9,070	88.74	804,871.80	
		OCCIDENTAL PETE CORP	13,750	59.20	814,000.00	
		ONEOK INC	6,660	71.47	475,990.20	
		PHILLIPS 66	6,410	85.95	550,939.50	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,410	243.00	828,630.00	
		VALERO ENERGY CORP	5,460	104.91	572,808.60	
		WILLIAMS COS	18,100	35.68	645,808.00	
		AIR PRODUCTS	3,260	251.14	818,716.40	
		ALBEMARLE CORP	1,680	207.24	348,163.20	
		CELANESE CORP-SERIES A	1,610	148.04	238,344.40	
		CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,190	99.36	316,958.40	
		CORTEVA INC	9,740	60.21	586,445.40	
		DOW INC	10,800	69.51	750,708.00	
		DUPONT DE NEMOURS INC	6,900	69.67	480,723.00	
		EASTMAN CHEMICAL CO.	1,980	110.46	218,710.80	
		ECOLAB INC	3,460	180.02	622,869.20	
		FMC CORP	1,790	137.01	245,247.90	

INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	3,830	124.85	478,175.50
LINDE PLC	7,450	324.37	2,416,556.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,020	111.15	446,823.00
MOSAIC CO/THE	5,300	68.66	363,898.00
PPG INDUSTRIES	3,440	133.15	458,036.00
RPM INTERNATIONAL INC	1,820	87.43	159,122.60
SHERWIN-WILLIAMS	3,650	251.61	918,376.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	933	374.80	349,688.40
VULCAN MATERIALS CO	1,980	181.37	359,112.60
AMCOR PLC	21,900	11.93	261,267.00
AVERY DENNISON CORP	1,260	172.54	217,400.40
BALL CORP	4,770	88.63	422,765.10
CROWN HOLDINGS INC	1,870	121.89	227,934.30
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	5,190	49.69	257,891.10
PACKAGING CORP OP AMERICA	1,330	166.03	220,819.90
SEALED AIR CORP	2,300	68.18	156,814.00
WESTROCK CO	3,690	52.20	192,618.00
FREEMONT-MCMORAN INC	21,510	44.95	966,874.50
NEWMONT CORP	11,700	77.06	901,602.00
NUCOR CORP	3,820	175.59	670,753.80
STEEL DYNAMICS	3,000	93.24	279,720.00
BOEING CO	8,140	181.02	1,473,502.80
GENERAL DYNAMICS	3,490	242.06	844,789.40
HEICO CORP	570	150.78	85,944.60
HEICO CORP-CLASS A	1,040	123.17	128,096.80
HOWMET AEROSPACE INC	5,800	35.67	206,886.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	590	221.98	130,968.20
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,890	246.09	711,200.10
LOCKHEED MARTIN	3,615	439.54	1,588,937.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,207	443.45	978,694.15
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	21,750	101.73	2,212,627.50
TEXTRON INC	3,210	69.11	221,843.10
TRANSDIGM GROUP INC	757	634.16	480,059.12
ALLEGION PLC	1,180	112.09	132,266.20
CARRIER GLOBAL CORP	11,940	42.82	511,270.80

FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	2,040	72.71	148,328.40
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	9,450	65.14	615,573.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	489	252.28	123,364.92
MASCO CORP	3,660	52.16	190,905.60
OWENS CORNING INC	1,560	87.47	136,453.20
SMITH (A.O.) CORP	1,900	66.30	125,970.00
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,160	152.81	482,879.60
AMETEK INC	3,360	132.25	444,360.00
EATON CORP PLC	5,860	149.95	878,707.00
EMERSON ELEC	8,750	96.71	846,212.50
GENERAC HOLDINGS INC	918	241.00	221,238.00
PLUG POWER INC	7,100	22.85	162,235.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,680	271.76	456,556.80
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	2,260	49.36	111,553.60
SUNRUN INC	2,430	21.03	51,102.90
3M CORP	8,420	151.77	1,277,903.40
GENERAL ELECTRIC CO	16,020	91.72	1,469,354.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	10,020	195.94	1,963,318.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	3,200	55.50	177,600.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,555	469.28	729,730.40
CATERPILLAR INC DEL	7,880	232.57	1,832,651.60
CUMMINS INC	1,880	206.86	388,896.80
DEERE & COMPANY	4,289	424.36	1,820,080.04
DOVER CORP	2,240	144.16	322,918.40
FORTIVE CORP	4,860	59.70	290,142.00
IDEX CORP	1,110	196.03	217,593.30
ILLINOIS TOOL WORKS INC	4,610	208.29	960,216.90
INGERSOLL-RAND INC	5,800	47.77	277,066.00
KORNIT DIGITAL LTD	660	69.09	45,599.40
NORDSON CORP	780	224.13	174,821.40
OTIS WORLDWIDE CORP	6,020	75.21	452,764.20
PACCAR	5,060	88.10	445,786.00
PARKER HANNIFIN CORP	1,870	286.97	536,633.90
PENTAIR PLC	2,420	53.39	129,203.80

SNAP-ON INC	760	226.19	171,904.40
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,330	144.25	336,102.50
WABTEC CORP	2,540	92.52	235,000.80
XYLEM INC	2,510	86.48	217,064.80
AERCAP HOLDINGS NV	2,010	53.01	106,550.10
FASTENAL CO	8,350	57.71	481,878.50
GRAINGER(W.W.) INC	620	511.99	317,433.80
UNITED RENTALS INC	1,090	337.72	368,114.80
CINTAS CORP	1,241	418.89	519,842.49
COPART INC	3,170	118.85	376,754.50
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	3,320	134.81	447,569.20
ROLLINS INC	3,150	34.51	108,706.50
WASTE CONNECTIONS INC	3,800	139.37	529,606.00
WASTE MANAGEMENT INC	6,130	161.16	987,910.80
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	1,900	103.24	196,156.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	2,420	99.53	240,862.60
FEDEX CORPORATION	3,410	206.86	705,392.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	10,600	188.80	2,001,280.00
DELTA AIR LINES INC	1,960	44.73	87,670.80
SOUTHWEST AIRLINES	2,100	48.38	101,598.00
AMERCO	150	556.37	83,455.50
CSX CORP	32,500	36.30	1,179,750.00
GRAB HOLDINGS LTD-CL A	16,200	2.86	46,332.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	1,190	171.34	203,894.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	2,340	49.00	114,660.00
LYFT INC-A	3,620	34.11	123,478.20
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,570	269.82	963,257.40
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,290	275.08	354,853.20
UBER TECHNOLOGIES INC	19,600	31.68	620,928.00
UNION PAC CORP	9,340	244.40	2,282,696.00
APTIV PLC	3,910	109.46	427,988.60
BORGWARNER INC	3,610	38.74	139,851.40
LEAR CORP	810	134.08	108,604.80
FORD MOTOR COMPANY	57,700	15.70	905,890.00

GENERAL MOTORS CO	17,660	40.71	718,938.60
LUCID GROUP INC	5,770	19.55	112,803.50
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	2,460	33.76	83,049.60
TESLA INC	12,317	1,008.78	12,425,143.26
DR HORTON INC	5,050	73.26	369,963.00
GARMIN LTD	2,190	113.23	247,973.70
LENNAR CORP-A	4,090	79.02	323,191.80
MOHAWK INDUSTRIES	850	128.69	109,386.50
NEWELL BRANDS INC	5,700	23.36	133,152.00
NVR INC	49	4,411.74	216,175.26
PULTEGROUP INC	3,700	43.31	160,247.00
WHIRLPOOL CORP	880	178.10	156,728.00
HASBRO INC	1,840	88.45	162,748.00
PELOTON INTERACTIVE INC-A	4,000	20.46	81,860.00
LULULEMON ATHLETICA INC	1,707	377.25	643,965.75
NIKE INC-B	18,560	135.46	2,514,137.60
V F CORP	4,760	56.49	268,892.40
AIRBNB INC-CLASS A	3,970	157.91	626,902.70
ARAMARK	3,000	38.92	116,760.00
BOOKING HOLDINGS INC	600	2,239.32	1,343,592.00
CAESARS ENTERTAINMENT INC	3,010	68.11	205,011.10
CARNIVAL CORP	13,100	19.51	255,581.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	377	1,521.11	573,458.47
DARDEN RESTAURANTS INC	1,900	138.03	262,257.00
DOMINOS PIZZA INC	552	391.00	215,832.00
DRAFTKINGS INC - CL A	4,610	14.36	66,199.60
EXPEDIA GROUP INC	2,180	183.39	399,790.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,730	156.96	585,460.80
LAS VEGAS SANDS CORP	5,010	37.21	186,422.10
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	3,720	184.17	685,112.40
MCDONALD'S CORP	10,840	255.25	2,766,910.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	2,900	6.17	17,893.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	5,580	42.17	235,308.60
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,360	83.40	280,224.00
STARBUCKS CORP	17,120	78.96	1,351,795.20

VAIL RESORTS INC	590	255.81	150,927.90
WYNN RESORTS LTD	1,400	75.42	105,588.00
YUM BRANDS INC	4,380	124.44	545,047.20
GENUINE PARTS CO	2,010	138.13	277,641.30
LKQ CORP	4,070	49.98	203,418.60
POOL CORP	562	427.19	240,080.78
AMAZON.COM INC	6,586	2,965.92	19,533,549.12
CHEWY INC - CLASS A	1,090	37.13	40,471.70
DOORDASH INC-A	1,530	91.95	140,683.50
EBAY INC	8,320	54.77	455,686.40
ETSY INC	1,850	101.79	188,311.50
FIVERR INTERNATIONAL LTD	420	56.38	23,679.60
MERCADOLIBRE INC	613	1,014.01	621,588.13
WAYFAIR INC - CLASS A	1,000	92.72	92,720.00
DOLLAR GENERAL CORP	3,430	255.83	877,496.90
DOLLAR TREE INC	3,260	173.06	564,175.60
TARGET CORP	6,980	248.17	1,732,226.60
ADVANCE AUTO PARTS	960	225.56	216,537.60
AUTOZONE	280	2,233.31	625,326.80
BATH & BODY WORKS INC	3,900	55.43	216,177.00
BEST BUY COMPANY INC	3,160	93.64	295,902.40
BURLINGTON STORES INC	920	217.57	200,164.40
CARMAX INC	2,280	90.67	206,727.60
CARVANA CO	1,090	83.14	90,622.60
HOME DEPOT	15,120	310.36	4,692,643.20
LOWES COS INC	9,800	205.03	2,009,294.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	997	728.15	725,965.55
ROSS STORES INC	5,160	107.18	553,048.80
TJX COS INC	17,610	65.94	1,161,203.40
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,620	219.18	355,071.60
ULTA BEAUTY INC	780	421.43	328,715.40
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	6,401	591.74	3,787,727.74
KROGER CO	10,210	58.18	594,017.80
SYSCO CORP	6,850	89.74	614,719.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,740	46.81	455,929.40

WALMART INC	22,230	159.87	3,553,910.10	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	4,850	68.82	333,777.00	
COCA COLA CO	59,460	66.21	3,936,846.60	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	2,900	51.36	148,944.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,190	254.21	556,719.90	
KEURIG DR PEPPER INC	9,300	37.51	348,843.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	2,700	55.87	150,849.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	5,750	86.88	499,560.00	
PEPSICO INC	20,040	174.84	3,503,793.60	
ARCHER DANIELS MIDLAND	8,110	96.05	778,965.50	
BUNGE LIMITED	1,970	122.33	240,990.10	
CAMPBELL SOUP CO	2,600	47.48	123,448.00	
CONAGRA BRANDS INC	7,130	36.56	260,672.80	
GENERAL MILLS	8,840	73.19	646,999.60	
HERSHEY CO/THE	1,920	228.79	439,276.80	
HORMEL FOODS CORP	4,180	54.81	229,105.80	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	1,580	143.66	226,982.80	
KELLOGG CO	3,610	69.72	251,689.20	
KRAFT HEINZ CO/THE	8,770	44.00	385,880.00	
MCCORMICK & CO INC.	3,870	104.28	403,563.60	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	20,380	65.84	1,341,819.20	
TYSON FOODS INC-CL A	3,840	97.79	375,513.60	
ALTRIA GROUP INC	26,800	56.53	1,515,004.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	22,620	105.06	2,376,457.20	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,500	102.96	360,360.00	
CLOROX CO	1,750	148.15	259,262.50	
COLGATE PALMOLIVE CO.	11,750	82.10	964,675.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,500	128.10	576,450.00	
PROCTER & GAMBLE CO	35,020	162.61	5,694,602.20	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,400	271.95	924,630.00	
ABBOTT LABORATORIES	25,640	123.37	3,163,206.80	
ABIOMED INC	620	315.64	195,696.80	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,085	383.63	416,238.55	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	6,670	77.98	520,126.60	
BECTON,DICKINSON	4,160	264.89	1,101,942.40	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	20,910	46.31	968,342.10	
DENTSPLY SIRONA INC	3,070	42.09	129,216.30	
DEXCOM INC	1,304	472.41	616,022.64	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,140	125.61	1,148,075.40	
HOLOGIC INC	3,600	77.07	277,452.00	
IDEXX LABORATORIES INC	1,230	492.52	605,799.60	
INMODE LTD	710	28.54	20,263.40	
INSULET CORP	980	261.95	256,711.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,200	294.57	1,531,764.00	
MASIMO CORP	710	130.39	92,576.90	
MEDTRONIC PLC	19,550	113.09	2,210,909.50	
NOVOCURE LTD	1,200	83.65	100,380.00	
RESMED INC	2,110	239.00	504,290.00	
STERIS PLC	1,300	247.91	322,283.00	
STRYKER CORP	4,960	270.03	1,339,348.80	
TELEFLEX INC	679	338.51	229,848.29	
THE COOPER COMPANIES, INC.	694	409.45	284,158.30	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,030	131.66	398,929.80	
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,020	165.02	333,340.40	
ANTHEM INC	3,533	522.87	1,847,299.71	
CARDINAL HEALTH INC	4,110	63.75	262,012.50	
CENTENE CORP	8,600	87.84	755,424.00	
CIGNA CORP	4,840	264.61	1,280,712.40	
CVS HEALTH CORP	19,200	105.18	2,019,456.00	
DAVITA INC	920	122.66	112,847.20	
HCA HEALTHCARE INC	3,650	269.44	983,456.00	
HENRY SCHEIN INC	2,030	90.77	184,263.10	
HUMANA INC	1,889	455.92	861,232.88	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,240	276.30	342,612.00	
MCKESSON CORP	2,050	331.45	679,472.50	
MOLINA HEALTHCARE INC	820	340.76	279,423.20	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,880	141.64	266,283.20	
UNITEDHEALTH GROUP INC	13,620	537.44	7,319,932.80	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,100	154.49	169,939.00	
ABBVIE INC	25,600	158.52	4,058,112.00	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,700	168.75	286,875.00	
AMGEN INC	8,190	255.46	2,092,217.40	
BIOGEN INC	1,930	218.40	421,512.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,500	80.50	201,250.00	
EXACT SCIENCES CORP	2,330	60.98	142,083.40	
GILEAD SCIENCES INC	18,360	63.75	1,170,450.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	2,780	110.49	307,162.20	
INCYTE CORP	2,560	76.86	196,761.60	
MODERNA INC	5,070	144.50	732,615.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,400	95.76	134,064.00	
NOVAVAX INC	990	48.80	48,312.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,547	706.11	1,092,352.17	
SEAGEN INC	1,950	141.44	275,808.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	3,730	281.71	1,050,778.30	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	32,230	77.56	2,499,758.80	
CATALENT INC	2,410	92.28	222,394.80	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	6,200	26.05	161,510.00	
ELI LILLY & CO.	11,780	289.61	3,411,605.80	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	990	165.55	163,894.50	
JOHNSON & JOHNSON	38,070	183.36	6,980,515.20	
MERCK & CO INC	36,630	86.23	3,158,604.90	
PFIZER INC	81,280	49.11	3,991,660.80	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	4,870	43.59	212,283.30	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	15,800	9.38	148,204.00	
VIATRIS INC	18,000	10.65	191,700.00	
ZOETIS INC	6,910	184.72	1,276,415.20	
BANK OF AMERICA CORP	106,680	38.91	4,150,918.80	
CITIGROUP	28,950	52.63	1,523,638.50	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	6,240	43.03	268,507.20	
FIFTH THIRD BANCORP	8,990	39.63	356,273.70	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	170	641.29	109,019.30	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,320	159.39	369,784.80	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	18,600	14.10	262,260.00	
JPMORGAN CHASE & CO	42,760	130.56	5,582,745.60	
KEYCORP	13,600	21.08	286,688.00	

M & T BANK CORP	2,490	177.78	442,672.20
PNC FINANCIAL	6,190	177.58	1,099,220.20
REGIONS FINANCIAL CORP	14,000	21.54	301,560.00
SIGNATURE BANK	870	266.19	231,585.30
SVB FINANCIAL GROUP	775	503.13	389,925.75
TRUIST FINANCIAL CORP	19,550	52.11	1,018,750.50
US BANCORP	20,630	52.64	1,085,963.20
WEBSTER FINANCIAL CORP	2,600	51.86	134,836.00
WELLS FARGO CO	57,860	47.78	2,764,550.80
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	5,590	56.16	313,934.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	18,850	343.60	6,476,860.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,900	31.86	187,974.00
AFLAC INC	9,190	65.50	601,945.00
ALLEGHANY CORP	211	836.00	176,396.00
ALLSTATE CORP	3,820	141.13	539,116.60
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,030	147.79	152,223.70
AMERICAN INTL GROUP	11,180	63.13	705,793.40
AON PLC	3,230	333.46	1,077,075.80
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,950	49.25	293,037.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,750	184.15	506,412.50
ASSURANT INC	910	190.33	173,200.30
BROWN & BROWN INC	3,400	70.68	240,312.00
CHUBB LTD	6,290	211.53	1,330,523.70
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,140	140.28	300,199.20
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	320	177.86	56,915.20
EVEREST RE GROUP LTD	570	293.06	167,044.20
FNF GROUP	3,940	41.89	165,046.60
GLOBE LIFE INC	1,600	105.91	169,456.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	4,970	73.11	363,356.70
LINCOLN NATIONAL CORP	2,580	67.54	174,253.20
LOEWS CORP	3,210	66.66	213,978.60
MARKEL CORP	193	1,483.21	286,259.53
MARSH & MCLENNAN COS	7,380	178.70	1,318,806.00
METLIFE INC	9,620	71.58	688,599.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,840	75.02	288,076.80

PROGRESSIVE CO	8,570	113.02	968,581.40
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,070	119.86	607,690.20
TRAVELERS COS INC/THE	3,300	176.26	581,658.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,870	242.73	453,905.10
WR BERKLEY CORP	3,045	69.52	211,688.40
ACCENTURE PLC-CL A	9,160	322.31	2,952,359.60
AFFIRM HOLDINGS INC	2,450	32.90	80,605.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	2,570	119.96	308,297.20
AUTOMATIC DATA PROCESS	6,150	230.18	1,415,607.00
BLOCK INC	7,450	107.71	802,439.50
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1,690	154.47	261,054.30
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,880	98.49	382,141.20
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	7,050	86.42	609,261.00
EPAM SYSTEMS INC	808	286.84	231,766.72
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	8,940	103.00	920,820.00
FISERV INC	8,730	101.44	885,571.20
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	980	258.69	253,516.20
GARTNER INC	1,240	304.76	377,902.40
GLOBAL PAYMENTS INC	4,260	142.00	604,920.00
GODADDY INC - CLASS A	2,300	85.51	196,673.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	13,060	139.85	1,826,441.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,070	203.65	217,905.50
MASTERCARD INC	12,700	364.44	4,628,388.00
MONGODB INC	868	377.87	327,991.16
OKTA INC	2,200	138.77	305,294.00
PAYCHEX INC	4,700	138.32	650,104.00
PAYPAL HOLDINGS INC	16,250	89.40	1,452,750.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	2,830	175.14	495,646.20
TWILIO INC - A	2,510	124.84	313,348.40
VERISIGN INC	1,430	212.55	303,946.50
VISA INC-CLASS A SHARES	24,170	216.45	5,231,596.50
WESTERN UNION CO	6,100	19.82	120,902.00
WIX.COM LTD	780	83.87	65,418.60
ADOBE INC	6,900	417.48	2,880,612.00
ANSYS INC	1,140	284.19	323,976.60

ASANA INC - CL A	950	29.48	28,006.00	
AUTODESK INC.	2,950	195.13	575,633.50	
AVALARA INC	1,260	84.77	106,810.20	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,560	43.54	111,462.40	
BILL.COM HOLDINGS INC	1,070	178.28	190,759.60	
BLACK KNIGHT INC	2,200	67.26	147,972.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	4,020	151.86	610,477.20	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,870	58.13	108,703.10	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	1,640	140.56	230,518.40	
CITRIX SYSTEMS INC	1,800	101.56	182,808.00	
COUPA SOFTWARE INC	1,050	91.33	95,896.50	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,620	209.85	549,807.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	630	163.13	102,771.90	
DATADOG INC - CLASS A	3,260	121.82	397,133.20	
DOCUSIGN INC	2,810	87.42	245,650.20	
DROPBOX INC-CLASS A	4,500	22.01	99,045.00	
DYNATRACE INC	2,680	41.06	110,040.80	
FAIR ISAAC CORP	400	386.67	154,668.00	
FORTINET INC	1,870	321.26	600,756.20	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,070	91.76	98,183.20	
HUBSPOT INC	634	404.28	256,313.52	
INTUIT INC	3,913	465.65	1,822,088.45	
MICROSOFT CORP	102,920	280.81	28,900,965.20	
NORTONLIFELOCK INC	9,200	26.25	241,500.00	
ORACLE CORPORATION	23,860	79.48	1,896,392.80	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	22,600	12.33	278,658.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,449	592.00	857,808.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	730	303.89	221,839.70	
PTC INC	1,560	101.45	158,262.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,070	93.12	99,638.40	
SALESFORCE INC	14,210	177.23	2,518,438.30	
SERVICENOW INC	2,901	491.67	1,426,334.67	
SPLUNK INC	2,340	125.86	294,512.40	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,370	71.17	239,842.90	

SYNOPTIS INC	2,050	295.50	605,775.00
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	6,430	63.47	408,112.10
TYLER TECHNOLOGIES INC	583	396.85	231,363.55
UNITY SOFTWARE INC	780	78.70	61,386.00
VMWARE INC - CLASS A	2,984	110.32	329,194.88
WORKDAY INC-CLASS A	2,590	212.45	550,245.50
ZENDESK INC	1,940	122.89	238,406.60
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,340	100.95	337,173.00
ZSCALER INC	1,190	211.47	251,649.30
ARISTA NETWORKS INC	3,350	120.19	402,636.50
CISCO SYSTEMS	61,150	52.78	3,227,497.00
F5 INC	920	203.22	186,962.40
JUNIPER NETWORKS INC	4,600	36.15	166,290.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,460	232.93	573,007.80
APPLE INC	236,730	166.42	39,396,606.60
DELL TECHNOLOGIES-C	4,340	48.21	209,231.40
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	18,700	16.32	305,184.00
HP INC	15,400	38.29	589,666.00
NETAPP INC	3,110	77.98	242,517.80
SEAGATE TECHNOLOGY	3,010	84.25	253,592.50
WESTERN DIGITAL CORP	4,650	50.24	233,616.00
AMPHENOL CORP-CL A	8,020	71.62	574,392.40
ARROW ELECTRS INC	1,050	115.79	121,579.50
CDW CORPORATION	1,980	176.41	349,291.80
COGNEX CORP	2,460	71.02	174,709.20
CORNING INC	10,700	34.64	370,648.00
IPG PHOTONICS CORP	540	98.82	53,362.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2,730	149.35	407,725.50
TE CONNECTIVITY LTD	4,770	126.02	601,115.40
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	661	479.41	316,890.01
TRIMBLE INC	3,490	68.95	240,635.50
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	795	390.04	310,081.80
ADVANCED MICRO DEVICES	23,740	89.85	2,133,039.00
ANALOG DEVICES INC	7,840	158.71	1,244,286.40
APPLIED MATERIALS	13,160	115.69	1,522,480.40

BROADCOM INC	5,966	592.73	3,536,227.18
ENPHASE ENERGY INC	1,840	156.56	288,070.40
ENTEGRIS INC	1,930	115.60	223,108.00
INTEL CORP	59,020	47.50	2,803,450.00
KLA CORP	2,050	335.99	688,779.50
LAM RESEARCH	2,063	469.51	968,599.13
MARVELL TECHNOLOGY INC	11,140	59.95	667,843.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	7,410	67.62	501,064.20
MICRON TECHNOLOGY	16,360	70.92	1,160,251.20
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	630	415.56	261,802.80
NVIDIA CORP	36,140	201.83	7,294,136.20
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,580	174.85	625,963.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	6,140	53.26	327,016.40
QORVO INC	1,530	113.59	173,792.70
QUALCOMM INC	16,270	136.11	2,214,509.70
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,580	118.13	304,775.40
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	770	254.15	195,695.50
TERADYNE INC	2,420	111.20	269,104.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	13,410	177.23	2,376,654.30
AT & T INC	103,700	20.21	2,095,777.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,300	24.39	56,097.00
LIBERTY GLOBAL PLC-C	4,600	25.20	115,920.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	13,200	11.61	153,252.00
VERIZON COMMUNICATIONS	60,040	55.01	3,302,800.40
T-MOBILE US INC	9,130	132.10	1,206,073.00
ALLIANT ENERGY CORP	3,670	64.45	236,531.50
AMERICAN ELECTRIC POWER	7,420	102.12	757,730.40
CONSTELLATION ENERGY	4,706	62.67	294,925.02
DUKE ENERGY CORP	11,240	115.28	1,295,747.20
EDISON INTERNATIONAL	4,950	72.71	359,914.50
ENTERGY CORP	3,140	125.33	393,536.20
EVERGY INC	3,150	72.12	227,178.00
EVERSOURCE ENERGY	5,000	93.10	465,500.00
EXELON CORPORATION	14,430	49.74	717,748.20
FIRSTENERGY CORP	7,060	48.12	339,727.20

NEXTERA ENERGY INC	28,490	76.18	2,170,368.20
NRG ENERGY INC	3,690	39.74	146,640.60
PG&E CORP	23,500	12.37	290,695.00
PPL CORPORATION	11,000	30.37	334,070.00
SOUTHERN CO.	15,500	76.46	1,185,130.00
XCEL ENERGY INC	7,170	75.30	539,901.00
ATMOS ENERGY CORP	2,030	121.16	245,954.80
UGI CORP	3,120	37.35	116,532.00
AMEREN CORPORATION	3,670	97.81	358,962.70
CENTERPOINT ENERGY INC	9,400	32.26	303,244.00
CMS ENERGY CORP	4,320	72.84	314,668.80
CONSOLIDATED EDISON INC	5,280	98.19	518,443.20
DOMINION ENERGY INC	11,870	86.55	1,027,348.50
DTE ENERGY COMPANY	2,800	138.28	387,184.00
NISOURCE INC	5,800	31.39	182,062.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	7,340	74.67	548,077.80
SEMPRA ENERGY	4,700	170.43	801,021.00
WEC ENERGY GROUP INC	4,590	105.76	485,438.40
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,640	165.31	436,418.40
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,320	49.22	163,410.40
ALLY FINANCIAL INC	5,440	43.11	234,518.40
AMERICAN EXPRESS CO	9,590	185.74	1,781,246.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,260	139.98	876,274.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,420	116.53	515,062.60
SOFI TECHNOLOGIES INC	7,400	6.60	48,840.00
SYNCHRONY FINANCIAL	8,240	39.80	327,952.00
UPSTART HOLDINGS INC	610	75.30	45,933.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,630	291.71	475,487.30
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	10,470	46.15	483,190.50
BLACKROCK INC	2,213	681.46	1,508,070.98
BLACKSTONE INC	10,050	112.62	1,131,831.00
CARLYLE GROUP INC/THE	2,100	41.46	87,066.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,540	115.00	177,100.00
CME GROUP INC	5,250	228.37	1,198,942.50
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	540	137.32	74,152.80

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	540	438.41	236,741.40
FRANKLIN RESOURCES INC	4,200	26.48	111,216.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	700	31.04	21,728.00
GOLDMAN SACHS GROUP	4,920	334.30	1,644,756.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	8,250	120.71	995,857.50
INVESCO LTD	4,600	21.30	97,980.00
KKR & CO INC-A	6,930	53.87	373,319.10
MARKETAXESS HOLDINGS INC	610	272.88	166,456.80
MOODYS CORP	2,460	329.92	811,603.20
MORGAN STANLEY	19,610	88.91	1,743,525.10
MSCI INC	1,101	474.78	522,732.78
NASDAQ INC	1,760	169.44	298,214.40
NORTHERN TRUST CORP	2,550	110.34	281,367.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,700	109.76	296,352.00
ROBINHOOD MARKETS INC -A	2,600	10.44	27,144.00
S&P GLOBAL INC	5,149	390.83	2,012,383.67
SCHWAB(CHARLES)CORP	21,110	73.27	1,546,729.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,860	57.04	106,094.40
STATE STREET CORP	5,310	74.58	396,019.80
T ROWE PRICE GROUP INC	3,280	139.58	457,822.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,550	81.33	126,061.50
AES CORP	9,700	23.01	223,197.00
VISTRA CORP	7,200	25.74	185,328.00
CERNER CORP	4,260	93.34	397,628.40
TELADOC HEALTH INC	1,910	59.05	112,785.50
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,820	185.98	338,483.60
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,080	55.71	60,166.80
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,030	125.29	504,918.70
AVANTOR INC	8,300	31.32	259,956.00
BIO TECHNE CORP	548	412.09	225,825.32
BIO-RAD LABORATORIES-A	310	545.24	169,024.40
CHARLES RIVER LABORATORIES	710	292.00	207,320.00
DANAHER CORP	9,330	278.24	2,595,979.20
ILLUMINA INC	2,190	335.79	735,380.10
IQVIA HOLDINGS INC	2,770	236.17	654,190.90
	303	1,326.23	401,847.69

METTLER-TOLEDO INTL				
PERKINELMER INC	1,760	159.47	280,667.20	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,712	580.43	3,315,416.16	
WATERS CORP	900	307.38	276,642.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,102	365.14	402,384.28	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,950	89.90	175,305.00	
CLARIVATE PLC	4,700	16.32	76,704.00	
COSTAR GROUP INC	5,730	62.00	355,260.00	
EQUIFAX INC	1,740	202.95	353,133.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,890	148.16	280,022.40	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,880	109.78	206,386.40	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,690	115.17	194,637.30	
TRUNSION	3,030	91.17	276,245.10	
VERISK ANALYTICS INC	2,240	215.45	482,608.00	
CBRE GROUP INC	4,870	86.54	421,449.80	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	18,400	4.72	86,848.00	
ZILLOW GROUP INC - A	860	41.79	35,939.40	
ZILLOW GROUP INC - C	2,340	43.42	101,602.80	
CABLE ONE INC	77	1,356.39	104,442.03	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,839	519.03	954,496.17	
COMCAST CORP-CL A	66,120	46.94	3,103,672.80	
DISH NETWORK CORP-A	3,500	31.32	109,620.00	
FOX CORP-CLASS A	4,980	38.93	193,871.40	
FOX CORP-CLASS B	1,900	35.88	68,172.00	
INTERPUBRIC GROUP	5,800	35.91	208,278.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-A	390	126.43	49,307.70	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	2,200	131.40	289,080.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	2,328	44.43	103,433.04	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	1,160	44.49	51,608.40	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	5,400	21.35	115,290.00	
OMNICOM GROUP	3,000	81.42	244,260.00	
PARAMOUNT GLOBAL	8,650	32.31	279,481.50	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	16,000	6.35	101,600.00	
WARNER BROS DISCOVERY INC	32,316	21.45	693,178.20	
ACTIVISION BLIZZARD INC	11,440	78.90	902,616.00	
	7,180	16.85	120,983.00	

	AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A				
	DISNEY (WALT) CO	26,350	121.66	3,205,741.00	
	ELECTRONIC ARTS	3,750	123.74	464,025.00	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,700	69.35	187,245.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,380	106.76	254,088.80	
	NETFLIX INC	6,440	218.22	1,405,336.80	
	ROKU INC	1,630	99.55	162,266.50	
	SEA LTD-ADR	4,750	91.22	433,295.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	1,680	131.53	220,970.40	
	ALPHABET INC-CL A	4,346	2,496.29	10,848,876.34	
	ALPHABET INC-CL C	4,132	2,498.75	10,324,835.00	
	IAC/INTERACTIVECORP	1,160	91.42	106,047.20	
	MATCH GROUP INC	4,060	77.66	315,299.60	
	META PLATFORMS INC	34,210	188.07	6,433,874.70	
	PINTEREST INC- CLASS A	7,920	20.23	160,221.60	
	SNAP INC-A	14,500	29.42	426,590.00	
	TWITTER INC	11,520	47.08	542,361.60	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	4,210	51.25	215,762.50	
	小計銘柄数：605			550,851,896.15	
				(70,867,096,439)	
	組入時価比率：71.6%			73.0%	
カナダドル	CAMECO CORP	6,000	35.57	213,420.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	17,230	83.09	1,431,640.70	
	CENOVUS ENERGY INC	16,800	21.91	368,088.00	
	ENBRIDGE INC	29,570	58.29	1,723,635.30	
	IMPERIAL OIL	3,700	62.41	230,917.00	
	KEYERA CORP	3,200	33.26	106,432.00	
	PARKLAND CORP	2,100	35.21	73,941.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,100	50.07	405,567.00	
	SUNCOR ENERGY INC	19,600	41.89	821,044.00	
	TC ENERGY CORP	14,420	73.15	1,054,823.00	
	TOURMALINE OIL CORP	4,700	63.42	298,074.00	
	NUTRIEN LTD	8,390	135.78	1,139,194.20	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	2,260	57.04	128,910.40	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	6,504	77.65	505,035.60	

BARRICK GOLD	23,800	30.44	724,472.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	8,600	39.32	338,152.00	
FRANCO-NEVADA CORP	2,760	204.39	564,116.40	
IVANHOE MINES LTD-CL A	9,400	11.42	107,348.00	
KINROSS GOLD CORP	18,000	7.17	129,060.00	
LUNDIN MINING CORP	9,600	12.99	124,704.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	3,200	34.37	109,984.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,000	50.41	352,870.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,571	61.77	405,890.67	
WEST FRASER TIMBER	1,460	110.29	161,023.40	
CAE INC	4,300	33.38	143,534.00	
WSP GLOBAL INC	1,760	163.20	287,232.00	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,700	11.57	31,239.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,200	123.32	147,984.00	
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	2,300	41.77	96,071.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	1,660	71.27	118,308.20	
AIR CANADA	2,000	24.66	49,320.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	10,330	160.23	1,655,175.90	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,620	97.56	1,328,767.20	
TFI INTERNATIONAL INC	1,270	108.50	137,795.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,190	80.29	336,415.10	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,700	45.43	122,661.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	4,080	76.13	310,610.40	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	820	191.22	156,800.40	
DOLLARAMA INC	4,030	75.50	304,265.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	12,550	57.32	719,366.00	
EMPIRE CO LTD A	2,100	42.99	90,279.00	
LOBLAW COMPANIES	2,520	116.35	293,202.00	
METRO INC	3,550	70.27	249,458.50	
WESTON(GEORGE)LTD	1,170	157.47	184,239.90	
SAPUTO INC	3,100	30.71	95,201.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	4,600	27.94	128,524.00	
CANOPY GROWTH CORP	2,800	7.21	20,188.00	
BANK OF MONTREAL	9,470	146.03	1,382,904.10	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	17,760	86.42	1,534,819.20	

CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	6,070	147.18	893,382.60	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,400	94.85	417,340.00	
ROYAL BANK OF CANADA	20,710	138.57	2,869,784.70	
TORONTO DOMINION BANK	26,500	94.67	2,508,755.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	371	699.49	259,510.79	
GREAT-WEST LIFE CO INC	3,800	37.05	140,790.00	
IA FINANCIAL CORP INC	1,500	74.70	112,050.00	
INTACT FINANCIAL CORP	2,290	182.66	418,291.40	
MANULIFE FINANCIAL CORP	25,900	26.73	692,307.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	8,200	39.09	320,538.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	8,510	67.97	578,424.70	
CGI INC	3,450	103.78	358,041.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	850	77.96	66,266.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,664	604.58	1,006,021.12	
BLACKBERRY LTD	7,400	7.75	57,350.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	292	2,129.85	621,916.20	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,470	28.58	42,012.60	
OPEN TEXT CORP	3,700	52.94	195,878.00	
BCE INC	1,020	73.13	74,592.60	
TELUS CORP	5,200	33.71	175,292.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	5,590	74.73	417,740.70	
EMERA INC	3,540	64.40	227,976.00	
FORTIS INC	7,360	63.98	470,892.80	
HYDRO ONE LTD	4,300	35.38	152,134.00	
ALTAGAS LTD	3,600	30.04	108,144.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	10,300	19.66	202,498.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	2,000	39.42	78,840.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	20,650	68.43	1,413,079.50	
IGM FINANCIAL INC	1,400	43.02	60,228.00	
ONEX CORPORATION	1,200	80.13	96,156.00	
TMX GROUP LTD	730	127.24	92,885.20	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	1,800	47.27	85,086.00	
NORTHLAND POWER INC	3,240	40.25	130,410.00	
THOMSON REUTERS CORP	2,550	131.75	335,962.50	
	580	169.86	98,518.80	

	小計	FIRSTSERVICE CORP				
		QUEBECOR INC-CL B	2,500	32.46	81,150.00	
		SHAW COMMUNICATIONS INC-B	7,300	38.77	283,021.00	
		銘柄数：86			37,585,968.78 (3,839,782,570)	
		組入時価比率：3.9%			4.0%	
ユーロ		TENARIS SA	7,000	14.99	104,930.00	
		ENI SPA	37,500	14.00	525,000.00	
		GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	6,600	11.65	76,890.00	
		NESTE OYJ	6,000	44.51	267,060.00	
		OMV AG	2,080	46.66	97,052.80	
		REPSOL SA	20,900	13.67	285,807.50	
		TOTALENERGIES SE	36,520	47.15	1,721,918.00	
		AIR LIQUIDE SA	6,930	162.66	1,127,233.80	
		AKZO NOBEL	2,790	83.88	234,025.20	
		ARKEMA	820	113.25	92,865.00	
		BASF SE	13,540	53.62	726,014.80	
		COVESTRO AG	2,710	46.37	125,662.70	
		EVONIK INDUSTRIES AG	2,700	25.80	69,660.00	
		FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,190	31.72	37,746.80	
		KONINKLIJKE DSM NV	2,530	157.30	397,969.00	
		LANXESS	1,270	39.22	49,809.40	
		SOLVAY SA	1,010	91.94	92,859.40	
		SYMRISE AG	2,050	109.35	224,167.50	
		UMICORE	2,710	37.78	102,383.80	
		CRH PLC	11,560	39.20	453,209.80	
		HEIDELBERGCEMENT AG	2,190	53.50	117,165.00	
		SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,570	40.32	143,942.40	
		ARCELORMITTAL	10,000	30.77	307,750.00	
		VOESTALPINE AG	1,680	25.68	43,142.40	
		STORA ENSO OYJ-R	8,600	19.42	167,055.00	
		UPM-KYMMENE OYJ	7,800	32.61	254,358.00	
		AIRBUS SE	8,650	108.52	938,698.00	
		DASSAULT AVIATION SA	260	158.90	41,314.00	
		MTU AERO ENGINES AG	780	199.25	155,415.00	
		SAFRAN SA	4,560	109.46	499,137.60	

THALES SA	1,580	125.20	197,816.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	7,350	54.87	403,294.50
KINGSPAN GROUP PLC	2,170	90.88	197,209.60
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,672	24.97	91,689.84
BOUYGUES	3,100	32.29	100,099.00
EIFPAGE SA	1,250	96.98	121,225.00
FERROVIAL SA	6,934	25.56	177,233.04
VINCI	7,940	94.65	751,521.00
LEGRAND SA	3,890	86.88	337,963.20
PRYSMIAN SPA	3,700	30.76	113,812.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,900	147.34	1,163,986.00
SIEMENS ENERGY AG	5,900	19.15	112,985.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	3,000	15.70	47,100.00
SIEMENS AG	11,160	123.00	1,372,680.00
ALSTOM	4,590	22.00	100,980.00
CNH INDUSTRIAL NV	15,100	14.70	221,970.00
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	6,105	25.97	158,577.37
GEA GROUP AG	2,180	38.81	84,605.80
KION GROUP AG	1,100	59.06	64,966.00
KNORR-BREMSE AG	1,030	71.32	73,459.60
KONE OYJ	5,310	46.91	249,092.10
RATIONAL AG	73	640.50	46,756.50
WARTSILA OYJ	6,600	8.62	56,905.20
BRENNTAG SE	2,180	76.10	165,898.00
IMCD NV	850	154.75	131,537.50
DEUTSCHE POST AG-REG	14,660	42.39	621,437.40
INPOST SA	2,800	6.02	16,878.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,000	7.49	67,419.00
ADP	460	144.75	66,585.00
AENA SME SA	1,120	150.95	169,064.00
ATLANTIA SPA	6,900	22.79	157,251.00
GETLINK	6,100	17.69	107,909.00
CONTINENTAL AG	1,610	68.18	109,769.80
FAURECIA	1,661	24.02	39,897.22
MICHELIN (CGDE)	2,450	121.45	297,552.50

VALEO SA	3,300	17.85	58,905.00
BAYER MOTOREN WERK	4,350	80.08	348,348.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	760	70.60	53,656.00
FERRARI NV	1,830	204.20	373,686.00
MERCEDES-BENZ GROUP AG	12,580	65.85	828,393.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	2,150	83.90	180,385.00
RENAULT SA	2,700	23.52	63,517.50
STELLANTIS NV	27,000	13.55	365,850.00
VOLKSWAGEN AG	463	221.60	102,600.80
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,450	156.74	384,013.00
SEB SA	440	124.70	54,868.00
ADIDAS AG	2,820	207.45	585,009.00
ESSILORLUXOTTICA	3,880	171.70	666,196.00
HERMES INTERNATIONAL	425	1,254.50	533,162.50
KERING SA	1,008	553.10	557,524.80
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	4,029	653.40	2,632,548.60
MONCLER SPA	2,990	51.16	152,968.40
PUMA SE	1,510	77.80	117,478.00
ACCOR SA	2,250	31.69	71,302.50
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,420	100.55	243,331.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	1,200	36.84	44,208.00
SODEXO	1,380	73.58	101,540.40
DELIVERY HERO SE	2,320	34.18	79,297.60
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	2,510	25.62	64,306.20
PROSUS NV	13,770	43.17	594,519.75
ZALANDO SE	3,160	42.33	133,762.80
INDITEX SA	14,200	21.09	299,478.00
CARREFOUR SUPERMARCHÉ	8,700	19.77	171,999.00
COLRUYT SA	680	35.01	23,806.80
HELLOFRESH SE	2,380	38.93	92,653.40
JERONIMO MARTINS	4,500	20.22	90,990.00
KESKO OYJ-B SHS	3,900	24.50	95,550.00
KONINKLIJKE Ahold DELHAIZE NV	15,600	28.17	439,452.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	12,810	57.52	736,831.20
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	7,800	10.78	84,084.00

HEINEKEN HOLDING NV	1,580	75.95	120,001.00
HEINEKEN NV	3,740	94.82	354,626.80
PERNOD RICARD SA	2,810	195.35	548,933.50
REMY COINTREAU	280	189.40	53,032.00
DANONE	9,980	55.34	552,293.20
JDE PEET'S BV	1,700	27.52	46,784.00
KERRY GROUP PLC-A	2,010	102.00	205,020.00
HENKEL AG & CO KGAA	1,480	60.45	89,466.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,480	60.72	150,585.60
BEIERSDORF AG	1,430	95.62	136,736.60
LOREAL-ORD	3,661	360.95	1,321,437.95
BIOMERIEUX	610	93.68	57,144.80
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	560	135.25	75,740.00
DIASORIN SPA	330	130.10	42,933.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,000	28.37	340,500.00
SARTORIUS AG-VORZUG	370	395.50	146,335.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,050	57.30	232,065.00
AMPLIFON SPA	1,800	39.53	71,154.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	2,990	63.56	190,044.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	6,620	35.00	231,700.00
ORPEA	670	35.12	23,530.40
ARGENX SE	660	295.80	195,228.00
GRIFOLS SA	4,200	16.66	69,972.00
BAYER AG-REG	14,400	66.30	954,720.00
IPSEN	520	111.70	58,084.00
MERCK KGAA	1,880	181.85	341,878.00
ORION OYJ	1,300	40.66	52,858.00
RECORDATI SPA	1,620	47.88	77,565.60
SANOFI	16,550	103.24	1,708,622.00
UCB SA	1,870	111.75	208,972.50
ABN AMRO BANK NV-CVA	6,100	12.64	77,104.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	99,200	5.15	511,078.40
BANCO SANTANDER SA	255,000	3.23	823,650.00
BNP PARIBAS	16,540	52.40	866,696.00
CAIXABANK	71,000	3.13	222,301.00

COMMERZBANK AG	14,500	6.89	99,934.00
CREDIT AGRICOLE SA	17,600	10.51	185,116.80
ERSTE GROUP BANK AG	5,400	32.76	176,904.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	8,400	14.10	118,440.00
ING GROEP NV	57,900	9.85	570,604.50
INTESA SANPAOLO	246,000	2.02	498,150.00
KBC GROEP NV	3,160	66.72	210,835.20
MEDIOBANCA S.P.A.	8,700	9.57	83,311.20
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1,900	11.61	22,059.00
SOCIETE GENERALE	12,000	24.30	291,660.00
UNICREDIT SPA	27,400	9.46	259,231.40
EURAZEO SE	620	79.40	49,228.00
EXOR NV	1,500	70.78	106,170.00
GROUPE BRUXELLES LAM	1,600	95.38	152,608.00
SOFINA SA	220	320.20	70,444.00
WENDEL	420	96.90	40,698.00
AEGON NV	25,000	5.33	133,350.00
AGEAS	2,600	48.78	126,828.00
ALLIANZ SE-REG	5,960	222.40	1,325,504.00
ASSICURAZIONI GENERALI	16,100	18.67	300,587.00
AXA SA	28,700	27.09	777,483.00
CNP ASSURANCES	2,440	21.80	53,192.00
HANNOVER RUECK SE	860	150.45	129,387.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,860	243.50	452,910.00
NN GROUP NV	4,000	48.51	194,040.00
POSTE ITALIANE SPA	7,400	9.87	73,082.40
SAMPO OYJ-A SHS	6,470	48.01	310,624.70
ADYEN NV	265	1,728.00	457,920.00
AMADEUS IT GROUP SA	6,500	60.20	391,300.00
BECHTLE AG	1,200	45.18	54,216.00
CAPGEMINI SA	2,330	195.20	454,816.00
EDENRED	4,080	49.07	200,205.60
NEXI SPA	7,200	9.17	66,067.20
WORLDLINE SA	3,370	35.75	120,477.50
DASSAULT SYSTEMES SE	8,790	40.84	359,027.55

NEMETSCHEK SE	890	81.96	72,944.40
SAP SE	15,210	99.56	1,514,307.60
NOKIA OYJ	80,700	4.98	402,168.45
ASM INTERNATIONAL NV	698	321.15	224,162.70
ASML HOLDING NV	5,990	584.00	3,498,160.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	17,500	28.54	499,450.00
STMICROELECTRONICS NV	9,930	35.97	357,231.75
CELLNEX TELECOM SA	6,620	45.58	301,739.60
DEUTSCHE TELEKOM-REG	47,600	17.48	832,048.00
ELISA OYJ	2,200	54.32	119,504.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	5,000	10.31	51,575.00
KONINKLIJKE KPN NV	50,600	3.31	167,536.60
ORANGE SA	28,900	11.08	320,327.60
PROXIMUS	2,400	17.34	41,616.00
TELECOM ITALIA SPA	157,000	0.30	47,115.70
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	15,000	2.83	42,585.00
TELEFONICA SA	75,875	4.83	367,159.12
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,500	31.03	46,545.00
ELECTRICITE DE FRANCE	7,384	8.77	64,787.21
ELIA GROUP SA/NV	510	149.20	76,092.00
ENDESA S.A.	4,600	19.86	91,356.00
ENEL SPA	119,700	6.11	731,367.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	43,200	4.62	199,756.80
FORTUM OYJ	6,600	16.33	107,778.00
IBERDROLA SA	85,400	10.52	898,408.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	6,600	18.47	121,902.00
TERNA SPA	21,200	7.85	166,420.00
VERBUND AG	1,060	95.10	100,806.00
ENAGAS SA	3,700	20.51	75,887.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,100	28.94	89,714.00
SNAM SPA	27,792	5.23	145,574.49
E.ON SE	32,400	10.20	330,480.00
ENGIE	26,400	12.16	321,129.60
RWE AG	9,310	40.14	373,703.40
VEOLIA ENVIRONNEMENT	9,598	29.06	278,917.88

	AMUNDI SA	910	61.65	56,101.50	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	30,100	11.36	341,996.20	
	DEUTSCHE BOERSE AG	2,840	163.55	464,482.00	
	EURONEXT NV	1,300	80.06	104,078.00	
	EDP RENOVAVEIS SA	3,900	22.77	88,803.00	
	UNIPER SE	1,300	24.20	31,460.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,880	89.80	168,824.00	
	QIAGEN N.V.	3,460	43.10	149,126.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	391	344.90	134,855.90	
	BUREAU VERITAS SA	4,200	25.80	108,360.00	
	RANDSTAD NV	1,710	54.02	92,374.20	
	TELEPERFORMANCE	853	345.00	294,285.00	
	WOLTERS KLUWER	3,440	97.22	334,436.80	
	AROUNDTOWN SA	14,500	5.14	74,530.00	
	LEG IMMOBILIEN SE	980	100.05	98,049.00	
	VONOVIA SE	9,780	39.83	389,537.40	
	PUBLICIS GROUPE	3,630	58.66	212,935.80	
	VIVENDI SE	11,900	11.77	140,063.00	
	BOLLORE SE	13,000	4.65	60,450.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	1,180	34.56	40,780.80	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	11,600	24.12	279,792.00	
	SCOUT24 SE	1,320	57.86	76,375.20	
	小計銘柄数：227			66,000,747.22	
				(9,198,524,140)	
	組入時価比率：9.3%			9.5%	
英ポンド	BP PLC	288,100	4.03	1,161,475.15	
	SHELL PLC-NEW	111,700	22.22	2,481,974.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,080	76.78	159,702.40	
	JOHNSON MATTHEY PLC	2,600	19.18	49,868.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	18,760	36.79	690,180.40	
	ANTOFAGASTA PLC	5,400	15.20	82,080.00	
	GLENCORE PLC	145,400	4.89	712,023.80	
	RIO TINTO PLC-REG	16,410	57.45	942,754.50	
	MONDI PLC	7,200	15.06	108,468.00	
	BAE SYSTEMS PLC	41,700	7.41	309,080.40	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	124,000	0.96	119,784.00	
DCC PLC	1,370	60.00	82,200.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	59,400	1.28	76,418.10	
SMITHS GROUP PLC	5,700	14.82	84,502.50	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,040	127.20	132,288.00	
ASHTED GROUP PLC	6,510	48.17	313,586.70	
BUNZLE	4,700	31.63	148,661.00	
FERGUSON PLC	2,900	107.90	312,910.00	
RENTOKIL INTIAL PLC	26,200	5.24	137,288.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	14,500	5.26	76,270.00	
PERSIMMON PLC	4,690	22.47	105,384.30	
TAYLOR WIMPEY PLC	55,000	1.34	73,975.00	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	1,662	40.74	67,709.88	
BURBERRY GROUP PLC	6,000	16.71	100,290.00	
COMPASS GROUP PLC	23,800	17.49	416,262.00	
ENTAIN PLC	8,600	15.38	132,311.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,680	53.06	142,200.80	
WHITBREAD PLC	2,900	29.96	86,884.00	
NEXT PLC	2,000	63.58	127,160.00	
JD SPORTS FASHION PLC	38,000	1.47	55,955.00	
KINGFISHER PLC	30,100	2.68	80,818.50	
OCADO GROUP PLC	7,200	10.90	78,480.00	
SAINSBURY	25,000	2.42	60,650.00	
TESCO PLC	113,000	2.65	299,563.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	2,800	16.53	46,284.00	
DIAGEO PLC	33,940	39.21	1,330,787.40	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,900	16.56	81,168.50	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	31,830	33.44	1,064,554.35	
IMPERIAL BRANDS PLC	14,100	16.85	237,585.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	10,510	61.68	648,256.80	
UNILEVER PLC	37,400	35.15	1,314,610.00	
SMITH & NEPHEW PLC	12,200	13.02	158,905.00	
NMC HEALTH PLC	800	0.00	3.20	
ASTRAZENECA PLC	22,470	105.04	2,360,248.80	
GLAXOSMITHKLINE PLC	73,300	17.44	1,278,938.40	

HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	2,800	20.50	57,400.00
BARCLAYS PLC	221,000	1.50	331,632.60
HSBC HOLDINGS PLC	295,900	5.36	1,588,687.10
LLOYDS BANKING GROUP PLC	951,000	0.46	446,256.75
NATWEST GROUP PLC	83,000	2.26	187,912.00
STANDARD CHARTERED PLC	41,300	5.24	216,494.60
M&G PLC	39,000	2.17	84,747.00
ADMIRAL GROUP PLC	2,850	25.34	72,219.00
AVIVA PLC	54,600	4.44	242,424.00
LEGAL & GENERAL	93,000	2.65	246,636.00
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	10,400	6.26	65,124.80
PRUDENTIAL PLC	41,000	10.71	439,315.00
AVEVA GROUP PLC	1,582	25.21	39,882.22
SAGE GROUP PLC (THE)	13,900	7.27	101,080.80
HALMA PLC	5,350	25.21	134,873.50
BT GROUP PLC	133,000	1.88	250,505.50
VODAFONE GROUP PLC	366,000	1.28	470,310.00
SSE PLC	15,300	18.14	277,542.00
NATIONAL GRID PLC	53,200	11.62	618,450.00
SEVERN TRENT PLC	3,400	30.21	102,714.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	9,400	11.21	105,374.00
3I GROUP PLC	14,300	13.73	196,410.50
ABRDN PLC	34,000	2.00	68,000.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	4,600	9.86	45,365.20
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	4,770	80.10	382,077.00
SCHRODERS PLC	1,990	31.62	62,923.80
ST JAMES S PLACE PLC	7,700	13.68	105,336.00
EXPERIAN PLC	12,240	27.84	340,761.60
INTERTEK GROUP PLC	2,190	50.62	110,857.80
RELX PLC	28,400	23.99	681,316.00
INFORMA PLC	21,300	5.99	127,714.80
PEARSON	10,800	7.89	85,212.00
WPP PLC	16,600	10.25	170,233.00
AUTO TRADER GROUP PLC	14,800	6.36	94,216.80
小計 銘柄数：79			27,080,505.25

				(4,535,713,824)	
	組入時価比率：4.6%			4.7%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	3,200	16.11	51,552.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	91	878.50	79,943.50	
	GIVAUDAN-REG	123	3,857.00	474,411.00	
	SIKA AG-REG	1,900	315.40	599,260.00	
	HOLCIM LTD	7,550	45.85	346,167.50	
	GEBERIT AG-REG	513	554.40	284,407.20	
	ABB LTD	24,200	31.55	763,510.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	290	192.20	55,738.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	550	192.35	105,792.50	
	VAT GROUP AG	401	332.80	133,452.80	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	870	277.40	241,338.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	7,660	120.50	923,030.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	410	264.50	108,445.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	550	50.55	27,802.50	
	BARRY CALLEBAUT AG	52	2,262.00	117,624.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	16	10,960.00	175,360.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	2	113,000.00	226,000.00	
	NESTLE SA-REG	40,740	122.68	4,997,983.20	
	ALCON INC	6,670	77.00	513,590.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	691	374.70	258,917.70	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,450	131.50	190,675.00	
	NOVARTIS AG-REG	31,790	86.24	2,741,569.60	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	10,175	366.30	3,727,102.50	
	ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	480	393.80	189,024.00	
	VIFOR PHARMA AG/NEW	620	169.35	104,997.00	
	BALOISE HOLDING AG	780	176.00	137,280.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	446	624.80	278,660.80	
	SWISS RE LTD	4,390	83.94	368,496.60	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,204	452.80	997,971.20	
	TEMENOS AG-REG	960	93.20	89,472.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,400	67.70	162,480.00	
	SWISSCOM AG-REG	365	559.80	204,327.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	38,700	7.13	276,163.20	

小計	JULIUS BAER GROUP LTD	3,300	48.95	161,535.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	329	1,161.00	381,969.00	
	UBS GROUP AG	51,600	16.96	875,394.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	99	468.00	46,332.00	
	LONZA AG-REG	1,096	629.20	689,603.20	
	ADECCO GROUP AG-REG	2,210	39.70	87,737.00	
	SGS SA-REG	85	2,503.00	212,755.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,060	94.30	99,958.00	
	銘柄数：41			22,507,827.00	
	組入時価比率：3.1%			(3,033,604,923)	3.1%
スウェーデン ローナ	LUNDIN ENERGY AB	3,100	429.10	1,330,210.00	
	BOLIDEN AB	3,880	482.20	1,870,936.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	8,300	195.90	1,625,970.00	
	ASSA ABLOY AB-B	15,000	259.20	3,888,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	20,500	104.80	2,148,400.00	
	SKANSKA AB-B SHS	4,700	202.40	951,280.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	2,400	283.20	679,680.00	
	LIFCO AB-B SHS	3,600	220.10	792,360.00	
	ALFA LAVAL AB	5,200	328.00	1,705,600.00	
	ATLAS COPCO AB-A	9,710	491.50	4,772,465.00	
	ATLAS COPCO AB-B	5,720	427.10	2,443,012.00	
	EPIROC AB - A	9,300	211.80	1,969,740.00	
	EPIROC AB - B	5,900	177.00	1,044,300.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	5,700	96.44	549,708.00	
	SANDVIK AB	17,100	208.00	3,556,800.00	
	SKF AB-B SHARES	5,400	164.70	889,380.00	
	VOLVO AB-A SHS	2,800	169.20	473,760.00	
	VOLVO AB-B SHS	18,700	164.18	3,070,166.00	
	SECURITAS AB-B SHS	4,300	118.85	511,055.00	
	ELECTROLUX AB-B	3,300	157.40	519,420.00	
	EVOLUTION AB	2,180	924.70	2,015,846.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	11,700	130.46	1,526,382.00	
	SWEDISH MATCH AB	22,830	78.00	1,780,740.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,900	231.40	2,059,460.00	

	GETINGE AB-B SHS	3,460	350.40	1,212,384.00	
	NORDEA BANK ABP	47,800	102.04	4,877,512.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	20,600	111.40	2,294,840.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	21,500	94.34	2,028,310.00	
	SWEDBANK AB	13,300	160.00	2,128,000.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,930	270.80	522,644.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,000	265.10	530,200.00	
	INVESTOR AB-A SHS	7,500	221.60	1,662,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	27,000	205.30	5,543,100.00	
	KINNEVIK AB - B	3,430	203.90	699,377.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	1,100	472.20	519,420.00	
	SINCH AB	7,400	56.96	421,504.00	
	ERICSSON LM-B	43,800	82.03	3,592,914.00	
	HEXAGON AB-B SHS	28,700	132.25	3,795,575.00	
	TELIA CO AB	31,200	38.58	1,203,696.00	
	TELE 2 AB-B SHS	7,300	145.20	1,059,960.00	
	EQT AB	3,980	344.90	1,372,702.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,400	528.80	740,320.00	
	SAGAX AB-B	2,500	258.10	645,250.00	
	EMBRACER GROUP AB	7,200	68.27	491,544.00	
小計	銘柄数：44			77,515,922.00	
				(1,046,464,947)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	1,800	360.00	648,000.00	
	EQUINOR ASA	14,530	335.00	4,867,550.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,420	492.90	1,192,818.00	
	NORSK HYDRO	18,700	89.22	1,668,414.00	
	MOWI ASA	6,200	256.20	1,588,440.00	
	ORKLA ASA	11,600	75.18	872,088.00	
	DNB BANK ASA	14,100	200.30	2,824,230.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,900	215.40	624,660.00	
	TELENOR ASA	9,900	132.00	1,306,800.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	1,560	178.90	279,084.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	900	198.20	178,380.00	
	ADEVINTA ASA	3,500	70.15	245,525.00	

小計	銘柄数：12			16,295,989.00	
	組入時価比率：0.2%			(235,477,041)	0.2%
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,460	540.80	789,568.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,310	460.50	1,524,255.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	130	2,094.00	272,220.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,100	201.40	3,041,140.00	
	DSV A/S	3,030	1,157.00	3,505,710.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	45	19,140.00	861,300.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	84	19,640.00	1,649,760.00	
	PANDORA A/S	1,410	676.00	953,160.00	
	CARLSBERG B	1,460	899.80	1,313,708.00	
	AMBU A/S-B	2,300	112.05	257,715.00	
	COLOPLAST-B	1,500	1,028.00	1,542,000.00	
	DEMANT A/S	1,360	308.60	419,696.00	
	GN STORE NORD A/S	1,750	284.90	498,575.00	
	GENMAB A/S	955	2,587.00	2,470,585.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	24,430	770.90	18,833,087.00	
	DANSKE BANK AS	10,500	119.85	1,258,425.00	
	TRYG A/S	5,000	171.45	857,250.00	
	ORSTED A/S	2,760	812.70	2,243,052.00	
小計	銘柄数：18			42,291,206.00	
	組入時価比率：0.8%			(792,114,288)	0.8%
豪ドル	AMPOL LTD	3,200	32.99	105,568.00	
	SANTOS LTD.	51,000	8.37	426,870.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3,400	28.14	95,676.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	14,500	32.97	478,065.00	
	ORICA LTD	4,800	16.60	79,680.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	7,100	41.04	291,384.00	
	BHP GROUP LIMITED	73,460	50.70	3,724,422.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	7,900	22.25	175,775.00	
	EVOLUTION MINING LTD	24,000	4.34	104,160.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	22,000	21.48	472,560.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	2,500	62.05	155,125.00	

NEWCREST MINING	11,400	28.80	328,320.00	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	15,000	11.22	168,300.00	
RIO TINTO LTD	5,410	116.36	629,507.60	
SOUTH32 LTD	59,000	5.09	300,310.00	
REECE LTD	4,600	17.35	79,810.00	
BRAMBLES LTD	21,000	10.82	227,220.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	15,100	5.64	85,164.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	27,000	3.92	105,840.00	
TRANSURBAN GROUP	40,400	13.95	563,580.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	8,900	33.16	295,124.00	
CROWN RESORTS LTD	4,800	12.84	61,632.00	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	920	80.34	73,912.80	
TABCORP HOLDINGS	29,000	5.42	157,180.00	
WESFARMERS LIMITED	16,800	49.35	829,080.00	
COLES GROUP LTD	18,700	18.68	349,316.00	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	17,500	7.61	133,175.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	16,000	39.47	631,520.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	11,400	11.19	127,566.00	
COCHLEAR LTD	910	236.16	214,905.60	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	82.99	228,222.50	
SONIC HEALTHCARE LTD	6,400	37.15	237,760.00	
CSL LIMITED	6,990	266.98	1,866,190.20	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	41,400	28.00	1,159,200.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	24,820	108.35	2,689,247.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	47,900	33.60	1,609,440.00	
WESTPAC BANKING CORP	53,800	24.51	1,318,638.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	34,000	4.46	151,640.00	
MEDIBANK PRIVATE LTD	40,000	3.22	128,800.00	
QBE INSURANCE	23,900	12.24	292,536.00	
SUNCORP GROUP LTD	18,200	11.33	206,206.00	
COMPUTERSHARE LTD	7,350	25.66	188,601.00	
WISETECH GLOBAL LTD	2,200	46.08	101,376.00	
XERO LIMITED	1,930	99.30	191,649.00	
TELSTRA CORP LTD	57,000	4.04	230,280.00	
ORIGIN ENERGY LTD	27,000	6.78	183,060.00	

	小計	APA GROUP	17,700	11.47	203,019.00	
		ASX LTD	2,880	83.63	240,854.40	
		MACQUARIE GROUP LIMITED	4,990	210.95	1,052,640.50	
		IDP EDUCATION LTD	3,300	28.15	92,895.00	
		REA GROUP LTD	770	125.50	96,635.00	
		SEEK LTD	4,900	27.89	136,661.00	
		銘柄数：52			24,076,298.60	
					(2,278,099,373)	
		組入時価比率：2.3%			2.3%	
	ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	17,700	7.90	139,830.00	
		FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	9,300	22.60	210,180.00	
		RYMAN HEALTHCARE LTD	6,100	8.95	54,595.00	
		SPARK NEW ZEALAND LTD	27,000	4.93	133,110.00	
		MERCURY NZ LTD	10,700	5.95	63,665.00	
		MERIDIAN ENERGY LTD	17,100	4.90	83,790.00	
		銘柄数：6			685,170.00	
					(59,198,688)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
	香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	26,000	16.94	440,440.00	
		CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	39,416	57.90	2,282,186.40	
		TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	17,500	114.80	2,009,000.00	
		SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	21,000	25.90	543,900.00	
		MTR CORP	21,000	42.50	892,500.00	
		GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	26,000	45.75	1,189,500.00	
		SANDS CHINA LTD	33,200	17.72	588,304.00	
		CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	32,000	12.98	415,360.00	
		BUDWEISER BREWING CO APAC LT	25,000	20.40	510,000.00	
		WH GROUP LIMITED	131,524	5.44	715,490.56	
		BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	52,000	29.90	1,554,800.00	
		HANG SENG BANK	11,400	154.00	1,755,600.00	
		AIA GROUP LTD	176,000	79.30	13,956,800.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	52,120	10.90	568,108.00	
		CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	8,000	54.30	434,400.00	

	CLP HLDGS	20,500	77.25	1,583,625.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	21,000	52.90	1,110,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	157,983	9.00	1,421,847.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	17,700	322.80	5,713,560.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	29,916	54.70	1,636,405.20	
	ESR CAYMAN LTD	30,000	24.55	736,500.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	16.52	446,040.00	
	HENDERSON LAND	21,845	33.30	727,438.50	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	22,333	31.20	696,789.60	
	SINO LAND CO.LTD	47,000	10.68	501,960.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	20,000	94.60	1,892,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	7,500	44.75	335,625.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	17,000	20.00	340,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	28,200	38.35	1,081,470.00	
小計	銘柄数：29			46,080,549.26	
				(755,721,007)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	25,000	4.15	103,750.00	
	KEPPEL CORP.	19,000	6.65	126,350.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	20,100	5.52	110,952.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,000	0.81	66,015.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	28,000	4.59	128,520.00	
	DBS GROUP HLDGS	26,700	33.39	891,513.00	
	OCBC-ORD	49,350	12.08	596,148.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	15,400	31.15	479,710.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	17.16	70,356.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	116,000	2.66	308,560.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,300	9.90	111,870.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	41,000	4.02	164,820.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	5,400	8.43	45,522.00	
	UOL GROUP LIMITED	5,700	7.13	40,641.00	
小計	銘柄数：14			3,244,727.00	
				(305,685,730)	

		組入時価比率：0.3%			0.3%	
新シェケル	ICL GROUP LTD		7,900	40.65	321,135.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD		350	714.70	250,145.00	
	BANK HAPOLIM BM		16,800	31.51	529,368.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL		20,800	35.70	742,560.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A		15,700	19.92	312,744.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		2,100	124.30	261,030.00	
	NICE LTD		940	688.40	647,096.00	
	AZRIELI GROUP		600	294.50	176,700.00	
	小計 銘柄数：8				3,240,778.00	
		組入時価比率：0.1%			(128,291,706)	
					0.1%	
合計					97,075,774,676	
					(97,075,774,676)	

(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(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	7,900	93,773.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,160	431,265.60	
		AMERICAN TOWER CORP	6,630	1,768,552.50	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	19,800	132,066.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,850	473,618.50	
		BOSTON PROPERTIES	2,170	275,872.10	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,450	247,413.50	
		CROWN CASTLE INTL CORP	6,320	1,241,248.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,230	635,938.20	
		DUKE REALTY CORP	5,400	329,454.00	
		EQUINIX INC	1,320	1,000,071.60	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,450	202,713.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	5,170	482,050.80	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,020	366,496.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,750	379,767.50	

小計	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,520	266,208.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	10,000	206,400.00	
	INVITATION HOMES INC	8,910	389,901.60	
	IRON MOUNTAIN INC	4,090	235,502.20	
	KIMCO REALTY CORP	9,900	257,004.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,600	174,838.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,740	369,680.40	
	PROLOGIS INC	10,760	1,837,592.80	
	PUBLIC STORAGE	2,316	955,512.12	
	REALTY INCOME CORP	8,440	629,286.40	
	REGENCY CENTERS CORP	2,160	156,621.60	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,620	599,659.20	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,400	575,740.00	
	SUN COMMUNITIES INC	1,650	314,473.50	
	UDR INC	4,340	258,013.00	
	VENTAS INC	5,760	345,715.20	
	VICI PROPERTIES INC	9,400	283,128.00	
	VORNADO REALTY TRUST	2,360	98,954.80	
	WELLTOWER INC	5,820	566,286.00	
	WEYERHAEUSER CO	10,900	454,857.00	
	WP CAREY INC	2,640	225,456.00	
	銘柄数：36	192,946	17,261,130.32	
			(2,220,644,415)	
	組入時価比率：2.2%		86.2%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,100	57,222.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,986	49,352.10	
小計	銘柄数：2	3,086	106,574.10	
			(10,887,610)	
	組入時価比率：0.0%		0.4%	
ユーロ	COVIVIO	780	57,954.00	
	GECINA SA	560	63,504.00	
小計	KLEPIERRE	3,000	70,950.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,890	135,324.00	
	銘柄数：4	6,230	327,732.00	
			(45,676,008)	
	組入時価比率：0.0%		1.8%	

英ポンド	BRITISH LAND	13,000	68,146.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	9,900	75,873.60	
	SEGRO PLC	17,800	245,106.00	
	小計	銘柄数：3	40,700	389,125.60
				(65,174,646)
	組入時価比率：0.1%			2.5%
豪ドル	DEXUS/AU	15,700	171,601.00	
	GOODMAN GROUP	24,300	567,891.00	
	GPT GROUP	26,000	133,640.00	
	LENDLEASE GROUP	9,800	118,188.00	
	MIRVAC GROUP	60,000	147,600.00	
	SCENTRE GROUP	77,000	234,850.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	33,000	138,600.00	
	VICINITY CENTRES	61,000	117,425.00	
	小計	銘柄数：8	306,800	1,629,795.00
				(154,211,202)
	組入時価比率：0.2%			6.0%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	30,000	231,900.00	
	LINK REIT	30,000	2,040,000.00	
小計	銘柄数：2	60,000	2,271,900.00	
				(37,259,160)
	組入時価比率：0.0%			1.4%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	53,006	154,247.46	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	71,304	163,999.20	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	34,000	64,600.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	47,710	86,832.20	
	小計	銘柄数：4	206,020	469,678.86
				(44,248,445)
	組入時価比率：0.0%			1.7%
合計			2,578,101,486	
				(2,578,101,486)

(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	2022年 4月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	5,135,013,335	—	5,042,689,279	△92,324,056
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	99,824,024,746	—	104,656,099,566	△4,832,074,820
米ドル	73,667,959,594	—	77,587,208,784	△3,919,249,190
カナダドル	3,829,724,622	—	4,003,415,499	△173,690,877
ユーロ	9,178,219,124	—	9,452,646,190	△274,427,066
英ポンド	4,464,126,763	—	4,658,661,293	△194,534,530
スイスフラン	3,009,605,661	—	3,067,036,700	△57,431,039
スウェーデンクローナ	1,018,309,626	—	1,057,185,000	△38,875,374
ノルウェークローネ	223,286,751	—	232,262,736	△8,975,985
デンマーククローネ	762,643,997	—	786,341,526	△23,697,529
豪ドル	2,352,363,385	—	2,432,381,964	△80,018,579
ニュージーランドドル	60,076,638	—	61,306,867	△1,230,229
香港ドル	785,940,975	—	825,611,912	△39,670,937
シンガポールドル	346,585,470	—	362,529,475	△15,944,005
新シェケル	125,182,140	—	129,511,620	△4,329,480
合計	—	—	—	△4,924,398,876

(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)	
(2022年 4月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	2,618,048,964
コール・ローン	108,588,007
株式	67,394,595,978
投資信託受益証券	2,860,610,583
投資証券	88,814,617
派生商品評価勘定	32,395,357
未収入金	22,152,737
未収配当金	146,937,604
差入委託証拠金	721,582,860
流動資産合計	73,993,726,707
資産合計	73,993,726,707
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	99,646,239
未払解約金	24,998,106
未払利息	32
その他未払費用	2,165,900
流動負債合計	126,810,277
負債合計	126,810,277
純資産の部	
元本等	
元本	45,627,558,465
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	28,239,357,965
元本等合計	73,866,916,430
純資産合計	73,866,916,430
負債純資産合計	73,993,726,707

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）

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.6189円
(10,000口当たり純資産額)	(16,189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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。

当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2022年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
投資信託受益証券	
（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

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	39,720,076,726円
同期中における追加設定元本額	10,447,597,715円
同期中における一部解約元本額	4,540,115,976円

期末元本額	45,627,558,465円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	20,142,034円
野村資産設計ファンド2020	20,626,903円
野村資産設計ファンド2025	36,898,506円
野村資産設計ファンド2030	54,746,821円
野村資産設計ファンド2035	46,657,477円
野村資産設計ファンド2040	88,092,187円
野村資産設計ファンド2045	17,147,690円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,603,909,240円
ネクストコア	3,998,860円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	444,169,363円
野村資産設計ファンド2050	21,899,383円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	6,576,972円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	3,646,677円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,896,788円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	2,476,155円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,545,147円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,406,141円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	10,645,526円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	3,170,095円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	12,944,982円
野村つみたて外国株投信	4,115,266,976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）	1,026,784,007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）	1,839,725,459円
世界6資産分散ファンド	104,861,928円
野村資産設計ファンド2060	15,777,935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	1,232,902,988円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,422,544,458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）	4,200,835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）	416,283,576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）	804,477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）	30,809,030,218円
野村DC運用戦略ファンド	124,789,861円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	8,833,691円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	15,968,097円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	14,417,755円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	11,487,164円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	7,345,924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）	52,936,169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(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	20,300	17.47	354,641.00	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	32,050	0.72	23,076.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,000	0.65	4,551.40	
		PJSC GAZPROM-ADR	456,300	0.58	265,292.82	
		ROSNEFT OJSC - GDR	83,900	0.60	50,491.02	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	103,000	0.47	48,410.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	19,100	2.35	44,885.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	12,100	0.05	631.62	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	11,579	78.82	912,656.78	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	21,600	10.00	216,000.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	10,300	0.31	3,256.86	
		PJSC ALROSA	176,000	0.99	175,429.76	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	48,600	1.89	91,854.00	
		POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,710	3.90	18,369.00	
		SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	0.06	949.58	
		SOUTHERN COPPER CORP	6,300	68.17	429,471.00	
		ZTO EXPRESS CAYMAN INC	34,600	23.79	823,134.00	
		DIDI GLOBAL INC	18,200	1.71	31,122.00	
		LI AUTO INC - ADR	43,200	22.47	970,704.00	
		NIO INC ADR	105,000	17.15	1,800,750.00	
		XPENG INC ADR	29,900	23.84	712,816.00	
		HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	14,300	29.14	416,702.00	
		TRIP.COM GROUP LTD-ADR	39,200	21.55	844,760.00	
		YUM CHINA HOLDINGS INC	34,700	41.08	1,425,476.00	
		DADA NEXUS LTD-ADR	4,100	7.26	29,766.00	
		OZON HOLDINGS PLC - ADR	5,300	11.60	61,480.00	
		PINDUODUO INC ADR	35,580	34.75	1,236,405.00	
		VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	32,200	7.13	229,586.00	
		MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	31,300	0.01	388.12	
		X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	11,500	0.53	6,111.10	

CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	7,100	14.03	99,613.00	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	56,300	1.75	98,525.00	
BEIGENE, LTD ADR	3,560	164.72	586,403.20	
I-MAB-SPONSORED ADR	2,300	14.17	32,591.00	
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	4,500	39.09	175,905.00	
ZAI LAB LTD - ADR	7,090	42.21	299,268.90	
HUTCHMED CHINA-ADR	7,800	16.13	125,814.00	
BANCO DE CHILE-ADR	18,100	21.75	393,675.00	
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	20.67	285,246.00	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	10,030	42.64	427,679.20	
CREDICORP LTD	4,970	153.84	764,584.80	
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	811,000	1.47	1,199,063.50	
STATE BANK OF INDIA-GDR	13,800	67.20	927,360.00	
TCS GROUP HOLDING-REG S	9,300	3.19	29,694.90	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	1.00	87,890.00	
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	6,000	4.38	26,280.00	
GDS HOLDINGS LTD-ADR	6,500	29.11	189,215.00	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	4,000	3.52	14,080.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	29,000	3.75	109,011.00	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,100	40.53	166,173.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	28,650	5.50	157,575.00	
ENEL AMERICAS S.A-ADR	29,900	5.68	169,832.00	
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	1.48	63,492.00	
INTER RAO UES PJSC	3,660,000	0.03	111,044.40	
360 DIGITECH INC-ADR	6,000	13.39	80,340.00	
LUFAX HOLDING LTD	46,800	5.33	249,444.00	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	133,000	1.12	150,021.34	
NOAH HLDS LTD ADR	3,000	19.01	57,030.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	10,940	10.19	111,478.60	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	29,730	2.72	80,865.60	
51JOB INC-ADR	2,210	60.56	133,837.60	
KE HOLDINGS INC ADR	27,600	11.87	327,612.00	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.91	79,934.97	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	12,020	21.00	252,420.00	
IQIYI INC-ADR	21,400	3.20	68,480.00	

	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	59,400	4.16	247,104.00	
	AUTOHOME INC-ADR	7,500	25.45	190,875.00	
	BAIDU INC - SPON ADR	22,170	115.97	2,571,054.90	
	HELLO GROUP INC-SPN ADR	11,500	4.42	50,830.00	
	JOYY INC	4,250	37.09	157,632.50	
	KANZHUN LTD	8,400	20.38	171,192.00	
	VK CO LTD GDR	7,000	0.85	5,992.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	4,500	20.78	93,510.00	
	YANDEX NV-A	23,640	18.94	447,741.60	
小計	銘柄数：74			23,296,578.07	
				(2,997,104,768)	
	組入時価比率：4.1%			4.4%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	93,958	49.35	4,636,827.30	
	CEMEX SAB - CPO	1,121,985	9.33	10,468,120.05	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	254,983	102.36	26,100,059.88	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	236.82	1,991,656.20	
	ALFA S.A.B.-A	218,000	14.56	3,174,080.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	71.60	2,498,840.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,900	415.35	7,850,115.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	30,400	294.63	8,956,752.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,400	155.06	2,542,984.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	408,000	76.04	31,024,320.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	32,000	127.50	4,080,000.00	
	BECLE SAB DE CV	47,000	46.62	2,191,140.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	38,000	114.63	4,355,940.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	156,800	156.68	24,567,424.00	
	GRUMA S.A.B.-B	15,600	246.22	3,841,032.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	138,000	55.84	7,705,920.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	110,000	28.41	3,125,100.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	200,100	137.11	27,435,711.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	169,000	38.33	6,477,770.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,426,000	21.49	52,134,740.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	178,000	43.07	7,666,460.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	60.62	1,400,322.00	
小計	銘柄数：22			244,225,313.43	

				(1,555,471,021)	
	組入時価比率：2.1%			2.3%	
リアル	COSAN SA	86,800	22.73	1,972,964.00	
	PETRO RIO SA	65,300	25.70	1,678,210.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	287,000	35.12	10,079,440.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	383,000	31.80	12,179,400.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	14.45	693,600.00	
	BRASKEM SA-PREF A	13,200	41.39	546,348.00	
	KLABIN SA-UNIT	61,000	22.19	1,353,590.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	23.84	1,101,408.00	
	GERDAU SA PFD NPV	95,000	29.05	2,759,750.00	
	VALE SA	323,652	85.40	27,639,880.80	
	SUZANO SA	62,960	51.99	3,273,290.40	
	WEG SA	134,748	31.42	4,233,782.16	
	LOCALIZA RENT A CAR	45,660	58.16	2,655,585.60	
	RUMO SA	96,000	18.83	1,807,680.00	
	CCR SA	121,000	13.75	1,663,750.00	
	ALPARGATAS SA-PREF	12,000	21.71	260,520.00	
	AMERICANAS SA	60,039	27.24	1,635,462.36	
	LOJAS RENNER S.A.	69,074	25.98	1,794,542.52	
	MAGAZINE LUIZA SA	230,000	5.61	1,290,300.00	
	VIBRA ENERGIA SA	83,600	22.48	1,879,328.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	21.75	643,800.00	
	RAIA DROGASIL SA	78,200	22.45	1,755,590.00	
	AMBEV SA	389,956	14.73	5,744,051.88	
	BRF SA	63,000	14.76	929,880.00	
	JBS SA	74,600	38.37	2,862,402.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	62,500	21.35	1,334,375.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	328,987	10.50	3,454,363.50	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	29,800	41.60	1,239,680.00	
	HYPERA SA	23,900	37.80	903,420.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	122,153	16.08	1,964,220.24	
	BANCO BRADESCO SA - PREF	410,342	19.50	8,001,669.00	
	BANCO DO BRASIL SA	72,800	35.16	2,559,648.00	
	BANCO INTER SA-UNITS	27,300	17.69	482,937.00	

	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	35.04	854,976.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	373,991	26.18	9,791,084.38	
	ITAUSA SA	352,817	10.06	3,549,339.02	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	67,000	26.76	1,792,920.00	
	TOTVS SA	40,000	35.33	1,413,200.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	41,605	52.78	2,195,911.90	
	TIM SA	82,952	13.55	1,123,999.60	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	42.27	760,860.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	30,000	42.20	1,266,000.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	69,683	14.73	1,026,430.59	
	ENERGISA SA-UNITS	10,200	47.77	487,254.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	91,000	25.45	2,315,950.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	33,600	47.35	1,590,960.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	475,799	14.69	6,989,487.31	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	90,000	26.25	2,362,500.00	
	ENGIE BRASIL SA	12,000	44.10	529,200.00	
	小計 銘柄数：49			150,424,941.26	
				(4,185,664,245)	
	組入時価比率：5.7%			6.2%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	6,699.00	173,504,100.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,370.80	98,630,430.80	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,452.00	123,090,400.00	
	CENCOSUD SA	126,000	1,470.00	185,220,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,396	27,790.00	94,374,840.00	
	小計 銘柄数：5			674,819,770.80	
				(105,104,528)	
	組入時価比率：0.1%			0.2%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	43,000.00	683,700,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	36,800.00	478,400,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	24,490.00	827,762,000.00	
	小計 銘柄数：3			1,989,862,000.00	
				(67,884,142)	
	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	14.57	192,178.30	

		JUMBO SA	6,732	15.15	101,989.80	
		ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	206,500	1.18	243,670.00	
		EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	180,800	1.07	193,456.00	
		HELLENIC TELECOM	18,000	18.04	324,720.00	
		PUBLIC POWER CORP	20,000	8.18	163,600.00	
		小計 銘柄数：7			1,219,614.10	
					(169,977,617)	
		組入時価比率：0.2%			0.3%	
	トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	257.50	2,137,250.00	
		EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	36.50	4,234,000.00	
		ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	28.52	1,182,439.20	
		KOC HLDGS	53,000	41.14	2,180,420.00	
		TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	88,000	18.28	1,608,640.00	
		FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	6,200	312.50	1,937,500.00	
		BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	30,000	89.70	2,691,000.00	
		AKBANK T.A.S	205,000	9.53	1,953,650.00	
		TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	14.49	2,059,898.40	
		TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	10.98	1,007,964.00	
		TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	117,000	23.50	2,749,500.00	
		小計 銘柄数：11			23,742,261.60	
					(207,706,801)	
		組入時価比率：0.3%			0.3%	
	チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	856.00	4,322,800.00	
		MONETA MONEY BANK AS	42,000	92.00	3,864,000.00	
		CEZ AS	12,500	991.00	12,387,500.00	
		小計 銘柄数：3			20,574,300.00	
					(117,722,029)	
		組入時価比率：0.2%			0.2%	
	フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	37,500	3,104.00	116,400,000.00	
		RICHTER GEDEON NYRT	9,200	6,960.00	64,032,000.00	
		OTP BANK NYRT	16,200	10,690.00	173,178,000.00	
		小計 銘柄数：3			353,610,000.00	
					(132,993,781)	
		組入時価比率：0.2%			0.2%	
	ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	25,900	78.38	2,030,042.00	

		POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	175,000	6.42	1,123,500.00	
		KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	161.70	1,600,830.00	
		LPP SA	94	10,400.00	977,600.00	
		ALLEGRO.EU SA	29,400	28.04	824,523.00	
		DINO POLSKA SA	3,820	318.90	1,218,198.00	
		BANK PEKAO SA	15,700	112.30	1,763,110.00	
		MBANK	1,100	336.60	370,260.00	
		PKO BANK POLSKI SA	63,000	38.88	2,449,440.00	
		SANTANDER BANK POLSKA SA	3,100	295.20	915,120.00	
		POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,500	32.89	1,660,945.00	
		ORANGE POLSKA SA	39,150	7.40	289,710.00	
		POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	8.99	465,259.62	
		CYFROWY POLSAT SA	18,900	26.04	492,156.00	
		CD PROJEKT RED SA	4,960	128.64	638,054.40	
		小計銘柄数：15			16,818,748.02	
					(505,287,328)	
		組入時価比率：0.7%			0.7%	
	香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.00	0.00	
		CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	130,000	8.08	1,050,400.00	
		CHINA COAL ENERGY CO-H	150,000	6.45	967,500.00	
		CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,930,900	3.96	7,646,364.00	
		CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	283,000	24.65	6,975,950.00	
		CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	129,000	4.48	577,920.00	
		PETROCHINA CO LTD-H	1,700,000	3.94	6,698,000.00	
		YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	138,000	21.95	3,029,100.00	
		DONGYUE GROUP LTD	108,000	8.42	909,360.00	
		HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS	69,000	4.27	294,630.00	
		ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	107,000	39.35	4,210,450.00	
		CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	309,000	9.67	2,988,030.00	
		CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	176,000	6.21	1,092,960.00	
		ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280,000	4.26	1,192,800.00	
		CHINA HONGQIAO GROUP LTD	160,000	10.70	1,712,000.00	
		CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	240,000	4.21	1,010,400.00	
		GANFENG LITHIUM CO LTD	22,600	89.20	2,015,920.00	

JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	13.08	1,281,840.00	
MMG LTD	168,000	3.30	554,400.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	36,000	15.72	565,920.00	
ZIJIN MINING GROUP CO-H	489,000	12.22	5,975,580.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	3.80	296,400.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	118,000	6.82	804,760.00	
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	4.10	828,200.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	8.39	771,880.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	3.35	584,240.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	134,000	21.35	2,860,900.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	290,000	4.79	1,389,100.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	9.16	1,403,770.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	55,984	11.44	640,456.96	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	25.40	922,020.00	
CITIC LTD	473,000	8.65	4,091,450.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	225,940	8.14	1,839,151.60	
CRRC CORP LTD-H	320,000	2.87	918,400.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	57,000	18.94	1,079,580.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	77,000	7.60	585,200.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	50,000	9.24	462,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	149,800	10.86	1,626,828.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	116,000	4.81	557,960.00	
BOC AVIATION LTD	15,000	59.00	885,000.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	4.62	1,298,220.00	
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	5.46	556,920.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	4.43	469,580.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	273,000	12.62	3,445,260.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	4.38	429,240.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	106,000	13.96	1,479,760.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	182,000	5.64	1,026,480.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	7.83	532,440.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	8.55	675,450.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	6.70	763,800.00	

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	30.90	1,347,240.00	
MINTH GROUP LTD	54,000	18.02	973,080.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	2.74	597,320.00	
BYD CO LTD-H	65,000	231.20	15,028,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	5.62	1,034,080.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	454,000	11.80	5,357,200.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	248,000	10.94	2,713,120.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	285,890	6.42	1,835,413.80	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	86,000	11.62	999,320.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	192,000	26.10	5,011,200.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	87,200	89.45	7,800,040.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	3.73	760,920.00	
LI NING CO LTD	191,000	60.85	11,622,350.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	63,700	104.80	6,675,760.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	111,000	14.90	1,653,900.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	16.22	924,540.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	70,800	13.98	989,784.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,194,980	87.90	105,038,742.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	290,000	4.12	1,194,800.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	192,000	1.92	368,640.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	33,700	45.05	1,518,185.00	
JD.COM, INC.	157,967	206.40	32,604,388.80	
MEITUAN-CLASS B	322,100	137.80	44,385,380.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	20.05	733,830.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	42,000	25.50	1,071,000.00	
GOME RETAIL HODINGS LTD	1,100,360	0.39	429,140.40	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	112,000	6.05	677,600.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	55,000	51.95	2,857,250.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	149,000	2.34	348,660.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	105.03	735,210.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	111,333	45.35	5,048,951.55	
NONGFU SPRING LTD	139,400	42.60	5,938,440.00	

TSING TAO BREWERY CO-H	42,000	63.05	2,648,100.00	
CHINA FEIHE LTD	292,000	7.30	2,131,600.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	244,000	42.50	10,370,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.06	452,690.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	168,000	14.40	2,419,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	125,000	7.05	881,250.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	349,000	6.68	2,331,320.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	22.65	702,150.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	133,000	17.34	2,306,220.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	18.98	436,540.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	60,000	37.35	2,241,000.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	14.72	691,840.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	180,000	8.45	1,521,000.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,000	12.96	194,400.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO	25,200	34.75	875,700.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	86,000	5.53	475,580.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	12.90	656,610.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	96,400	16.98	1,636,872.00	
3SBIO,INC	77,000	5.49	422,730.00	
AKESO INC	20,000	13.88	277,600.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	104,000	25.50	2,652,000.00	
CANSINO BIOLOGICS INC	5,800	96.25	558,250.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	98,000	11.02	1,079,960.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	248,000	3.71	920,080.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	707,520	8.21	5,808,739.20	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	84,000	12.76	1,071,840.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	31.50	1,086,750.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	868,500	4.03	3,500,055.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,160,000	3.00	6,480,000.00	
BANK OF CHINA LTD-H	6,240,000	3.13	19,531,200.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	745,790	5.59	4,168,966.10	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	160,000	1.31	209,600.00	

CHINA CITIC BANK-H	640,000	4.00	2,560,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	7,570,000	5.72	43,300,400.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	2.88	740,160.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	307,192	50.80	15,605,353.60	
CHINA MINSHENG BANKING-H	374,800	2.97	1,113,156.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,350,000	4.74	20,619,000.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	681,000	6.36	4,331,160.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.86	1,056,440.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	582,000	11.92	6,937,440.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	198,000	18.56	3,674,880.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	9.38	970,567.36	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	22.00	1,300,200.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.53	1,485,110.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	550,420	8.23	4,529,956.60	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	498,500	53.65	26,744,525.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	35,800	23.10	826,980.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED	194,000	6.17	1,196,980.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	11.58	764,280.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	219,000	14.60	3,197,400.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	57,000	9.18	523,260.00	
WEIMOB INC	125,000	4.49	561,250.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	14.40	741,600.00	
ZTE CORP-H	76,052	15.50	1,178,806.00	
LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
LENOVO GROUP LTD	604,000	7.78	4,699,120.00	
XIAOMI CORPORATION	1,102,000	11.52	12,695,040.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,000	16.22	843,440.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	60,000	35.95	2,157,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	65,000	12.04	782,600.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	54,700	106.00	5,798,200.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	28,000	25.05	701,400.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	46,000	28.65	1,317,900.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	398,000	11.84	4,712,320.00	

CHINA TOWER CORP LTD	3,610,000	0.90	3,249,000.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	26.65	959,400.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	247,000	9.13	2,255,110.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	68,000	30.65	2,084,200.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	61,500	103.40	6,359,100.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	6.80	2,148,800.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	2.57	1,040,850.00	
GUANGDONG INVESTMENT	240,000	10.04	2,409,600.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.33	824,600.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.51	1,199,660.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	102,800	16.42	1,687,976.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	226,550	17.08	3,869,474.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	10.04	829,304.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	268,000	5.75	1,541,000.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	11.00	1,122,000.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	65,000	6.42	417,300.00	
CGN POWER CO LTD-H	980,000	2.03	1,989,400.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	284,000	15.72	4,464,480.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	490,000	3.67	1,798,300.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	14.14	2,121,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	3.52	837,760.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	98,000	21.55	2,111,900.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	83.75	670,000.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD	9,600	96.75	928,800.00	
WUXI APPTTEC CO LTD	30,500	104.00	3,172,000.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	288,000	56.00	16,128,000.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	410,000	2.50	1,025,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	320,000	24.65	7,888,000.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	9.00	765,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	248,444	35.15	8,732,806.60	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	52,200	36.10	1,884,420.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	128,000	18.50	2,368,000.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	80,000	10.20	816,000.00	

	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	247,800	3.66	906,948.00	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	574,380	5.31	3,049,957.80	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	147,000	31.80	4,674,600.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	13.68	766,080.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.	128,000	7.64	977,920.00	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	52,800	15.66	826,848.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	154,000	40.00	6,160,000.00	
	POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	101,000	2.57	259,570.00	
	SEAZEN GROUP LTD	168,000	3.55	596,400.00	
	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	43,000	4.07	175,010.00	
	WHARF(HOLDING)	117,000	22.80	2,667,600.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	100,000	8.47	847,000.00	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	29.40	834,960.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	0.65	565,500.00	
	KINGSOFT CORP LTD	67,000	21.95	1,470,650.00	
	NETEASE, INC.	165,950	138.20	22,934,290.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	39,800	59.80	2,380,040.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	453,600	348.00	157,852,800.00	
小計	銘柄数：199			908,297,637.37	
				(14,896,081,252)	
	組入時価比率：20.2%			22.1%	
リング	DIALOG GROUP BHD	313,044	2.65	829,566.60	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	30,000	21.70	651,000.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	190,000	10.38	1,972,200.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	248,000	6.59	1,634,320.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	7.52	254,176.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.39	525,800.00	
	MISC BHD	99,960	7.81	780,687.60	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	121,460	6.82	828,357.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.97	204,058.00	
	GENTING BHD	187,000	4.55	850,850.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.98	682,420.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	22.08	170,016.00	
	IOI CORP	162,000	4.39	711,180.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	42,400	28.28	1,199,072.00	

	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	132.80	584,320.00	
	PPB GROUP BERHAD	51,740	17.10	884,754.00	
	QL RESOURCES BHD	60,000	5.00	300,000.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	5.25	757,575.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	4.57	534,690.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	428,000	1.72	736,160.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	6.54	1,020,240.00	
	AMMB HOLDING	125,000	3.71	463,750.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	508,000	5.17	2,626,360.00	
	HONG LEONG BANK	60,960	20.70	1,261,872.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	19.24	258,239.28	
	MALAYAN BANKING	379,000	8.88	3,365,520.00	
	PUBLIC BANK BHD	1,177,000	4.67	5,496,590.00	
	RHB BANK BHD	125,023	5.92	740,136.16	
	INARI AMERTRON BHD	271,000	2.92	791,320.00	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	4.96	307,520.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.58	698,100.00	
	DIGI.COM BERHAD	286,000	3.85	1,101,100.00	
	MAXIS BHD	146,200	3.86	564,332.00	
	TENAGA NASIONAL	182,000	8.89	1,617,980.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	63,000	16.90	1,064,700.00	
	小計銘柄数：35			36,468,961.84	
				(1,088,966,847)	
	組入時価比率：1.5%			1.6%	
パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	113,000	148.00	16,724,000.00	
	PTT PCL-NVDR	764,000	37.75	28,841,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	54.00	4,482,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	47.25	5,243,190.75	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	49.50	7,523,703.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	58,700	362.00	21,249,400.00	
	SCG PACKAGING PLC-NVDR	89,700	57.00	5,112,900.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	9.10	4,331,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	361,000	68.00	24,548,000.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	8.35	3,733,285.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	700,000	5.00	3,500,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	270,978	34.75	9,416,485.50	

	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	40.50	6,278,512.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	15.70	5,567,172.90	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	258,000	25.00	6,450,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	34.75	2,561,075.00	
	CP ALL PCL-NVDR	482,000	65.75	31,691,500.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	20,900	107.00	2,236,300.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	112,000	34.75	3,892,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	23.70	6,612,300.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	16.80	3,356,640.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	56,000	25.00	1,400,000.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	782,000	26.75	20,918,500.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	165.50	5,329,100.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	13.10	3,498,355.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	81,000	85.75	6,945,750.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	26,300	381.00	10,020,300.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	4.92	4,526,400.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	85,700	219.00	18,768,300.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	71.00	9,940,000.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	68,000	59.25	4,029,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	51.25	2,511,250.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	55.50	3,496,500.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	154,000	20.30	3,126,200.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	33.50	1,139,000.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	170.00	2,941,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	134,000	90.75	12,160,500.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	70.00	4,130,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	261,000	49.75	12,984,750.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	44.75	1,924,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	185,000	61.50	11,377,500.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	9.40	5,828,000.00	
小計	銘柄数：42			350,345,719.65	
				(1,327,810,277)	
	組入時価比率：1.8%			2.0%	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	56.00	8,176,000.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	780.00	16,459,560.00	

		GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	529.00	2,890,985.00	
		JG SUMMIT HOLDINGS INC	255,005	57.80	14,739,289.00	
		SM INVESTMENTS CORP	17,100	865.00	14,791,500.00	
		INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	93,000	222.20	20,664,600.00	
		JOLLIBEE FOODS CORPORATION	43,000	224.00	9,632,000.00	
		MONDE NISSIN CORP	330,000	13.54	4,468,200.00	
		UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	113.50	7,604,500.00	
		BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	145,999	100.00	14,599,900.00	
		BDO UNIBANK INC	168,998	135.00	22,814,730.00	
		METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	56.00	7,150,920.00	
		METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.84	2,871,552.00	
		GLOBE TELECOM INC	2,070	2,514.00	5,203,980.00	
		PLDT INC	4,970	1,891.00	9,398,270.00	
		MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	351.80	5,945,420.00	
		AC ENERGY CORP	570,000	8.45	4,816,500.00	
		AYALA LAND LTD	608,000	35.00	21,280,000.00	
		SM PRIME HLDGS	773,975	37.00	28,637,075.00	
	小計	銘柄数：19			222,144,981.00	
					(545,632,502)	
		組入時価比率：0.7%			0.8%	
ルピア		ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	839,200	3,270.00	2,744,184,000.00	
		UNITED TRACTORS TBK PT	147,050	28,125.00	4,135,781,250.00	
		BARITO PACIFIC TBK PT	2,880,000	890.00	2,563,200,000.00	
		INDOCEMENT TUNGAL PRAKARSA	127,000	10,150.00	1,289,050,000.00	
		SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	6,075.00	1,069,200,000.00	
		ANEKA TAMBANG TBK	760,000	2,790.00	2,120,400,000.00	
		MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,060,000	5,500.00	5,830,000,000.00	
		MERDEKA COPPER GOLD TBK-RIGHTS	55,813	2,700.00	150,695,100.00	
		INDAH KIAT PULP&PAPER	240,000	7,600.00	1,824,000,000.00	
		PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,660,000	7,000.00	11,620,000,000.00	
		INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	7,425.00	1,321,650,000.00	
		INDOFOOD SUKSES MAK TBK	420,000	6,250.00	2,625,000,000.00	
		PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	700,000	5,000.00	3,500,000,000.00	
		GUDANG GARAM TBK	29,200	30,700.00	896,440,000.00	
		UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	3,400.00	1,779,900,000.00	

小計	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,600.00	2,464,000,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	4,380,000	7,925.00	34,711,500,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	368,000	12,425.00	4,572,400,000.00	
	BANK MANDIRI	1,330,000	8,300.00	11,039,000,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	9,375.00	4,678,125,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,530,028	4,800.00	26,544,134,400.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	1,050.00	1,552,950,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,800,000	4,620.00	17,556,000,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	553,000	3,030.00	1,675,590,000.00	
	銘柄数：24			148,263,199,750.00	
				(1,334,368,797)	
	組入時価比率：1.8%			2.0%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	44,050.00	158,580,000.00	
	HD HYUNDAI CO LTD	2,985	58,800.00	175,518,000.00	
	S-OIL CORPORATION	3,930	104,500.00	410,685,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,942	219,000.00	863,298,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	10,300	34,150.00	351,745,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	1,490	152,500.00	227,225,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	630	256,000.00	161,280,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	3,538	503,000.00	1,779,614,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,610	196,500.00	316,365,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	900	129,000.00	116,100,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,490	125,500.00	312,495,000.00	
	SKC CO LTD	1,450	156,000.00	226,200,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	2,241	130,000.00	291,330,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,399	44,500.00	329,255,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	592	630,000.00	372,960,000.00	
	POSCO HOLDINGS INC	5,710	299,000.00	1,707,290,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	43,700.00	197,524,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	41,650.00	175,763,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	6,900	44,200.00	304,980,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,400	24,400.00	351,360,000.00	
	DOOSAN ENERBILITY CO LTD	25,920	21,750.00	563,760,000.00	
	ECOPRO BM CO LTD	810	474,500.00	384,345,000.00	
	LG ENERGY SOLUTION	1,620	437,000.00	707,940,000.00	

CJ CORP	1,100	88,800.00	97,680,000.00	
LG CORP	6,554	75,100.00	492,205,400.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,720	112,000.00	752,640,000.00	
SK INC	3,370	265,000.00	893,050,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	41,850.00	140,197,500.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING	3,210	95,900.00	307,839,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	63,000	6,180.00	389,340,000.00	
S-1 CORPORATION	1,450	69,500.00	100,775,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,810	195,500.00	353,855,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	12,600	31,800.00	400,680,000.00	
HMM COMPANY LIMITED	20,600	27,900.00	574,740,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	6,730.00	100,209,700.00	
CJ LOGISTICS	780	127,000.00	99,060,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	35,450.00	188,594,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	11,750.00	136,887,500.00	
HYUNDAI MOBIS	5,510	212,000.00	1,168,120,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	10,710	183,000.00	1,959,930,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	93,400.00	246,576,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	91,800.00	134,946,000.00	
KIA CORP	20,260	79,900.00	1,618,774,000.00	
COWAY CO LTD	4,970	67,500.00	335,475,000.00	
LG ELECTRONICS INC	8,280	125,000.00	1,035,000,000.00	
HLB INC	7,400	30,350.00	224,590,000.00	
F&F CO LTD / NEW	1,600	143,000.00	228,800,000.00	
KANGWON LAND INC	7,900	27,200.00	214,880,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	800	98,300.00	78,640,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	83,400.00	163,464,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	180,000.00	87,300,000.00	
E-MART CO	1,181	137,500.00	162,387,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	820	403,500.00	330,870,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	93,300.00	167,940,000.00	
KT & G CORP	9,410	81,400.00	765,974,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,460	167,500.00	412,050,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	47,150.00	71,668,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	806	942,000.00	759,252,000.00	

LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	496,000.00	51,584,000.00	
SD BIOSENSOR INC	3,500	48,100.00	168,350,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	7,570	60,700.00	459,499,000.00	
ALTEOGEN INC	2,130	53,700.00	114,381,000.00	
CELLTRION INC	7,940	159,500.00	1,266,430,000.00	
GREEN CROSS CORP	410	189,000.00	77,490,000.00	
SEEGENE, INC.	2,720	42,050.00	114,376,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,950	132,000.00	257,400,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,081	87,800.00	94,911,800.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	499	305,500.00	152,444,500.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,770	87,900.00	155,583,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,991	59,600.00	237,863,600.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	23,700	48,050.00	1,138,785,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	26,100	11,450.00	298,845,000.00	
KAKAObANK CORP	7,000	45,050.00	315,350,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	30,700	60,300.00	1,851,210,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	35,600	41,350.00	1,472,060,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	42,300	16,200.00	685,260,000.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,360	38,600.00	129,696,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	67,100.00	191,235,000.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	4,230	45,900.00	194,157,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	2,510	210,000.00	527,100,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	65,800.00	305,312,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,570	139,500.00	358,515,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	375,930	67,700.00	25,450,461,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	64,800	60,600.00	3,926,880,000.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,150	90,400.00	194,360,000.00	
L&F CO LTD	1,660	245,800.00	408,028,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,260	388,000.00	488,880,000.00	
LG.DISPLAY CO LTD	16,200	18,600.00	301,320,000.00	
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	4,800	168,500.00	808,800,000.00	
SAMSUNG SDI CO,LTD	4,241	610,000.00	2,587,010,000.00	
SK HYNIX INC	42,980	113,000.00	4,856,740,000.00	
SK SQUARE CO LTD	8,699	56,300.00	489,753,700.00	
LG UPLUS CORP	13,300	14,650.00	194,845,000.00	

	SK TELECOM CO LTD	2,520	62,000.00	156,240,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	19,600	21,700.00	425,320,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	75,700.00	237,698,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	6,720.00	164,640,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	24,737	8,360.00	206,801,320.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	11,050.00	85,416,500.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	40,250.00	143,491,250.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,559	806,000.00	1,256,554,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	25,150.00	148,385,000.00	
	CJ ENM CO LTD	657	130,400.00	85,672,800.00	
	HYBE CO LTD	1,220	261,000.00	318,420,000.00	
	KAKAO GAMES CORP	2,810	64,600.00	181,526,000.00	
	KRAFTON INC	1,630	258,000.00	420,540,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,296	437,000.00	566,352,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	102,000.00	149,940,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	2,860	93,400.00	267,124,000.00	
	KAKAO CORP	25,240	93,600.00	2,362,464,000.00	
	NAVER CORP	9,910	309,500.00	3,067,145,000.00	
小計	銘柄数：111			86,248,647,570.00	
				(8,943,984,753)	
	組入時価比率：12.1%			13.3%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	92.40	8,164,464.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	289,998	80.90	23,460,838.20	
	FORMOSA PLASTIC	309,424	107.00	33,108,368.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	399,726	88.30	35,295,805.80	
	ASIA CEMENT	208,980	47.70	9,968,346.00	
	TAIWAN CEMENT	395,294	46.80	18,499,759.20	
	CHINA STEEL	914,544	37.80	34,569,763.20	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	5,000	1,300.00	6,500,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	234,454	30.40	7,127,401.60	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10,464	865.00	9,051,360.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	18,591	225.00	4,182,975.00	
	EVERGREEN MARINE	202,375	145.50	29,445,562.50	
	WAN HAI LINES LIMITED	42,900	157.50	6,756,750.00	

YANG MING MARINE TRANSPORT	143,000	125.00	17,875,000.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	28.45	4,068,350.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	34.55	4,907,343.80	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	318.50	3,185,000.00	
GIANT MANUFACTURING	18,752	258.50	4,847,392.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	14,443	488.00	7,048,184.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,815	193.50	6,349,702.50	
POU CHEN CORP	175,468	32.40	5,685,163.20	
MOMO.COM INC	3,000	1,005.00	3,015,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	23,000	585.00	13,455,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	42,816	271.50	11,624,544.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	378,836	67.50	25,571,430.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	22,000	216.50	4,763,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	359,013	18.50	6,641,740.50	
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,514,212	28.75	43,533,595.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	979,063	32.20	31,525,828.60	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	769,943	27.70	21,327,421.10	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	686,374	23.40	16,061,151.60	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	858,380	41.00	35,193,580.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	759,549	18.25	13,861,769.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	871,051	19.30	16,811,284.30	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	743,020	28.55	21,213,221.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	291,574	49.25	14,360,019.50	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	102,571	246.50	25,283,751.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	759,152	26.55	20,155,485.60	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	647,035	63.90	41,345,536.50	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	1,269,789	18.40	23,364,117.60	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	587,775	74.60	43,848,015.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,030,113	10.05	10,352,635.65	
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	36,000	225.50	8,118,000.00	
ACER INC	256,767	28.10	7,215,152.70	
ADVANTECH CO.,LTD.	26,750	377.00	10,084,750.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	53,805	358.50	19,289,092.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	45,840	147.50	6,761,400.00	

COMPAL ELECTRONICS	354,590	25.40	9,006,586.00	
INVENTEC CO.,LTD	251,911	25.25	6,360,752.75	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	66.80	9,745,919.60	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	122.50	6,370,000.00	
PEGATRON CORP	159,692	71.90	11,481,854.80	
QUANTA COMPUTER INC	224,684	84.60	19,008,266.40	
WIIWYNN CORP	5,000	1,015.00	5,075,000.00	
AU OPTRONICS CORP	717,008	18.55	13,300,498.40	
DELTA ELECTRONICS INC	149,681	253.00	37,869,293.00	
E INK HOLDINGS INC	66,000	185.00	12,210,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	60.70	3,328,423.80	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	997,649	103.00	102,757,847.00	
INNOLUX CORP	837,322	15.45	12,936,624.90	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	1,700.00	13,668,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	16,000	462.50	7,400,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	122,566	78.80	9,658,200.80	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	220.00	22,000,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	56.10	6,753,710.70	
YAGEO CORPORATION	34,377	412.50	14,180,512.50	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	64,410	111.50	7,181,715.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	248,658	99.50	24,741,471.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,620.00	3,240,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,000	1,380.00	6,900,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	17,000	592.00	10,064,000.00	
MEDIATEK INC	119,538	868.00	103,758,984.00	
NANYA TECHNOLOGY CO	100,000	66.90	6,690,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	43,058	401.50	17,287,787.00	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	6,000	1,420.00	8,520,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	35,417	406.00	14,379,302.00	
SILERGY CORP	6,000	2,890.00	17,340,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,939,000	565.00	1,095,535,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	963,500	48.05	46,296,175.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	109.00	7,521,000.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	24,000	233.00	5,592,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	28.50	6,897,000.00	

小計	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	312,065	131.00	40,880,515.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	77.10	8,095,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	128,200	108.00	13,845,600.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	113,112	69.90	7,906,528.80	
	銘柄数：86			2,550,658,119.35	
				(11,243,045,924)	
	組入時価比率：15.2%			16.7%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	70,000	397.70	27,839,000.00	
	COAL INDIA LTD	142,000	206.90	29,379,800.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	64,380	300.95	19,375,161.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	135.05	15,260,650.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	219,000	174.15	38,138,850.00	
	PETRONET LNG LTD	77,000	210.70	16,223,900.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	225,000	2,782.10	625,972,500.00	
	ASIAN PAINTS LTD	29,800	3,158.25	94,115,850.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	715.05	13,585,950.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,000	2,876.30	20,134,100.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,400	2,406.35	29,838,740.00	
	SRF LTD	11,000	2,547.40	28,021,400.00	
	UPL LTD	43,200	829.15	35,819,280.00	
	ACC LIMITED	6,000	2,270.10	13,620,600.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	377.35	21,508,950.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	23,300	1,764.25	41,107,025.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	880	26,056.55	22,929,764.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	8,130	6,846.50	55,662,045.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	540.25	63,209,250.00	
	JSW STEEL LTD	66,000	734.20	48,457,200.00	
	TATA STEEL LIMITED	56,200	1,302.15	73,180,830.00	
	VEDANTA LTD	82,000	424.95	34,845,900.00	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	84,800	252.90	21,445,920.00	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	53,700	1,714.50	92,068,650.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	1,320.75	23,377,275.00	
	SIEMENS LIMITED	7,000	2,379.85	16,658,950.00	
	ADANI ENTERPRISES LTD	19,100	2,286.35	43,669,285.00	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,200	759.65	16,864,230.00	

INTERGLOBE AVIATION LTD	9,400	1,938.45	18,221,430.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	656.80	8,131,184.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	850.50	36,231,300.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	2,161.30	15,129,100.00	
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	738.80	9,382,760.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	106,000	141.60	15,009,600.00	
MRF LTD	200	69,714.80	13,942,960.00	
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,702.35	20,696,136.50	
EICHER MOTORS LTD	11,600	2,651.50	30,757,400.00	
HERO MOTOCORP LTD	9,300	2,317.65	21,554,145.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	73,700	911.00	67,140,700.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	10,980	7,879.20	86,513,616.00	
TATA MOTORS LTD	134,000	448.05	60,038,700.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	340	45,814.00	15,576,760.00	
TITAN CO LTD	26,900	2,521.00	67,814,900.00	
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	36,000	594.75	21,411,000.00	
ZOMATO LTD	143,000	80.80	11,554,400.00	
TRENT LTD	15,000	1,285.80	19,287,000.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,690	4,030.25	55,174,122.50	
UNITED SPIRITS LTD	22,600	871.15	19,687,990.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	7,600	3,359.90	25,535,240.00	
MARICO LIMITED	46,000	518.20	23,837,200.00	
NESTLE INDIA LIMITED	2,890	18,202.95	52,606,525.50	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,300	820.05	37,148,265.00	
ITC LTD	221,100	260.40	57,574,440.00	
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,556.95	15,880,890.00	
DABUR INDIA LTD	45,900	561.85	25,788,915.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	798.00	21,705,600.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	65,100	2,197.95	143,086,545.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	8,770	4,885.25	42,843,642.50	
BIOCON LTD	31,000	373.95	11,592,450.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	674.00	12,603,800.00	
CIPLA LIMITED	34,500	998.55	34,449,975.00	
DR.REDDYS LABORATORIES	9,140	4,320.30	39,487,542.00	
LUPIN LTD	14,900	782.45	11,658,505.00	

SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	61,700	944.10	58,250,970.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,270	2,829.95	9,253,936.50	
AXIS BANK LIMITED	176,200	801.80	141,277,160.00	
BANDHAN BANK LTD	56,000	336.40	18,838,400.00	
ICICI BANK LTD	404,900	762.35	308,675,515.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	43,500	1,760.85	76,596,975.00	
YES BANK LTD	839,000	14.15	11,871,850.00	
BAJAJ FINSERV LTD	3,160	15,835.75	50,040,970.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	2,239.35	17,751,327.45	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	76,300	570.95	43,563,485.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	16,000	1,401.00	22,416,000.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,200	532.55	17,680,660.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	36,500	1,144.55	41,776,075.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	84,900	1,099.20	93,322,080.00	
INFOSYS LTD	262,700	1,618.80	425,258,760.00	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,000	5,076.95	20,307,800.00	
MINDTREE LIMITED	4,880	3,737.50	18,239,000.00	
MPHASIS LTD	6,200	2,900.75	17,984,650.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	72,247	3,628.65	262,159,076.55	
TECH MAHINDRA LTD	49,700	1,312.70	65,241,190.00	
WIPRO LTD	106,000	539.20	57,155,200.00	
INDUS TOWERS LTD	61,000	216.45	13,203,450.00	
BHARTI AIRTEL LIMITED	191,500	735.75	140,896,125.00	
ADANI TRANSMISSION LTD	23,600	2,699.60	63,710,560.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	261,966	227.25	59,531,773.50	
TATA POWER COMPANY LIMITED	106,000	258.85	27,438,100.00	
ADANI TOTAL GAS LTD	19,000	2,443.35	46,423,650.00	
GAIL INDIA LTD	94,600	164.00	15,514,400.00	
INDRAPRASTHA GAS LTD	13,500	380.45	5,136,075.00	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	135,600	2,230.65	302,476,140.00	
BAJAJ FINANCE LTD	20,940	7,138.10	149,471,814.00	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	28,600	720.55	20,607,730.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,333.40	13,334,000.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	13,100	795.75	10,424,325.00	

		SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,700	1,150.85	18,068,345.00	
		HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,800	2,092.75	10,045,200.00	
		ADANI GREEN ENERGY LTD	33,000	2,811.50	92,779,500.00	
		NTPC LIMITED	396,000	162.70	64,429,200.00	
		DIVIS LABORATORIES LTD	9,700	4,529.05	43,931,785.00	
		DLF LIMITED	58,000	389.85	22,611,300.00	
		GODREJ PROPERTIES LTD	9,300	1,593.90	14,823,270.00	
		INFO EDGE INDIA LTD	6,670	4,632.05	30,895,773.50	
	小計	銘柄数：105			5,694,779,390.50	
		組入時価比率：13.1%			(9,681,124,963)	14.4%
カタールリヤル		QATAR FUEL CO	34,700	18.71	649,237.00	
		QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	220,000	3.53	776,600.00	
		MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.77	844,850.00	
		INDUSTRIES QATAR	143,000	20.20	2,888,600.00	
		COMMERCIAL BANK OF QATAR	184,000	7.50	1,380,000.00	
		MASRAF AL RAYAN	381,000	5.74	2,189,988.00	
		QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	12.36	580,920.00	
		QATAR ISLAMIC BANK	83,900	25.27	2,120,153.00	
		QATAR NATIONAL BANK	347,000	23.30	8,085,100.00	
		OOREDOO QSC	43,100	7.14	308,078.80	
		QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	17.95	617,480.00	
		BARWA REAL ESTATE CO	195,000	3.50	682,695.00	
	小計	銘柄数：12			21,123,701.80	
		組入時価比率：1.0%			(745,032,962)	1.1%
エジプトポンド		EASTERN TOBACCO	51,525	11.01	567,290.25	
		COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	121,733	42.00	5,112,786.00	
		FAWRY FOR BANKING & -RIGHTS	34,674	4.06	140,776.44	
		FAWRY FOR BANKING & PAYMENT	37,000	4.88	180,560.00	
	小計	銘柄数：4			6,001,412.69	
		組入時価比率：0.1%			(41,518,373)	0.1%
ランド		EXXARO RESOURCES LTD	15,000	227.80	3,417,000.00	
		SASOL LTD	43,800	385.26	16,874,388.00	
		AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	248.23	1,737,610.00	

ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,881.08	7,731,238.80	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	35,000	335.78	11,752,300.00	
GOLD FIELDS LTD	71,600	220.46	15,784,936.00	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	67.14	2,739,312.00	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	65,200	222.35	14,497,220.00	
KUMBA IRON ORE LTD	3,900	578.56	2,256,384.00	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	26,700	192.41	5,137,347.00	
SIBANYE STILLWATER LTD	205,000	58.30	11,951,500.00	
BIDVEST GROUP LTD	25,500	222.16	5,665,080.00	
NASPERS LTD-N SHS	16,790	1,474.23	24,752,321.70	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	94,000	58.53	5,501,820.00	
MR PRICE GROUP LTD	16,700	217.03	3,624,401.00	
PEPKOR HOLDINGS LTD	96,000	21.58	2,071,680.00	
BID CORP LTD	27,300	329.38	8,992,074.00	
CLICKS GROUP LTD	18,300	313.06	5,728,998.00	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,600	235.10	9,309,960.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	164.69	2,519,757.00	
TIGER BRANDS LTD	12,800	154.00	1,971,200.00	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	31,500	177.74	5,598,810.00	
ABSA GROUP LTD	55,200	168.45	9,298,440.00	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,490	2,144.56	13,918,194.40	
NEDBANK GROUP LTD	35,779	221.28	7,917,177.12	
STANDARD BANK GROUP LTD	105,800	170.36	18,024,088.00	
FIRSTRAND LTD	410,000	69.53	28,507,300.00	
REMGRO LTD	47,300	145.68	6,890,664.00	
DISCOVERY LTD	46,906	166.00	7,786,396.00	
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	20,159	16.62	335,042.58	
OLD MUTUAL LTD	294,000	12.29	3,613,260.00	
SANLAM LIMITED	149,000	69.29	10,324,210.00	
MTN GROUP LTD	133,000	172.39	22,927,870.00	
VODACOM GROUP	51,700	148.04	7,653,668.00	
REINET INVESTMENTS SCA	8,790	332.41	2,921,883.90	
NEPI ROCKCASTLE PLC	41,900	96.09	4,026,171.00	
MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	129.08	3,441,272.80	
小計銘柄数：37			317,200,975.30	

				(2,645,456,134)	
	組入時価比率：3.6%			3.9%	
U A Eディールハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	179,000	4.07	728,530.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	237,870	10.14	2,412,001.80	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	128,000	8.91	1,140,480.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	214,029	6.25	1,337,681.25	
	EMIRATES NBD PJSC	197,000	15.00	2,955,000.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	357,125	22.88	8,171,020.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	274,900	35.10	9,648,990.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	5.37	1,487,490.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	290,000	6.29	1,824,100.00	
	小計 銘柄数：9			29,705,293.05 (1,042,061,680)	
	組入時価比率：1.4%			1.5%	
クウェートディナール	AGILITY	112,000	1.23	138,208.00	
	BOUBAYAN BANK K.S.C	74,970	0.90	67,922.82	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	421,300	0.98	412,874.00	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	555,450	1.04	579,334.35	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	189,000	0.65	123,039.00	
	MABANEE CO SAKC	40,449	0.85	34,381.65	
	小計 銘柄数：6			1,355,759.82 (572,049,298)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
サウジアラビアリヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	29.40	282,240.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	169,000	43.00	7,267,000.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	10,833	70.40	762,643.20	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	22.16	620,480.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	16,600	172.00	2,855,200.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	57.00	1,670,100.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	71,100	125.60	8,930,160.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	29,368	35.80	1,051,374.40	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	67,000	20.66	1,384,220.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,900	60.10	1,195,990.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	35,100	137.00	4,808,700.00	

	JARIR MARKETING CO	3,730	198.80	741,524.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	3,700	111.80	413,660.00	
	ALMARAI CO	18,000	51.00	918,000.00	
	SAVOLA	16,600	36.60	607,560.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	5,100	199.40	1,016,940.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,400	241.00	819,400.00	
	AL RAJHI BANK	97,700	179.80	17,566,460.00	
	ALINMA BANK	81,000	40.65	3,292,650.00	
	ARAB NATIONAL BANK	47,800	32.00	1,529,600.00	
	BANK AL - JAZIRA	34,100	30.60	1,043,460.00	
	BANK ALBILAD	42,666	51.10	2,180,232.60	
	BANQUE SAUDI FRANSI	49,200	55.00	2,706,000.00	
	RIYAD BANK	111,800	39.70	4,438,460.00	
	SAUDI BRITISH BANK	61,100	44.35	2,709,785.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	172,100	73.10	12,580,510.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	3,900	166.80	650,520.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	68.40	184,680.00	
	SAUDI TELECOM CO	48,100	114.00	5,483,400.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	23,900	41.30	987,070.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	13.76	399,040.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	26.85	1,562,670.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	53,000	11.12	589,360.00	
	EMAAR ECONOMIC CITY	35,000	11.22	392,700.00	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	2,800	260.00	728,000.00	
	小計 銘柄数：35			94,369,789.20	
				(3,242,545,956)	
	組入時価比率：4.4%			4.8%	
	合計			67,394,595,978	
				(67,394,595,978)	

(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(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	4,381,400	22,235,605.00	
	小計	銘柄数：1	4,381,400	22,235,605.00	
		組入時価比率：3.9%		(2,860,610,583) 97.0%	
	合計			2,860,610,583 (2,860,610,583)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	234,000	5,623,020.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	111,000	2,833,830.00	
		銘柄数：2	345,000	8,456,850.00	
		組入時価比率：0.1%		(53,861,677) 1.8%	
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	300,000	4,191,000.00	
		銘柄数：1	300,000	4,191,000.00	
		組入時価比率：0.0%		(34,952,940) 1.2%	
	合計			88,814,617 (88,814,617)	
合計				2,949,425,200 (2,949,425,200)	

(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	2022年 4月22日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	3,528,081,518	—	3,460,840,666	△67,240,852
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	64,330,180	—	64,320,150	△10,030
米ドル	64,330,180	—	64,320,150	△10,030

合計	—	—	—	△67,250,882

(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。

米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	348,179,113
コール・ローン	319,514,049
株式	65,998,699,075
投資信託受益証券	587,724,660
投資証券	3,338,237,062
派生商品評価勘定	239,767
未収配当金	67,846,141
差入委託証拠金	84,287,547
流動資産合計	70,744,727,414
資産合計	70,744,727,414
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	181,569
未払金	230,098,630
未払解約金	130,494,782
未払利息	95
その他未払費用	714,000
流動負債合計	361,489,076
負債合計	361,489,076
純資産の部	
元本等	
元本	31,682,546,892

(2022年 4月22日現在)

剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	38,700,691,446
元本等合計	70,383,238,338
純資産合計	70,383,238,338
負債純資産合計	70,744,727,414

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）

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2,2215円
(10,000口当たり純資産額)	(22,215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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考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

2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（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

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	19,823,986,968円
同期中における追加設定元本額	14,104,050,504円
同期中における一部解約元本額	2,245,490,580円
期末元本額	31,682,546,892円
期末元本額の内訳＊	
野村インデックスファンド・米国株式配当貴族	9,932,308,601円
野村インデックスファンド・米国株式配当貴族・為替ヘッジ型	2,439,804,012円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	4,322,216円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,999,965円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	21,601,588円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	5,723,021円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	22,951,806円
米国株式配当貴族・為替ヘッジあり型（投資一任サービス向け）	402,329,563円
米国株式配当貴族・為替ヘッジなし型（投資一任サービス向け）	599,244,181円
米国株式配当貴族（年4回決算型）	18,251,261,939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(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	CHEVRON CORP	64,010	164.58	10,534,765.80	
		EXXON MOBIL CORP	111,840	87.03	9,733,435.20	
		AIR PRODUCTS	28,780	251.14	7,227,809.20	

ALBEMARLE CORP	38,410	207.24	7,960,088.40	
ECOLAB INC	42,260	180.02	7,607,645.20	
LINDE PLC	25,750	324.37	8,352,527.50	
PPG INDUSTRIES	52,510	133.15	6,991,706.50	
SHERWIN-WILLIAMS	27,270	251.61	6,861,404.70	
AMCOR PLC	682,900	11.93	8,146,997.00	
NUCOR CORP	85,410	175.59	14,997,141.90	
GENERAL DYNAMICS	39,310	242.06	9,515,378.60	
SMITH (A.O.) CORP	103,330	66.30	6,850,779.00	
EMERSON ELEC	87,500	96.71	8,462,125.00	
3M CORP	47,110	151.77	7,149,884.70	
ROPER TECHNOLOGIES INC	18,740	469.28	8,794,307.20	
CATERPILLAR INC DEL	37,980	232.57	8,833,008.60	
DOVER CORP	46,870	144.16	6,756,779.20	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	34,220	208.29	7,127,683.80	
PENTAIR PLC	124,720	53.39	6,658,800.80	
STANLEY BLACK & DECKER INC	45,570	144.25	6,573,472.50	
GRAINGER(W.W.) INC	16,480	511.99	8,437,595.20	
CINTAS CORP	21,070	418.89	8,826,012.30	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	68,830	99.53	6,850,649.90	
V F CORP	119,720	56.49	6,762,982.80	
MCDONALD'S CORP	32,100	255.25	8,193,525.00	
GENUINE PARTS CO	60,310	138.13	8,330,620.30	
TARGET CORP	36,910	248.17	9,159,954.70	
LOWES COS INC	35,040	205.03	7,184,251.20	
SYSCO CORP	105,490	89.74	9,466,672.60	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	155,400	46.81	7,274,274.00	
WALMART INC	58,060	159.87	9,282,052.20	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	123,030	68.82	8,466,924.60	
COCA COLA CO	135,770	66.21	8,989,331.70	
PEPSICO INC	46,970	174.84	8,212,234.80	
ARCHER DANIELS MIDLAND	118,690	96.05	11,400,174.50	
HORMEL FOODS CORP	166,100	54.81	9,103,941.00	
MCCORMICK & CO INC.	86,450	104.28	9,015,006.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	79,480	102.96	8,183,260.80	

		CLOROX CO	46,010	148.15	6,816,381.50	
		COLGATE PALMOLIVE CO.	97,290	82.10	7,987,509.00	
		KIMBERLY-CLARK CORP	57,410	128.10	7,354,221.00	
		PROCTER & GAMBLE CO	50,470	162.61	8,206,926.70	
		ABBOTT LABORATORIES	65,750	123.37	8,111,577.50	
		BECTON, DICKINSON	32,040	264.89	8,487,075.60	
		MEDTRONIC PLC	78,120	113.09	8,834,590.80	
		CARDINAL HEALTH INC	160,220	63.75	10,214,025.00	
		ABBVIE INC	61,600	158.52	9,764,832.00	
		JOHNSON & JOHNSON	49,950	183.36	9,158,832.00	
		AFLAC INC	132,410	65.50	8,672,855.00	
		BROWN & BROWN INC	126,000	70.68	8,905,680.00	
		CHUBB LTD	41,560	211.53	8,791,186.80	
		CINCINNATI FINANCIAL CORP	69,480	140.28	9,746,654.40	
		AUTOMATIC DATA PROCESS	37,300	230.18	8,585,714.00	
		INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	63,190	139.85	8,837,121.50	
		NEXTERA ENERGY INC	99,370	76.18	7,570,006.60	
		ATMOS ENERGY CORP	79,560	121.16	9,639,489.60	
		CONSOLIDATED EDISON INC	99,290	98.19	9,749,285.10	
		FRANKLIN RESOURCES INC	256,900	26.48	6,802,712.00	
		S&P GLOBAL INC	19,480	390.83	7,613,368.40	
		T ROWE PRICE GROUP INC	51,100	139.58	7,132,538.00	
		WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	21,230	365.14	7,751,922.20	
	小計	銘柄数：61			513,009,709.10	
					(65,998,699,075)	
		組入時価比率：93.8%			100.0%	
	合計				65,998,699,075	
					(65,998,699,075)	

(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(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考

投資信託受益証券	米ドル	PROSHARES S&P 500 DIV ARISTO CRATS ETF	47,000	4,568,400.00	
	小計	銘柄数：1	47,000	4,568,400.00	
		組入時価比率：0.8%		(587,724,660)	15.0%
	合計			587,724,660	(587,724,660)
投資証券	米ドル	ESSEX PROPERTY TRUST INC	24,450	8,785,129.50	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	66,170	8,290,439.30	
		REALTY INCOME CORP	119,000	8,872,640.00	
		銘柄数：3	209,620	25,948,208.80	
		組入時価比率：4.7%		(3,338,237,062)	85.0%
	合計			3,338,237,062	(3,338,237,062)
合計				3,925,961,722	(3,925,961,722)

(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	2022年 4月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	423,507,759	—	423,628,368	120,609
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	217,926,150	—	218,045,308	119,158
米ドル	217,926,150	—	218,045,308	119,158
売建	55,391,040	—	55,572,609	△181,569
米ドル	55,391,040	—	55,572,609	△181,569
合計	—	—	—	58,198

(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)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,915,794,633
国債証券	676,685,292,900
地方債証券	57,189,124,635
特殊債券	66,589,928,371
社債券	41,444,620,550
未収利息	1,138,095,867
前払費用	24,995,606
流動資産合計	849,987,852,562
資産合計	849,987,852,562
負債の部	
流動負債	
未払金	2,939,136,000
未払解約金	131,670,956
未払利息	2,070
流動負債合計	3,070,809,026
負債合計	3,070,809,026
純資産の部	
元本等	
元本	650,828,063,443
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	196,088,980,093
元本等合計	846,917,043,536
純資産合計	846,917,043,536

(2022年 4月22日現在)

負債純資産合計

849,987,852,562

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)

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3013円
(10,000口当たり純資産額)	(13,013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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	563,104,904,297円
同期中における追加設定元本額	144,427,617,992円
同期中における一部解約元本額	56,704,458,846円
期末元本額	650,828,063,443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	399,864,673円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	42,644,256,745円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	18,463,963,660円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,790,118,595円
野村資産設計ファンド2015	349,570,519円
野村資産設計ファンド2020	357,964,867円
野村資産設計ファンド2025	367,067,036円
野村資産設計ファンド2030	311,026,314円
野村資産設計ファンド2035	166,683,789円
野村資産設計ファンド2040	221,230,329円
野村日本債券インデックスファンド	761,084,977円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	159,331,898,133円
のむラップ・ファンド（保守型）	16,601,403,817円
のむラップ・ファンド（普通型）	22,933,076,149円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,853,484,595円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）	10,169,592,878円
野村資産設計ファンド2045	27,742,252円
野村円債投資インデックスファンド	719,326,480円
野村インデックスファンド・国内債券	1,905,217,198円
マイ・ロード	36,144,909,150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	1,612,071,421円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	21,928,259,770円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	2,372,693,668円
野村資産設計ファンド2050	26,034,989円

野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	31,801,029円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	9,165,286円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	4,650,206円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,055,689円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	1,517,082,765円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	600,968,777円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	81,901,098円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	33,462,444円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	162,188,439円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	25,895,984円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	28,699,235円
野村6資産均等バランス	4,592,263,687円
世界6資産分散ファンド	130,431,439円
野村資産設計ファンド2060	13,169,964円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	39,991,092,285円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	31,327,023,046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）	537,478,301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）	89,717,203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）	1,659,394,763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）	732,584,888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）	17,627,395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）	11,176,130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）	756,745円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,573,706,703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）	6,971,126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）	53,963,051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）	41,853,825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）	381,120,300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）	303,131,929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）	964,134,646円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	143,070,889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）	1,597,018,645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）	342,627,327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）	16,008,647円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	38,161,077,860円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	51,827,622,695円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	19,899,118,255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）	51,949,192,380円
マイバランスDC30	14,482,658,356円
マイバランスDC50	12,168,089,139円
マイバランスDC70	4,427,526,951円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	13,525,360,523円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,448,258,710円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	3,849,256,913円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	1,781,714,295円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	237,580,522円

野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	36,384,481円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	42,950,834円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	90,717,530円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	36,208,034円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	13,656,470円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	1,233,783,575円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	625,721,048円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	235,383,008円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	311,427,766円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	6,131,717円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	77,905,664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）	548,646,243円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	327,954,584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(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付（２年）第４２４回	2,600,000,000	2,602,496,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２６回	1,500,000,000	1,501,590,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２７回	6,800,000,000	6,807,752,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２８回	2,400,000,000	2,402,904,000	
		国庫債券 利付（２年）第４２９回	1,500,000,000	1,501,935,000	
		国庫債券 利付（２年）第４３１回	3,000,000,000	3,004,080,000	
		国庫債券 利付（２年）第４３２回	1,500,000,000	1,502,025,000	
		国庫債券 利付（２年）第４３３回	3,500,000,000	3,504,655,000	
		国庫債券 利付（２年）第４３４回	3,000,000,000	3,004,140,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３６回	4,300,000,000	4,309,159,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３７回	6,600,000,000	6,617,160,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３８回	7,100,000,000	7,120,519,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３９回	6,700,000,000	6,721,038,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４０回	5,100,000,000	5,117,034,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４１回	9,600,000,000	9,634,656,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４２回	1,200,000,000	1,204,776,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４３回	6,070,000,000	6,095,554,700	
		国庫債券 利付（５年）第１４４回	4,400,000,000	4,419,448,000	

国庫債券 利付（５年）第１４５回	3,900,000,000	3,917,940,000	
国庫債券 利付（５年）第１４６回	2,100,000,000	2,109,975,000	
国庫債券 利付（５年）第１４７回	5,600,000,000	5,606,552,000	
国庫債券 利付（５年）第１４８回	7,300,000,000	7,307,519,000	
国庫債券 利付（５年）第１４９回	7,100,000,000	7,104,686,000	
国庫債券 利付（５年）第１５０回	4,000,000,000	4,000,920,000	
国庫債券 利付（４０年）第１回	2,860,000,000	3,821,303,200	
国庫債券 利付（４０年）第２回	900,000,000	1,163,475,000	
国庫債券 利付（４０年）第３回	900,000,000	1,170,054,000	
国庫債券 利付（４０年）第４回	1,630,000,000	2,120,858,200	
国庫債券 利付（４０年）第５回	1,200,000,000	1,503,912,000	
国庫債券 利付（４０年）第６回	1,300,000,000	1,602,679,000	
国庫債券 利付（４０年）第７回	1,400,000,000	1,657,054,000	
国庫債券 利付（４０年）第８回	1,500,000,000	1,656,735,000	
国庫債券 利付（４０年）第９回	3,550,000,000	2,914,763,000	
国庫債券 利付（４０年）第１０回	2,010,000,000	1,932,976,800	
国庫債券 利付（４０年）第１１回	1,750,000,000	1,629,547,500	
国庫債券 利付（４０年）第１２回	2,070,000,000	1,734,887,700	
国庫債券 利付（４０年）第１３回	7,020,000,000	5,854,118,400	
国庫債券 利付（４０年）第１４回	4,460,000,000	3,973,949,200	
国庫債券 利付（１０年）第３２９回	6,000,000,000	6,061,260,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,847,310,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,918,297,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３２回	5,900,000,000	5,965,962,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３３回	3,600,000,000	3,645,540,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３４回	6,600,000,000	6,693,192,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３５回	4,600,000,000	4,660,904,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３６回	2,750,000,000	2,790,205,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３７回	3,000,000,000	3,027,900,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３８回	9,000,000,000	9,116,280,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３９回	5,000,000,000	5,069,450,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４０回	2,700,000,000	2,740,041,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４１回	5,800,000,000	5,870,006,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４２回	6,550,000,000	6,581,964,000	

国庫債券 利付（１０年）第３４３回	9,500,000,000	9,547,310,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４４回	6,400,000,000	6,430,976,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４５回	7,000,000,000	7,032,550,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４６回	7,600,000,000	7,631,616,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４７回	5,400,000,000	5,419,440,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４８回	5,800,000,000	5,817,168,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４９回	2,800,000,000	2,806,300,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５０回	10,150,000,000	10,161,875,500	
国庫債券 利付（１０年）第３５１回	6,000,000,000	6,001,800,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５２回	6,400,000,000	6,395,904,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５３回	1,200,000,000	1,197,624,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５４回	1,850,000,000	1,843,673,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５５回	3,400,000,000	3,381,980,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５６回	4,800,000,000	4,768,416,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５７回	1,900,000,000	1,884,952,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５８回	5,470,000,000	5,423,231,500	
国庫債券 利付（１０年）第３５９回	10,600,000,000	10,502,268,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６０回	10,900,000,000	10,787,512,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６１回	8,400,000,000	8,303,736,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６２回	8,500,000,000	8,396,215,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６３回	10,450,000,000	10,314,254,500	
国庫債券 利付（１０年）第３６４回	8,650,000,000	8,534,609,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６５回	7,500,000,000	7,393,875,000	
国庫債券 利付（３０年）第１回	500,000,000	595,950,000	
国庫債券 利付（３０年）第２回	500,000,000	584,970,000	
国庫債券 利付（３０年）第３回	160,000,000	186,678,400	
国庫債券 利付（３０年）第４回	1,400,000,000	1,717,128,000	
国庫債券 利付（３０年）第５回	150,000,000	176,328,000	
国庫債券 利付（３０年）第６回	600,000,000	721,950,000	

国庫債券	利付（３０年）第７回	600,000,000	720,444,000	
国庫債券	利付（３０年）第８回	100,000,000	115,438,000	
国庫債券	利付（３０年）第９回	265,000,000	294,791,300	
国庫債券	利付（３０年）第１０回	250,000,000	270,397,500	
国庫債券	利付（３０年）第１１回	160,000,000	183,579,200	
国庫債券	利付（３０年）第１２回	220,000,000	262,655,800	
国庫債券	利付（３０年）第１３回	290,000,000	343,580,400	
国庫債券	利付（３０年）第１４回	800,000,000	987,376,000	
国庫債券	利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,124,262,000	
国庫債券	利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,146,165,600	
国庫債券	利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,491,768,000	
国庫債券	利付（３０年）第１８回	2,200,000,000	2,714,470,000	
国庫債券	利付（３０年）第１９回	2,050,000,000	2,535,132,500	
国庫債券	利付（３０年）第２０回	1,270,000,000	1,606,257,900	
国庫債券	利付（３０年）第２１回	300,000,000	372,594,000	
国庫債券	利付（３０年）第２２回	600,000,000	762,912,000	
国庫債券	利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,070,546,400	
国庫債券	利付（３０年）第２４回	700,000,000	893,529,000	
国庫債券	利付（３０年）第２５回	500,000,000	625,450,000	
国庫債券	利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,076,950,000	
国庫債券	利付（３０年）第２７回	3,550,000,000	4,562,282,500	
国庫債券	利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,546,680,000	
国庫債券	利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	1,916,130,000	
国庫債券	利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,150,075,000	
国庫債券	利付（３０年）第３１回	1,200,000,000	1,501,392,000	
国庫債券	利付（３０年）第３２回	1,700,000,000	2,156,705,000	
国庫債券	利付（３０年）第３３回	2,400,000,000	2,925,384,000	
国庫債券	利付（３０年）第３４回	3,300,000,000	4,143,579,000	
国庫債券	利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	2,808,415,000	
国庫債券	利付（３０年）第３６回	2,000,000,000	2,441,360,000	
国庫債券	利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	2,768,073,000	
国庫債券	利付（３０年）第３８回	1,600,000,000	1,898,400,000	
国庫債券	利付（３０年）第３９回	1,400,000,000	1,689,310,000	
国庫債券	利付（３０年）第４０回	1,300,000,000	1,544,634,000	
国庫債券	利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	1,754,025,000	
国庫債券	利付（３０年）第４２回	1,600,000,000	1,871,840,000	
国庫債券	利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,521,598,000	
国庫債券	利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,639,386,000	
国庫債券	利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	1,920,847,000	
国庫債券	利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,034,018,000	
国庫債券	利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	1,956,122,000	
国庫債券	利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,108,107,000	

国庫債券	利付（３０年）第４９回	2,900,000,000	3,217,289,000
国庫債券	利付（３０年）第５０回	2,400,000,000	2,352,768,000
国庫債券	利付（３０年）第５１回	2,650,000,000	2,309,316,000
国庫債券	利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	1,734,035,000
国庫債券	利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,585,879,000
国庫債券	利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,656,990,000
国庫債券	利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,460,235,000
国庫債券	利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	1,847,332,000
国庫債券	利付（３０年）第５７回	1,600,000,000	1,552,080,000
国庫債券	利付（３０年）第５８回	2,100,000,000	2,034,522,000
国庫債券	利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,509,872,000
国庫債券	利付（３０年）第６０回	1,150,000,000	1,136,660,000
国庫債券	利付（３０年）第６１回	1,500,000,000	1,409,745,000
国庫債券	利付（３０年）第６２回	1,500,000,000	1,336,755,000
国庫債券	利付（３０年）第６３回	1,400,000,000	1,210,272,000
国庫債券	利付（３０年）第６４回	2,500,000,000	2,154,150,000
国庫債券	利付（３０年）第６５回	2,200,000,000	1,893,518,000
国庫債券	利付（３０年）第６６回	2,600,000,000	2,237,716,000
国庫債券	利付（３０年）第６７回	2,400,000,000	2,174,760,000
国庫債券	利付（３０年）第６８回	1,950,000,000	1,763,775,000
国庫債券	利付（３０年）第６９回	2,200,000,000	2,041,622,000
国庫債券	利付（３０年）第７０回	1,610,000,000	1,490,006,700
国庫債券	利付（３０年）第７１回	2,400,000,000	2,219,928,000
国庫債券	利付（３０年）第７２回	1,300,000,000	1,200,459,000
国庫債券	利付（３０年）第７３回	500,000,000	461,465,000
国庫債券	利付（２０年）第６２回	440,000,000	444,492,400
国庫債券	利付（２０年）第６３回	300,000,000	306,528,000
国庫債券	利付（２０年）第６４回	400,000,000	411,172,000
国庫債券	利付（２０年）第６５回	455,000,000	469,887,600
国庫債券	利付（２０年）第６６回	300,000,000	309,318,000
国庫債券	利付（２０年）第６７回	310,000,000	321,594,000
国庫債券	利付（２０年）第６８回	290,000,000	302,501,900
国庫債券	利付（２０年）第６９回	560,000,000	583,077,600
国庫債券	利付（２０年）第７０回	540,000,000	568,576,800
国庫債券	利付（２０年）第７１回	200,000,000	209,722,000
国庫債券	利付（２０年）第７２回	1,470,000,000	1,546,116,600
国庫債券	利付（２０年）第７３回	1,200,000,000	1,265,388,000
国庫債券	利付（２０年）第７４回	800,000,000	845,720,000
国庫債券	利付（２０年）第７５回	600,000,000	637,386,000
国庫債券	利付（２０年）第７６回	910,000,000	961,415,000
国庫債券	利付（２０年）第７７回	700,000,000	741,587,000
国庫債券	利付（２０年）第７８回	800,000,000	849,000,000
国庫債券	利付（２０年）第７９回	860,000,000	915,392,600

国庫債券 利付（２０年）第８０回	1,400,000,000	1,494,584,000	
国庫債券 利付（２０年）第８１回	360,000,000	384,976,800	
国庫債券 利付（２０年）第８２回	820,000,000	879,687,800	
国庫債券 利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,476,764,100	
国庫債券 利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,289,124,000	
国庫債券 利付（２０年）第８５回	400,000,000	433,192,000	
国庫債券 利付（２０年）第８６回	1,700,000,000	1,854,343,000	
国庫債券 利付（２０年）第８７回	500,000,000	543,445,000	
国庫債券 利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,206,073,000	
国庫債券 利付（２０年）第８９回	470,000,000	513,371,600	
国庫債券 利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,646,100,000	
国庫債券 利付（２０年）第９１回	250,000,000	275,452,500	
国庫債券 利付（２０年）第９２回	650,000,000	713,537,500	
国庫債券 利付（２０年）第９３回	300,000,000	329,166,000	
国庫債券 利付（２０年）第９４回	200,000,000	220,422,000	
国庫債券 利付（２０年）第９５回	100,000,000	111,680,000	
国庫債券 利付（２０年）第９６回	400,000,000	442,604,000	
国庫債券 利付（２０年）第９７回	300,000,000	334,860,000	
国庫債券 利付（２０年）第９８回	300,000,000	333,243,000	
国庫債券 利付（２０年）第９９回	1,100,000,000	1,226,808,000	
国庫債券 利付（２０年）第１００回	820,000,000	922,377,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０１回	250,000,000	284,150,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０２回	1,500,000,000	1,712,040,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０３回	600,000,000	681,144,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０４回	400,000,000	449,200,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,141,167,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０６回	400,000,000	453,316,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０７回	300,000,000	339,102,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,787,424,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,008,270,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,247,367,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１１回	800,000,000	915,096,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,046,240,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,280,620,000	

国庫債券 利付（２０年）第１１４回	1,700,000,000	1,944,987,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,151,650,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,271,611,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,607,522,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１８回	500,000,000	571,970,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１９回	800,000,000	902,320,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２０回	800,000,000	889,496,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２１回	1,200,000,000	1,367,496,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２２回	900,000,000	1,018,188,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２３回	1,500,000,000	1,739,490,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,151,170,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２５回	1,400,000,000	1,641,290,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２６回	1,200,000,000	1,385,868,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２７回	500,000,000	573,085,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２８回	800,000,000	919,768,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２９回	1,300,000,000	1,482,962,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３０回	1,700,000,000	1,944,817,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３１回	800,000,000	907,848,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,479,088,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３３回	1,400,000,000	1,606,080,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,610,434,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３５回	700,000,000	798,455,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３６回	700,000,000	791,686,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,141,310,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３８回	800,000,000	897,240,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３９回	1,000,000,000	1,131,430,000	
	2,300,000,000	2,627,543,000	

国庫債券 利付（２０年）第１４０回			
国庫債券 利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	2,974,270,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,096,556,500	
国庫債券 利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,475,279,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４４回	1,300,000,000	1,461,590,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,638,951,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,758,368,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４７回	4,000,000,000	4,557,320,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,371,845,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４９回	3,850,000,000	4,353,426,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５０回	3,330,000,000	3,727,968,300	
国庫債券 利付（２０年）第１５１回	2,500,000,000	2,739,250,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５２回	2,650,000,000	2,904,718,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５３回	1,600,000,000	1,774,384,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５４回	2,820,000,000	3,091,284,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５５回	5,350,000,000	5,724,821,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５６回	4,650,000,000	4,601,500,500	
国庫債券 利付（２０年）第１５７回	5,540,000,000	5,320,283,600	
国庫債券 利付（２０年）第１５８回	3,470,000,000	3,467,640,400	
国庫債券 利付（２０年）第１５９回	4,810,000,000	4,865,699,800	
国庫債券 利付（２０年）第１６０回	3,000,000,000	3,072,540,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６１回	3,100,000,000	3,123,839,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,709,639,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６３回	2,600,000,000	2,609,334,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,564,094,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,164,404,000	
	2,300,000,000	2,329,118,000	

		国庫債券 利付（２０年）第１６６回			
		国庫債券 利付（２０年）第１６７回	2,600,000,000	2,547,116,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６８回	2,700,000,000	2,595,213,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６９回	3,030,000,000	2,855,290,200	
		国庫債券 利付（２０年）第１７０回	2,800,000,000	2,630,292,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７１回	2,500,000,000	2,341,025,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７２回	3,840,000,000	3,648,000,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７３回	3,250,000,000	3,078,075,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７４回	3,970,000,000	3,748,275,500	
		国庫債券 利付（２０年）第１７５回	5,500,000,000	5,274,940,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７６回	6,020,000,000	5,756,504,600	
		国庫債券 利付（２０年）第１７７回	5,070,000,000	4,744,962,300	
		国庫債券 利付（２０年）第１７８回	3,750,000,000	3,567,000,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７９回	3,000,000,000	2,847,120,000	
		メキシコ合衆国 第１９回円貨社債（２０１４）	100,000,000	101,490,000	
		銘柄数：267	656,395,000,000	676,685,292,900	
		組入時価比率：79.9%		80.4%	
		小計			
		合計		676,685,292,900	
地方債証券	日本円	東京都 公募第７３１回	100,000,000	101,182,000	
		東京都 公募第７３６回	100,000,000	101,145,000	
		東京都 公募第７４５回	300,000,000	304,677,000	
		東京都 公募第７６０回	100,000,000	99,890,000	
		東京都 公募第７６１回	100,000,000	100,043,000	
		東京都 公募第７６９回	500,000,000	502,560,000	
		東京都 公募第７７８回	100,000,000	99,970,000	
		東京都 公募第７８４回	200,000,000	200,682,000	
		東京都 公募第８１３回	200,000,000	197,452,000	
		東京都 公募第８２２回	130,000,000	127,151,700	
		東京都 公募（３０年）第７回	100,000,000	128,098,000	
		東京都 公募第１０回	200,000,000	251,462,000	
		東京都 公募第１回	300,000,000	305,349,000	
		東京都 公募（２０年）第３回	200,000,000	208,560,000	
		東京都 公募第７回	100,000,000	107,203,000	

東京都	公募（２０年）第１３回	100,000,000	111,261,000	
東京都	公募（２０年）第１６回	200,000,000	223,522,000	
東京都	公募（２０年）第１７回	200,000,000	224,574,000	
東京都	公募（２０年）第２０回	180,000,000	203,814,000	
東京都	公募第２３回	100,000,000	115,226,000	
東京都	公募（２０年）第２６回	100,000,000	114,087,000	
東京都	公募（２０年）第２９回	200,000,000	225,166,000	
東京都	公募（５年）第３１回	300,000,000	299,868,000	
東京都	公募（５年）第３２回	300,000,000	299,817,000	
北海道	公募平成２６年度第１３回	100,000,000	101,153,000	
北海道	公募平成２７年度第７回	100,000,000	101,620,000	
北海道	公募平成２９年度第５回	200,000,000	200,670,000	
北海道	公募平成２９年度第７回	100,000,000	100,345,000	
北海道	公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,300,000	
北海道	公募平成３０年度第１５回	253,920,000	251,736,288	
北海道	公募平成３０年度第１８回	200,000,000	198,600,000	
北海道	公募令和２年度第４回	300,000,000	296,289,000	
宮城県	公募第３１回１号	300,000,000	304,788,000	
宮城県	公募第３２回２号	100,000,000	100,176,000	
神奈川県	公募第２００回	100,000,000	101,160,000	
神奈川県	公募第２０５回	100,000,000	101,237,000	
神奈川県	公募第２０６回	100,000,000	101,358,000	
神奈川県	公募第２０８回	100,000,000	101,136,000	
神奈川県	公募第２１０回	200,000,000	202,240,000	
神奈川県	公募第２１２回	100,000,000	101,115,000	
神奈川県	公募第２３１回	200,000,000	200,786,000	
神奈川県	公募第２４３回	200,000,000	196,700,000	
神奈川県	公募第２４７回	200,000,000	196,972,000	
神奈川県	公募（３０年）第３回	100,000,000	128,642,000	
神奈川県	公募第７回	300,000,000	331,377,000	
神奈川県	公募（２０年）第１４回	100,000,000	113,426,000	
神奈川県	公募（２０年）第１７回	200,000,000	229,770,000	
神奈川県	公募（２０年）第２６回	100,000,000	111,903,000	
大阪府	公募第３７８回	104,000,000	105,159,600	
大阪府	公募第３８１回	100,000,000	101,237,000	
大阪府	公募第３８２回	100,000,000	101,261,000	
大阪府	公募第３８３回	100,000,000	101,352,000	
大阪府	公募第３８４回	100,000,000	101,357,000	
大阪府	公募第３８７回	300,000,000	303,459,000	
大阪府	公募第３８９回	100,000,000	101,260,000	
大阪府	公募第３９６回	200,000,000	203,184,000	
大阪府	公募第４１７回	102,000,000	102,802,740	

大阪府 公募第4 2 3回	100,000,000	100,212,000	
大阪府 公募第4 2 9回	179,000,000	179,123,510	
大阪府 公募第4 5 2回	100,000,000	98,115,000	
大阪府 公募第4 6 7回	140,000,000	137,842,600	
大阪府 公募第4 6 9回	150,000,000	147,106,500	
大阪府 公募第5回	100,000,000	114,710,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	114,161,000	
大阪府 公募（5年）第1 7 3回	200,000,000	199,716,000	
大阪府 公募（5年）第1 7 4回	200,000,000	199,706,000	
大阪府 公募（5年）第1 7 8回	400,000,000	399,204,000	
大阪府 公募（5年）第1 8 4回	400,000,000	399,012,000	
大阪府 公募（5年）第1 9 0回	200,000,000	199,310,000	
京都府 公募平成2 5年度第1 5回	200,000,000	202,458,000	
京都府 公募平成2 6年度第5回	100,000,000	111,652,000	
京都府 公募平成2 6年度第7回	200,000,000	202,572,000	
京都府 公募（2 0年）平成2 7年度第5回	200,000,000	218,224,000	
京都府 公募（1 5年）平成2 7年度第8回	100,000,000	103,751,000	
京都府 公募（1 5年）平成2 8年度第2回	200,000,000	197,900,000	
京都府 公募（2 0年）平成2 8年度第5回	100,000,000	96,716,000	
京都府 公募平成2 9年度第4回	100,000,000	100,385,000	
兵庫県 公募平成2 6年度第1 7回	100,000,000	101,207,000	
兵庫県 公募平成2 9年度第2 2回	100,000,000	100,170,000	
兵庫県 公募（3 0年）第2回	200,000,000	253,556,000	
兵庫県 公募（1 5年）第1回	300,000,000	320,436,000	
兵庫県 公募（1 5年）第3回	200,000,000	212,792,000	
兵庫県 公募（1 2年）第3回	300,000,000	304,644,000	
兵庫県 公募（1 5年）第8回	100,000,000	105,791,000	
兵庫県 公募（1 5年）第1 1回	100,000,000	103,285,000	
兵庫県 公募第2回	100,000,000	111,993,000	
兵庫県 公募第9回	100,000,000	114,636,000	
兵庫県 公募（2 0年）第1 1回	200,000,000	224,910,000	
兵庫県 公募（2 0年）第1 4回	100,000,000	113,828,000	
兵庫県 公募（2 0年）第2 2回	100,000,000	111,017,000	
静岡県 公募平成2 5年度第5回	101,000,000	102,168,570	
静岡県 公募平成2 6年度第3回	165,000,000	167,263,800	
静岡県 公募平成2 6年度第8回	100,000,000	101,295,000	
静岡県 公募平成2 6年度第9回	200,000,000	202,624,000	
静岡県 公募平成2 7年度第1 1回	115,400,000	115,646,956	
静岡県 公募平成2 8年度第2回	300,000,000	300,291,000	
静岡県 公募平成2 9年度第3回	100,000,000	100,415,000	

静岡県	公募（３１年）第１回	174,000,000	172,284,360	
静岡県	公募（５年）令和３年度第２回	100,000,000	99,805,000	
静岡県	公募（５年）令和３年度第５回	300,000,000	299,313,000	
静岡県	公募（１５年）第２回	200,000,000	213,282,000	
静岡県	公募（１５年）第５回	200,000,000	211,256,000	
静岡県	公募（１５年）第９回	100,000,000	103,433,000	
静岡県	公募（２０年）第１１回	100,000,000	112,622,000	
静岡県	公募（２０年）第１４回	200,000,000	228,096,000	
静岡県	公募（２０年）第１８回	100,000,000	111,845,000	
静岡県	公募（２０年）第３０回	200,000,000	188,740,000	
愛知県	公募平成２０年度第８回	100,000,000	111,958,000	
愛知県	公募（２０年）平成２２年度第８回	200,000,000	225,878,000	
愛知県	公募（２０年）平成２４年度第４回	100,000,000	113,548,000	
愛知県	公募（１５年）平成２４年度第１４回	400,000,000	426,176,000	
愛知県	公募平成２４年度第１７回	100,000,000	114,997,000	
愛知県	公募（３０年）平成２５年度第８回	120,000,000	145,929,600	
愛知県	公募平成２６年度第８回	100,000,000	117,758,000	
愛知県	公募平成２６年度第１３回	100,000,000	110,601,000	
愛知県	公募平成２６年度第１７回	300,000,000	303,648,000	
愛知県	公募（１５年）平成２７年度第２回	300,000,000	310,449,000	
愛知県	公募平成２７年度第１５回	100,000,000	101,512,000	
愛知県	公募平成２９年度第８回	100,000,000	100,345,000	
愛知県	公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,080,000	
愛知県	公募平成３０年度第７回	200,000,000	199,812,000	
愛知県	公募令和３年度第１０回	200,000,000	199,426,000	
広島県	公募平成２５年度第３回	200,000,000	202,270,000	
広島県	公募平成２６年度第５回	109,650,000	110,542,551	
広島県	公募平成２６年度第７回	200,000,000	202,446,000	
広島県	公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,053,000	
広島県	公募平成２９年度第４回	211,300,000	212,119,844	
広島県	公募平成３０年度第６回	300,000,000	300,027,000	
広島県	公募令和２年度第２回	100,000,000	98,832,000	
広島県	公募令和２年度第７回	300,000,000	296,856,000	
埼玉県	公募平成２５年度第４回	100,000,000	101,142,000	
埼玉県	公募平成２５年度第６回	148,000,000	149,702,000	
埼玉県	公募平成２５年度第１０回	100,000,000	101,211,000	
埼玉県	公募平成２５年度第１１回	100,000,000	101,222,000	
埼玉県	公募平成２６年度第３回	100,000,000	101,342,000	

埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	202,544,000	
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	404,716,000	
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	101,118,000	
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	100,690,000	
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,957,000	
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	200,182,000	
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,046,000	
埼玉県	公募令和元年度第4回	100,000,000	98,523,000	
埼玉県	公募令和2年度第4回	300,000,000	296,058,000	
埼玉県	公募（15年）第1回	100,000,000	104,801,000	
埼玉県	公募（15年）第2回	200,000,000	208,980,000	
埼玉県	公募（15年）第3回	100,000,000	100,946,000	
埼玉県	公募（25年）第2回	200,000,000	196,308,000	
埼玉県	公募（30年）第9回	200,000,000	192,420,000	
埼玉県	公募（20年）第6回	100,000,000	113,050,000	
埼玉県	公募（20年）第16回	100,000,000	108,932,000	
埼玉県	公募（20年）第20回	100,000,000	100,346,000	
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,358,000	
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	305,130,000	
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,436,000	
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	106,515,000	
福岡県	公募（15年）平成27年度第1回	200,000,000	207,588,000	
福岡県	公募（15年）令和元年度第1回	100,000,000	97,439,000	
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回	100,000,000	128,996,000	
福岡県	公募（30年）平成26年度第1回	100,000,000	118,001,000	
福岡県	公募（30年・定時償還）平成29年度第2回	100,000,000	98,511,000	
福岡県	公募（20年）平成20年度第1回	300,000,000	338,694,000	
福岡県	公募（20年）平成20年度第2回	100,000,000	112,024,000	
福岡県	公募（20年）平成22年度第1回	300,000,000	335,559,000	
福岡県	公募（20年）平成22年度第2回	300,000,000	346,263,000	
福岡県	公募（20年）平成24年度第2回	100,000,000	112,873,000	
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	101,035,000	
千葉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	101,150,000	
千葉県	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,319,000	
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	202,620,000	
千葉県	公募平成27年度第6回	200,000,000	203,074,000	
千葉県	公募平成28年度第4回	200,000,000	200,176,000	

千葉県 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,053,000	
千葉県 公募平成29年度第8回	100,000,000	100,146,000	
千葉県 公募令和元年度第6回	300,000,000	296,352,000	
千葉県 公募（20年）第1回	400,000,000	429,372,000	
千葉県 公募（20年）第8回	100,000,000	114,766,000	
千葉県 公募（20年）第13回	200,000,000	226,852,000	
千葉県 公募（20年）第16回	200,000,000	225,498,000	
千葉県 公募（20年）第17回	100,000,000	111,069,000	
新潟県 公募平成30年度第2回	200,000,000	200,582,000	
新潟県 公募令和2年度第2回	120,000,000	118,088,400	
長野県 公募令和3年度第1回	300,000,000	296,331,000	
茨城県 公募令和3年度第3回	200,000,000	199,480,000	
群馬県 公募第12回	100,000,000	101,570,000	
群馬県 公募（5年）第13回	300,000,000	299,223,000	
群馬県 公募（20年）第3回	100,000,000	113,528,000	
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	189,055,642	
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	402,676,000	
共同発行市場地方債 公募第124回	300,000,000	303,414,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	101,150,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	700,000,000	707,315,000	
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	101,175,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	101,313,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	101,229,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	202,620,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	500,000,000	506,255,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	156,977,800	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	546,328,800	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,010,980,000	
共同発行市場地方債 公募第152回	400,000,000	406,400,000	
共同発行市場地方債 公募第154回	300,000,000	303,933,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	200,352,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	300,297,000	
	300,000,000	299,934,000	

共同発行市場地方債 公募第 1 6 1 回			
共同発行市場地方債 公募第 1 7 2 回	600,000,000	603,282,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 4 回	100,000,000	99,876,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 6 回	400,000,000	401,140,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 8 回	300,000,000	300,969,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 0 回	610,000,000	607,175,700	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 1 回	100,000,000	99,362,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 4 回	200,000,000	197,928,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 6 回	400,000,000	394,016,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 7 回	300,000,000	295,356,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 0 0 回	100,000,000	98,377,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 0 6 回	300,000,000	295,875,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 1 3 回	300,000,000	294,813,000	
共同発行市場地方債 公募第 2 1 5 回	400,000,000	393,588,000	
堺市 公募平成 2 2 年度第 1 回	100,000,000	113,780,000	
堺市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	114,671,000	
長崎県 公募令和元年度第 3 回	100,000,000	98,488,000	
島根県 公募（ 3 0 年）平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	98,371,000	
佐賀県 公募平成 2 8 年度第 1 回	100,000,000	100,045,000	
福島県 公募平成 2 6 年度第 1 回	200,000,000	202,418,000	
滋賀県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	101,037,000	
滋賀県 公募平成 2 6 年度第 1 回	142,000,000	143,716,780	
栃木県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	101,037,000	
熊本県 公募平成 2 8 年度第 2 回	132,000,000	131,969,640	
熊本市 公募平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	100,222,000	
新潟市 公募平成 2 5 年度第 1 回	233,200,000	235,984,408	
新潟市 公募平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	100,309,000	
浜松市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	100,824,000	
大阪市 公募平成 2 5 年度第 6 回	100,000,000	101,095,000	
大阪市 公募平成 2 6 年度第 5 回	100,000,000	101,356,000	
大阪市 公募平成 2 7 年度第 6 回	100,000,000	101,510,000	
大阪市 公募令和 2 年度第 2 回	300,000,000	295,878,000	
大阪市 公募令和 3 年度第 2 回	300,000,000	295,500,000	
大阪市 公募（ 1 5 年）第 1 回	100,000,000	107,175,000	

大阪市 公募（２０年）第１回	300,000,000	335,703,000	
大阪市 公募（２０年）第５回	100,000,000	114,380,000	
大阪市 公募（２０年）第６回	100,000,000	113,075,000	
大阪市 公募（２０年）第１７回	100,000,000	113,741,000	
大阪市 公募（２０年）第２６回	100,000,000	100,070,000	
名古屋市 公募第４８８回	300,000,000	304,110,000	
名古屋市 公募第４８９回	100,000,000	101,146,000	
名古屋市 公募第５０１回	200,000,000	200,376,000	
名古屋市 公募第５０３回	100,000,000	100,175,000	
名古屋市 公募第５０４回	200,000,000	200,182,000	
名古屋市 公募第５１１回	200,000,000	196,510,000	
名古屋市 公募第５１２回	300,000,000	296,172,000	
名古屋市 公募（１２年）第１回	200,000,000	206,276,000	
名古屋市 公募（１５年）第２回	100,000,000	104,531,000	
京都市 公募平成２９年度第１回	100,000,000	100,424,000	
京都市 公募平成２９年度第４回	101,280,000	101,714,491	
京都市 公募（２０年）第２回	100,000,000	107,048,000	
京都市 公募（２０年）第５回	200,000,000	221,262,000	
京都市 公募（２０年）第６回	100,000,000	112,047,000	
京都市 公募（２０年）第１３回	100,000,000	110,575,000	
京都市 公募（２０年）第１５回	200,000,000	197,360,000	
神戸市 公募平成２６年度第１７回	300,000,000	302,028,000	
神戸市 公募平成２８年度第１回	200,000,000	200,198,000	
神戸市 公募平成３０年度第２回	200,000,000	192,420,000	
横浜市 公募公債平成２５年度１回	200,000,000	201,414,000	
横浜市 公募公債平成２５年度５回	200,000,000	202,046,000	
横浜市 公募公債平成２６年度５回	200,000,000	202,302,000	
横浜市 公募平成２８年度第５回	300,000,000	302,091,000	
横浜市 公募平成２９年度第３回	100,000,000	100,501,000	
横浜市 公募２０１９年度第３回	200,000,000	196,604,000	
横浜市 公募（３０年）第２回	200,000,000	249,350,000	
横浜市 公募（２０年）第１１回	100,000,000	109,888,000	
横浜市 公募（２０年）第１８回	100,000,000	113,667,000	
横浜市 公募（２０年）第２６回	100,000,000	114,415,000	
横浜市 公募（２０年）第３０回	100,000,000	110,766,000	
札幌市 公募（１５年）平成２３年度第９回	200,000,000	213,542,000	
札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１回	100,000,000	114,430,000	
札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１１回	100,000,000	114,633,000	
札幌市 公募平成２６年度第４回	100,000,000	101,112,000	
札幌市 公募平成２６年度第９回	200,000,000	202,128,000	

		川崎市 公募（２０年）第１４回	100,000,000	114,225,000	
		川崎市 公募（２０年）第１７回	100,000,000	111,919,000	
		川崎市 公募（２０年）第１９回	100,000,000	110,599,000	
		川崎市 公募（３０年）第１１回	100,000,000	95,538,000	
		北九州市 公募（１０年）令和２年度第２回	200,000,000	196,376,000	
		北九州市 公募（２０年）第３回	200,000,000	223,484,000	
		北九州市 公募（２０年）第１４回	100,000,000	113,663,000	
		福岡市 公募（２０年）平成２１年度第３回	200,000,000	227,166,000	
		福岡市 公募（２０年）平成２３年度第４回	100,000,000	114,252,000	
		福岡市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	112,053,000	
		福岡市 公募平成２６年度第５回	100,000,000	101,280,000	
		福岡市 公募平成２６年度第８回	160,000,000	161,980,800	
		福岡市 公募（５年）２０２０年度第９回	300,000,000	299,502,000	
		広島市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	101,125,000	
		広島市 公募平成２７年度第２回	500,000,000	507,595,000	
		広島市 公募（１０年）平成３０年度第６回	241,000,000	239,558,820	
		千葉市 公募平成２６年度第２回	200,000,000	202,468,000	
		三重県 公募平成２８年度第１回	155,000,000	155,649,450	
		福井県 公募平成２７年度第４回	200,000,000	200,240,000	
		福井県 公募令和元年度第３回	200,000,000	196,506,000	
		徳島県 公募平成２９年度第２回	200,000,000	200,444,000	
		徳島県 公募平成３０年度第２回	300,000,000	300,969,000	
		山梨県 公募令和元年度第１回	100,000,000	98,252,000	
		岡山県 公募平成２８年度第２回	168,900,000	169,854,285	
		岡山県 公募令和２年度第３回	300,000,000	297,105,000	
		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	112,597,000	
		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	341,583,000	
		福岡北九州高速道路債券 第１１７回	100,000,000	112,151,000	
		福岡北九州高速道路債券 第１３６回	100,000,000	103,002,000	
	小計	銘柄数：307	55,428,320,000	57,189,124,635	
		組入時価比率：6.8%		6.8%	
	合計			57,189,124,635	
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	101,037,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第２回	191,000,000	193,041,790	
		新関西国際空港債券 政府保証第５回	117,000,000	117,430,560	

新関西国際空港社債 財投機関債第6回	300,000,000	322,887,000	
新関西国際空港社債 財投機関債第9回	100,000,000	106,401,000	
新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	105,448,000	
新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,052,000	
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	700,294,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	102,577,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	105,196,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第66回	400,000,000	400,476,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第78回	200,000,000	201,138,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第82回	100,000,000	100,752,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	301,383,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	200,000,000	199,692,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第101回	300,000,000	301,419,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第137回	400,000,000	399,532,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第138回	400,000,000	392,756,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第37回	400,000,000	400,648,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	300,588,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第52回	300,000,000	299,961,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第55回	300,000,000	297,855,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第1回	200,000,000	280,638,000	
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	126,355,000	
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	218,674,000	
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	110,019,000	
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	335,487,000	
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	282,272,000	
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	340,683,000	
	100,000,000	114,717,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回			
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	113,355,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	350,000,000	395,927,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	114,821,000	
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	101,073,000	
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	404,000,000	
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	101,274,000	
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	101,248,000	
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	202,246,000	
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	202,112,000	
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	202,618,000	
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	331,701,000	
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	111,971,000	
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	104,147,000	
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	107,470,000	
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	85,374,000	
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	99,354,000	
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	178,622,000	
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	113,586,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	227,384,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	227,820,000	
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	229,676,000	
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	228,926,000	
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	226,392,000	
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	122,659,000	
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	117,745,000	
	100,000,000	113,043,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回			
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	112,217,000	
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	358,104,000	
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	114,024,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第185回	200,000,000	228,852,000	
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	402,784,000	
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	1,010,770,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第196回	300,000,000	344,790,000	
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	275,176,960	
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	303,633,000	
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	138,727,570	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	745,000,000	754,498,750	
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	112,093,000	
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	115,864,000	
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	112,057,000	
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	304,248,000	
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	115,907,000	
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	192,509,900	
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	638,498,700	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	101,236,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	541,790,000	
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	202,580,000	
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	322,191,000	
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	405,156,000	
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	406,208,990	
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	150,939,600	
	200,000,000	198,706,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第296回			
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	100,140,000	
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	404,487,070	
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	100,180,000	
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	601,596,000	
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	99,891,000	
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	96,429,000	
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	501,595,000	
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	131,000,000	
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	99,907,000	
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	199,564,000	
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	100,245,000	
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	505,836,000	
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	128,235,000	
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	1,053,530,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	128,447,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年） 第1回	100,000,000	112,008,000	
地方公共団体金融機構債券（20年） 第1回	300,000,000	341,841,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	113,547,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	109,210,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	344,613,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第7回	300,000,000	344,382,000	
地方公共団体金融機構債券（20年） 第10回	300,000,000	334,677,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	103,639,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	102,342,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	106,620,000	
	100,000,000	106,629,000	

地方公共団体金融機構債券 F 1 2 4 回			
地方公共団体金融機構債券 F 1 3 2 回	500,000,000	516,990,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 2 回	100,000,000	102,537,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5 回	200,000,000	205,880,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7 回	100,000,000	105,841,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	105,065,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 8 回	500,000,000	503,350,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,135,460	
地方公共団体金融機構債券（2 0 年） 第 2 9 回	100,000,000	113,816,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	101,148,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	606,690,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	303,471,000	
地方公共団体金融機構債券（1 5 年） 第 2 回	200,000,000	212,060,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	598,966,680	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	117,561,360	
地方公共団体金融機構債券（2 0 年） 第 3 8 回	100,000,000	111,666,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回	300,000,000	317,220,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	101,291,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	101,285,000	
地方公共団体金融機構債券（2 0 年） 第 3 9 回	100,000,000	110,966,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	405,356,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	420,000,000	424,842,600	
地方公共団体金融機構債券（2 0 年） 第 4 3 回	100,000,000	107,929,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	191,910,600	
地方公共団体金融機構債券 第 7 4 回	300,000,000	304,593,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 7 回	100,000,000	101,530,000	
	509,000,000	515,561,010	

政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 8 回			
地方公共団体金融機構債券 第 7 9 回	400,000,000	406,300,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 0 回	300,000,000	303,309,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8 年) 第 5 回	500,000,000	501,760,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 3 回	116,000,000	115,953,600	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 9 1 回	300,000,000	300,486,000	
地方公共団体金融機構債券 第 9 5 回	200,000,000	200,846,000	
地方公共団体金融機構債券 第 1 0 1 回	400,000,000	401,968,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 0 8 回	157,000,000	156,904,230	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 0 回	100,000,000	99,814,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 3 回	110,000,000	110,276,100	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 9 回	116,000,000	114,594,080	
政保 地方公共団体金融機構債券 1 1 回	500,000,000	500,070,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 5 回財 投機関債	200,000,000	205,924,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 1 9 回 財投機関債	100,000,000	110,626,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 2 0 回 財投機関債	100,000,000	110,554,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 2 3 回 財投機関債	200,000,000	223,270,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 2 4 回 財投機関債	100,000,000	112,408,000	
公営企業債券 (2 0 年) 第 2 5 回 財投機関債	100,000,000	113,964,000	
首都高速道路 第 2 8 回	200,000,000	199,428,000	
阪神高速道路 第 2 5 回	100,000,000	99,805,000	
日本政策金融公庫債券 政府保証第 6 3 回	110,000,000	108,185,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 6 回	200,000,000	202,696,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 7 回	100,000,000	105,124,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 1 回	100,000,000	104,565,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 9 回	100,000,000	104,632,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 1 3 回	300,000,000	312,411,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 2 1 回	200,000,000	202,146,000	

都市再生債券 財投機関債第127回	100,000,000	100,000,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	106,945,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	363,902,400	
民間都市開発推進機構 政府保証第17回	400,000,000	401,844,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	162,780,740	
関西国際空港債券 政府保証第54回	300,000,000	341,160,000	
中部国際空港債券 政府保証第22回	300,000,000	300,117,000	
預金保険機構債券 政府保証第230回	600,000,000	601,440,000	
預金保険機構債券 政府保証第231回	300,000,000	300,735,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	400,000,000	442,404,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回	200,000,000	224,038,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	103,019,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	105,498,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	100,000,000	114,141,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	113,400,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	115,255,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	321,045,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	115,301,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第81回	100,000,000	114,378,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第85回	200,000,000	227,486,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	200,000,000	214,060,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第115回	100,000,000	114,085,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	100,000,000	114,428,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回	200,000,000	227,986,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	100,000,000	124,418,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回	200,000,000	210,466,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	100,000,000	106,658,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	106,091,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	450,000,000	457,051,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第188回	300,000,000	300,363,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	301,044,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第208回	200,000,000	201,008,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	99,713,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	130,396,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第301回	300,000,000	299,835,000	
成田国際空港 第17回	400,000,000	404,900,000	
成田国際空港 第19回	100,000,000	100,724,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第6回	200,000,000	212,602,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,150,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	300,522,000	
商工債券 利付第829回い号	200,000,000	200,174,000	
商工債券 利付第831回い号	200,000,000	199,952,000	
商工債券 利付第833回い号	100,000,000	99,862,000	
商工債券 利付第845回い号	300,000,000	299,892,000	
商工債券 利付第852回い号	100,000,000	99,755,000	
商工債券 利付第854回い号	400,000,000	398,728,000	
商工債券 利付第856回い号	200,000,000	199,340,000	
しんきん中金債券 利付第374回	300,000,000	299,379,000	
しんきん中金債券 利付第377回	100,000,000	99,720,000	
しんきん中金債券 利付第379回	400,000,000	398,752,000	
しんきん中金債券 利付第380回	100,000,000	99,639,000	
商工債券 利付（3年）第258回	100,000,000	99,887,000	
商工債券 利付（10年）第15回	200,000,000	202,410,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	200,000,000	229,630,000	
国際協力機構債券 第23回財投機 関債	100,000,000	101,191,000	
国際協力機構債券 第35回財投機 関債	100,000,000	100,082,000	
東日本高速道路 第61回	200,000,000	197,580,000	
東日本高速道路 第83回	200,000,000	199,626,000	
東日本高速道路 第86回	400,000,000	398,608,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	101,797,000	
中日本高速道路 第79回	300,000,000	299,928,000	
中日本高速道路 第86回	100,000,000	99,943,000	

中日本高速道路 第 8 9 回	100,000,000	99,836,000	
中日本高速道路 第 9 0 回	300,000,000	299,424,000	
中日本高速道路 第 9 1 回	200,000,000	199,472,000	
西日本高速道路 第 2 0 回	200,000,000	202,090,000	
西日本高速道路 第 2 2 回	400,000,000	405,404,000	
西日本高速道路 第 2 3 回	100,000,000	101,202,000	
西日本高速道路 第 3 0 回	300,000,000	300,975,000	
西日本高速道路 第 5 0 回	200,000,000	199,978,000	
西日本高速道路 第 6 4 回	200,000,000	199,428,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 5 7 回	300,000,000	302,853,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 2 回	100,000,000	101,147,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 8 回	200,000,000	202,494,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 9 回	100,000,000	110,956,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 7 1 回	500,000,000	506,295,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 9 0 回	300,000,000	295,635,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 1 3 5 回	300,000,000	294,828,000	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融公庫債券	31,266,000	31,538,014	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	21,532,000	21,786,292	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	24,668,000	25,290,620	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	44,292,000	44,768,581	
貸付債権担保第 4 4 回住宅金融公庫債券	42,340,000	43,041,573	
貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券	67,644,000	68,716,157	
貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券	11,847,000	12,099,459	
貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券	18,046,000	19,113,420	
貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援機構債券	60,078,000	63,308,994	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券	54,802,000	57,206,711	
貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券	65,118,000	68,425,343	
貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援機構債券	48,760,000	50,900,564	
貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券	32,450,000	34,167,254	
貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援機構債券	60,426,000	63,423,129	

貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	69,753,000	72,423,144	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	109,431,000	113,580,623	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	101,619,000	105,905,289	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	67,236,000	69,868,289	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	22,682,000	23,707,680	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	53,828,000	56,581,840	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	35,925,000	37,089,688	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	78,680,000	81,262,277	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	34,814,000	35,949,980	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	106,164,000	110,428,607	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	22,525,000	23,754,639	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	23,571,000	24,874,947	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	21,904,000	23,132,595	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	21,342,000	22,459,040	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	60,218,000	62,874,818	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	87,126,000	90,922,951	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	29,469,000	30,778,897	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	68,576,000	71,192,860	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	64,136,000	67,335,103	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	64,743,000	68,088,270	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	115,110,000	120,120,738	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	66,774,000	69,762,136	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	117,081,000	121,382,555	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	101,997,000	105,268,043	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	80,650,000	84,229,247	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	66,922,000	69,626,987	
	166,892,000	172,167,456	

貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援機構債券	287,161,000	295,827,518	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援機構債券	44,148,000	45,307,326	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援機構債券	45,386,000	46,626,399	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援機構債券	46,934,000	48,025,684	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援機構債券	98,514,000	100,115,837	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援機構債券	104,208,000	105,075,010	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援機構債券	54,545,000	55,604,263	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援機構債券	58,579,000	59,534,423	
貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援機構債券	174,099,000	177,798,603	
貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援機構債券	180,156,000	184,665,304	
貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券	121,376,000	124,253,824	
貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	58,657,000	59,928,683	
貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	59,995,000	61,462,477	
貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券	226,329,000	225,170,195	
貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	151,844,000	151,710,377	
貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	153,114,000	152,712,841	
貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	76,181,000	76,072,822	
貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	152,520,000	152,184,456	
貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	76,921,000	76,490,242	
貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	77,525,000	77,217,225	
貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	78,771,000	78,575,647	
貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	314,908,000	313,226,391	
貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	238,413,000	237,223,319	
貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	159,090,000	158,184,777	
貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	162,458,000	161,871,526	
	164,540,000	163,228,616	

		貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	82,762,000	82,084,179	
		貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	83,517,000	83,105,261	
		貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	83,787,000	82,987,672	
		貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	258,573,000	254,952,978	
		貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	257,484,000	253,946,169	
		貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	447,390,000	436,983,708	
		貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	181,060,000	178,409,281	
		貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	182,370,000	179,247,825	
		貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券	286,068,000	281,327,853	
		貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券	190,424,000	187,748,542	
		貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券	286,995,000	284,099,220	
		貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券	192,548,000	190,836,248	
		貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券	192,496,000	190,601,839	
		貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券	290,544,000	287,368,354	
		貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券	486,025,000	479,458,802	
		貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券	295,599,000	292,657,789	
		貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券	296,688,000	293,163,346	
		貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券	297,528,000	292,827,057	
		貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券	198,824,000	197,020,666	
		貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券	299,784,000	299,454,237	
		貸付債権担保第179回住宅金融支援機構債券	300,000,000	298,980,000	
		貸付債権担保第180回住宅金融支援機構債券	200,000,000	199,950,000	
	小計	銘柄数：328	64,361,275,000	66,589,928,371	
		組入時価比率：7.9%		7.9%	
	合計			66,589,928,371	
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	199,112,000	

フランス相互信用連合銀行（BFCM）第31回円貨社債	100,000,000	97,034,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	100,000,000	99,138,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第6回非上位円貨社債	200,000,000	202,664,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第4回非上位円貨社債	200,000,000	202,682,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第25回非上位円貨社債	200,000,000	196,484,000	
クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債（2014）	100,000,000	100,575,000	
クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債（2018）	100,000,000	99,705,000	
クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債（2018）	100,000,000	97,564,000	
マラヤン・バンキング・ベルハッド 第4回円貨社債（2019）	100,000,000	99,647,000	
スタンダード・チャータード 第3回円貨社債（2015）	100,000,000	100,231,000	
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	100,365,000	
エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	100,802,000	
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	100,264,000	
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	98,525,000	
サンタンデール銀行 第1回円貨社債	100,000,000	99,657,000	
フランス電力 第4回円貨社債（2017）	100,000,000	97,578,000	
現代キャピタル・サービス・インク 第15回円貨社債	200,000,000	198,934,000	
ビー・エヌ・ビー・パリバ 第1回円貨社債（2017）	100,000,000	100,471,000	
ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社	200,000,000	200,044,000	
オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債	200,000,000	199,980,000	
INPEX 第1回社債間限定同順位特約付	500,000,000	498,490,000	
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	197,712,000	
五洋建設 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,546,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,318,000	
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	294,759,000	
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	199,728,000	
	200,000,000	198,626,000	

明治ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付			
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	298,404,000	
コカ・コーラボトラーズジャパン 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,766,000	
コカ・コーラボトラーズジャパン 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,030,000	
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,178,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	99,595,000	
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	99,272,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,738,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	200,000,000	199,456,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,453,000	
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	99,899,000	
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	599,616,000	
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	198,998,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,051,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,484,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,214,000	
王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,054,000	
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	597,126,000	
日本製紙 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,817,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,842,000	
イビデン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,714,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,785,000	
三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,095,000	
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	196,724,000	
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	96,873,000	
ダイセル 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,584,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,671,000	

電通 第6回社債間限定同順位特約付	300,000,000	298,440,000	
武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付	200,000,000	194,998,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,882,000	
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	99,841,000	
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	196,678,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,919,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,632,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	95,632,000	
楽天 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,649,000	
出光興産 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,937,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,831,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	298,188,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位	100,000,000	99,744,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位	100,000,000	99,979,000	
三菱マテリアル 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,981,000	
住友金属鉱山 第33回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,792,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,960,000	
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,553,000	
日立建機 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,098,000	
荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,611,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,580,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,712,000	
パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,857,000	
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,827,000	
パナソニック 第22回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,446,000	
パナソニック 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,062,000	
ソニー 第32回	100,000,000	100,233,000	

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	99,004,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,764,000	
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	298,572,000	
J A三井リース 第8回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,223,000	
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	99,718,000	
トヨタ自動車 第26回社債間限定 同順位特約付	700,000,000	698,089,000	
トヨタ自動車 第27回社債間限定 同順位特約付	300,000,000	295,959,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	98,348,000	
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	100,360,000	
ニコン 第22回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,562,000	
丸紅 第113回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	98,037,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,752,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順 位特約付	200,000,000	205,676,000	
三井物産 第64回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	110,417,000	
三井物産 第71回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	105,083,000	
住友商事 第49回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	105,212,000	
住友商事 第53回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,847,000	
クレディセゾン 第50回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	101,464,000	
クレディセゾン 第65回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,847,000	
クレディセゾン 第76回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	97,966,000	
イオン 第20回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,312,000	
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	101,240,000	
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	100,075,000	
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	202,416,000	
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	111,468,000	
三菱東京UFJ銀行 第23回劣後 特約付	100,000,000	115,915,000	
	100,000,000	111,969,000	

三菱東京UFJ銀行 第24回劣後特約付			
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	303,183,000	
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	101,261,000	
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	104,127,000	
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	199,420,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,021,000	
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	300,000,000	301,761,000	
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	202,094,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	109,876,000	
芙蓉総合リース 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,624,000	
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,793,000	
みずほリース 第7回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,428,000	
NTTファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,120,000	
NTTファイナンス 第16回日本電信電話保証付	100,000,000	99,973,000	
NTTファイナンス 第17回日本電信電話保証付	200,000,000	199,386,000	
NTTファイナンス 第18回日本電信電話保証付	300,000,000	297,915,000	
東京センチュリー 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,739,000	
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	199,024,000	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,783,000	
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	797,776,000	
リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,642,000	
イオンフィナンシャルサービス 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,018,000	
アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,086,000	
アコム 第78回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,027,000	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,062,000	
オリエントコーポレーション 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,905,000	
日立キャピタル 第61回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,089,000	

日立キャピタル 第80回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,834,000	
オリックス 第202回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,741,000	
三井住友ファイナンス&リース 第27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,585,000	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,928,000	
三菱UFJリース 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,166,000	
三菱UFJリース 第76回社債間限定同順位特約付	300,000,000	295,068,000	
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	101,772,000	
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	99,621,000	
三井住友海上火災保険 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,690,000	
三井不動産 第71回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,590,000	
三菱地所 第93回担保提供制限等財務上特約無	200,000,000	227,040,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	99,749,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,099,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,866,000	
住友不動産 第109回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,016,000	
エス・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	105,344,000	
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	101,113,000	
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	113,014,000	
森トラスト総合リート投資法人 第13回	100,000,000	99,833,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,262,000	
東武鉄道 第124回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,713,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	201,670,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,352,000	
東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付	200,000,000	198,954,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,258,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,954,000	
	200,000,000	199,200,000	

京成電鉄 第 5 8 回社債間限定同順位特約付			
東日本旅客鉄道 第 5 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	226,678,000	
東日本旅客鉄道 第 7 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,418,000	
東日本旅客鉄道 第 1 0 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,697,000	
東日本旅客鉄道 第 1 0 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,574,000	
東日本旅客鉄道 第 1 1 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,952,000	
東日本旅客鉄道 第 1 3 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,868,000	
東日本旅客鉄道 第 1 4 5 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	168,556,000	
東日本旅客鉄道 第 1 4 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,951,000	
東日本旅客鉄道 第 1 5 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,602,000	
東日本旅客鉄道 第 1 6 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,527,000	
東日本旅客鉄道 第 1 6 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,604,000	
東日本旅客鉄道 第 1 6 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	88,817,000	
西日本旅客鉄道 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,211,000	
西日本旅客鉄道 第 1 5 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	333,669,000	
西日本旅客鉄道 第 6 0 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,648,000	
西日本旅客鉄道 第 6 5 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,252,000	
西日本旅客鉄道 第 6 6 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	191,616,000	
西日本旅客鉄道 第 7 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	88,385,000	
東海旅客鉄道 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,908,000	
東海旅客鉄道 第 5 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	228,198,000	
東海旅客鉄道 第 7 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,073,000	
東海旅客鉄道 第 7 3 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	314,139,000	
東海旅客鉄道 第 7 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,317,000	
東京地下鉄 第 2 2 回	100,000,000	99,897,000	
東京地下鉄 第 2 3 回	100,000,000	99,244,000	
東京地下鉄 第 2 4 回	100,000,000	99,010,000	
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	197,570,000	

西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,327,000	
阪急阪神ホールディングス 第47回	400,000,000	420,024,000	
阪急阪神ホールディングス 第49回	100,000,000	100,041,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,557,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,631,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,183,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,575,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,289,000	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	186,032,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	93,485,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	92,861,000	
澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,709,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,132,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,736,000	
ソフトバンク 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,421,000	
ソフトバンク 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	197,168,000	
ソフトバンク 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,021,000	
ソフトバンク 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,972,000	
東京電力 第548回	100,000,000	109,406,000	
東京電力 第560回	100,000,000	108,330,000	
中部電力 第500回	200,000,000	203,044,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,200,000	
中部電力 第530回	200,000,000	196,934,000	
関西電力 第509回	100,000,000	100,449,000	
関西電力 第511回	300,000,000	300,237,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,472,000	
関西電力 第535回	200,000,000	199,382,000	
中国電力 第377回	100,000,000	101,341,000	
中国電力 第400回	100,000,000	99,893,000	
中国電力 第402回	100,000,000	100,224,000	
中国電力 第416回	100,000,000	99,151,000	

中国電力 第422回	600,000,000	591,918,000	
中国電力 第425回	100,000,000	98,744,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	103,326,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	101,472,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	98,076,000	
東北電力 第475回	100,000,000	101,569,000	
東北電力 第481回	200,000,000	203,808,000	
東北電力 第484回	100,000,000	99,718,000	
東北電力 第491回	100,000,000	100,405,000	
東北電力 第508回	100,000,000	99,783,000	
東北電力 第521回	300,000,000	297,324,000	
東北電力 第529回	200,000,000	198,610,000	
四国電力 第281回	100,000,000	101,398,000	
九州電力 第424回	100,000,000	101,737,000	
九州電力 第428回	105,000,000	106,796,550	
九州電力 第449回	200,000,000	200,834,000	
九州電力 第451回	100,000,000	100,449,000	
九州電力 第476回	100,000,000	99,393,000	
九州電力 第478回	100,000,000	96,372,000	
九州電力 第481回	300,000,000	295,677,000	
九州電力 第484回	200,000,000	197,470,000	
九州電力 第493回	300,000,000	298,359,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	101,839,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	105,935,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	100,192,000	
北海道電力 第345回	300,000,000	300,615,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,589,000	
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,452,000	
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,440,000	
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,583,000	
電源開発 第73回社債間限定同順位特約付	200,000,000	194,838,000	
東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	101,168,000	
東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	301,905,000	
東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,199,000	
東京電力パワーグリッド 第15回	300,000,000	299,394,000	
東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	101,146,000	
東京電力パワーグリッド 第35回	100,000,000	102,266,000	
東京電力パワーグリッド 第38回	400,000,000	401,828,000	
東京電力パワーグリッド 第40回	400,000,000	411,368,000	
東京電力パワーグリッド 第45回	300,000,000	296,268,000	

		J E R A 第 3 回無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,033,000	
		東京瓦斯 第 3 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,892,000	
		東京瓦斯 第 5 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	91,084,000	
		大阪瓦斯 第 3 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	88,231,000	
		大阪瓦斯 第 4 3 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	184,700,000	
		北海道瓦斯 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,035,000	
		北海道瓦斯 第 2 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,359,000	
		広島ガス 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,343,000	
		東京都競馬 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,921,000	
		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	100,025,000	
		ソフトバンクグループ 第 5 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,130,000	
	小計	銘柄数：270 組入時価比率：4.9%	41,305,000,000	41,444,620,550 4.9%	
	合計			41,444,620,550	
	合計			841,908,966,456	

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

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,320,152,444
コール・ローン	663,507,945
国債証券	647,207,005,444
未収利息	6,907,964,554
前払費用	567,283,955
その他未収収益	16,678,968
流動資産合計	656,682,593,310
資産合計	656,682,593,310
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,388
未払金	1,123,789,837
未払解約金	540,137,044

(2022年 4月22日現在)

未払利息	198
その他未払費用	6,481,446
流動負債合計	1,670,483,913
負債合計	1,670,483,913
純資産の部	
元本等	
元本	252,140,379,239
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	402,871,730,158
元本等合計	655,012,109,397
純資産合計	655,012,109,397
負債純資産合計	656,682,593,310

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）

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.5978円
(10,000口当たり純資産額)	(25,978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	
	254,165,905,420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	266,648,908,575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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考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

2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	232,929,687,553円

同期中における追加設定元本額	45,619,005,599円
同期中における一部解約元本額	26,408,313,913円
期末元本額	252,140,379,239円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	81,650,360円
バランスセレクト５０	82,441,264円
バランスセレクト７０	79,887,641円
野村外国債券インデックスファンド	269,431,728円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,613,028,031円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	23,471,418,644円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	1,926,703,050円
野村資産設計ファンド２０１５	18,956,002円
野村資産設計ファンド２０２０	19,410,334円
野村資産設計ファンド２０２５	34,998,868円
野村資産設計ファンド２０３０	41,450,423円
野村資産設計ファンド２０３５	30,446,794円
野村資産設計ファンド２０４０	51,946,833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）	73,601,313,582円
のむラップ・ファンド（保守型）	6,425,180,660円
のむラップ・ファンド（普通型）	21,056,902,468円
のむラップ・ファンド（積極型）	5,661,971,929円
野村外国債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	515,811,384円
野村資産設計ファンド２０４５	8,549,790円
野村インデックスファンド・外国債券	911,024,535円
マイ・ロード	8,739,731,780円
ネクストコア	122,618,726円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	280,822,498円
野村外国債券インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	8,633,789,791円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,149,382,068円
野村資産設計ファンド２０５０	8,551,759円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	4,394,498円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	2,306,627円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	1,519,087円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	1,196,260円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	813,469,005円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	899,083,826円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	3,912,328円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,960,475円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	8,999,177円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,508,021円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	7,385,065円
野村６資産均等バランス	2,334,472,597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）	6,720,996,244円
世界６資産分散ファンド	66,326,048円
野村資産設計ファンド２０６０	4,284,763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	9,705,533,651円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	6,614,449,673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）	6,258,567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）	1,091,831,506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）	182,392,760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）	1,181,714,771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）	625,120,196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）	2,444,155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）	8,524,581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）	384,730円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,027,817,881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）	7,978,444円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	41,162,838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）	7,972,530円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	169,214,350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）	154,104,529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）	1,960,812,142円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	73,006,736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）	1,004,663,978円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	1,146,721,127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）	6,103,483円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,578,723円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,335,393円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	6,034,888円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	589,734,007円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	5,439,795,257円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	6,736,883,818円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	5,124,408,264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）	20,611,959,541円
マイバランスDC30	2,028,527,683円
マイバランスDC50	1,535,941,560円
マイバランスDC70	1,104,993,935円
野村DC外国債券インデックスファンド	8,292,777,602円
野村DC運用戦略ファンド	3,811,926,740円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	453,289,889円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	284,053,780円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	519,639,122円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	252,769,869円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	20,128,972円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	46,240,044円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	21,834,017円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	12,089,913円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	8,501,966円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	4,485,764円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	157,983,768円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	103,191,367円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	57,252,023円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	79,157,002円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,994,917円

マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	19,801,633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）	55,780,767円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	20,839,424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(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	36,400,000.00	38,200,092.84	
		US TREASURY BOND	46,700,000.00	46,214,754.31	
		US TREASURY BOND	66,600,000.00	73,894,777.92	
		US TREASURY BOND	15,000,000.00	17,396,484.00	
		US TREASURY BOND	129,400,000.00	146,939,755.92	
		US TREASURY BOND	100,000.00	117,796.87	
		US TREASURY BOND	100,000.00	95,398.43	
		US TREASURY BOND	1,200,000.00	1,309,500.00	
		US TREASURY N/B	400,000.00	398,250.00	
		US TREASURY N/B	100,000.00	100,488.28	
		US TREASURY N/B	900,000.00	884,566.35	
		US TREASURY N/B	13,800,000.00	13,739,085.42	
		US TREASURY N/B	400,000.00	402,765.60	
		US TREASURY N/B	37,200,000.00	37,067,765.16	
		US TREASURY N/B	21,200,000.00	21,078,265.36	
		US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,963,808.47	
		US TREASURY N/B	200,000.00	195,640.62	
		US TREASURY N/B	800,000.00	792,437.44	
		US TREASURY N/B	100,000.00	100,492.18	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,241,546.66	
		US TREASURY N/B	37,100,000.00	37,288,397.51	

US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,512,187.50	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,751,827.58	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,004,296.80	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,454,413.95	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,687.50	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	34,650,000.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,006,093.70	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,753.88	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,171.86	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,461,702.86	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,005,234.30	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,507.79	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	42,726,466.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,429.68	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,140,343.52	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	29,441,920.41	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,500.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,054.68	
US TREASURY N/B	45,900,000.00	45,623,879.37	
US TREASURY N/B	800,000.00	800,312.48	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,843.74	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,436,601.45	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,945,624.80	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,571,428.76	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,851.56	
US TREASURY N/B	800,000.00	801,281.20	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,624,097.55	
US TREASURY N/B	500,000.00	495,156.25	
US TREASURY N/B	400,000.00	397,937.48	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,542.96	
US TREASURY N/B	38,100,000.00	37,684,767.15	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,515.62	
US TREASURY N/B	500,000.00	492,968.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	693,601.51	
US TREASURY N/B	72,000,000.00	71,662,500.00	

US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,209,343.75	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,166,742.16	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,765.62	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,413,757.37	
US TREASURY N/B	500,000.00	489,101.55	
US TREASURY N/B	300,000.00	284,390.61	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,744,781.06	
US TREASURY N/B	500,000.00	488,593.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,140.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,531.25	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,060,984.32	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,320.31	
US TREASURY N/B	43,600,000.00	42,877,875.00	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,065,625.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,710.93	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,364,374.88	
US TREASURY N/B	500,000.00	483,320.30	
US TREASURY N/B	57,850,000.00	56,968,689.96	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,593.74	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,256,875.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	482,773.40	
US TREASURY N/B	200,000.00	190,539.06	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,869,125.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,085.93	
US TREASURY N/B	200,000.00	190,789.06	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	990,156.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	287,976.54	
US TREASURY N/B	23,800,000.00	23,221,733.78	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,484.36	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,892,429.64	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	16,466,084.64	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	32,447,085.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,261.71	
US TREASURY N/B	43,600,000.00	43,545,500.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,699.21	

US TREASURY N/B	8,050,000.00	7,860,698.61	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	998,515.60	
US TREASURY N/B	200,000.00	184,187.50	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,077,577.92	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,734.36	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,189,843.36	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,234.36	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	22,310,897.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	695,460.92	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,750.00	
US TREASURY N/B	32,200,000.00	32,270,437.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,351.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,183.59	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,906.24	
US TREASURY N/B	50,100,000.00	48,878,812.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,975,000.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,234.36	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,891,406.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,984.36	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,410,655.42	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,742.18	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,903,125.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	983,046.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,035.15	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,868,750.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,476.56	
US TREASURY N/B	42,300,000.00	41,377,991.13	
US TREASURY N/B	300,000.00	274,664.04	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,705,078.08	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,226.54	
US TREASURY N/B	300,000.00	274,089.84	
US TREASURY N/B	800,000.00	765,750.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	275,109.36	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,883,312.32	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,527.34	

US TREASURY N/B	41,900,000.00	39,358,174.21	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,209,687.20	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,875.00	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	13,677,577.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	273,621.09	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,275,812.08	
US TREASURY N/B	300,000.00	276,339.84	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	13,692,250.00	
US TREASURY N/B	81,000,000.00	76,241,250.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	462,773.40	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,597.65	
US TREASURY N/B	200,000.00	184,804.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	186,820.30	
US TREASURY N/B	29,000,000.00	28,038,241.10	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,283,625.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	267,644.52	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	15,033,045.60	
US TREASURY N/B	67,500,000.00	65,575,190.25	
US TREASURY N/B	700,000.00	617,503.88	
US TREASURY N/B	300,000.00	264,210.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,367.18	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,388,702.69	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,742.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,031.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	262,136.70	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	962,148.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	263,554.68	
US TREASURY N/B	500,000.00	438,593.75	
US TREASURY N/B	500,000.00	440,625.00	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	27,342,927.61	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,058.59	
US TREASURY N/B	500,000.00	452,812.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,429.68	
US TREASURY N/B	53,600,000.00	53,265,000.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	451,093.75	

US TREASURY N/B	500,000.00	450,585.90	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,578.12	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,120,890.32	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,148.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,738.28	
US TREASURY N/B	300,000.00	271,230.45	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,209,843.72	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,066.40	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,292.96	
US TREASURY N/B	200,000.00	184,914.06	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,075,894.49	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,319,921.00	
US TREASURY N/B	21,700,000.00	20,874,382.27	
US TREASURY N/B	300,000.00	274,007.79	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,932,984.27	
US TREASURY N/B	600,000.00	507,234.36	
US TREASURY N/B	11,700,000.00	10,545,538.77	
US TREASURY N/B	48,100,000.00	59,602,662.86	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	13,861,000.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	83,039.06	
US TREASURY N/B	151,700,000.00	180,677,066.52	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	861,132.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,695.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,421.87	
US TREASURY N/B	31,900,000.00	27,797,857.78	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	911,328.10	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	31,089,583.98	
US TREASURY N/B	8,200,000.00	10,265,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	119,539.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	106,320.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	116,414.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	120,054.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	117,992.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	121,906.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	118,328.12	

US TREASURY N/B	100,000.00	110,921.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	116,117.18	
US TREASURY N/B	300,000.00	371,109.36	
US TREASURY N/B	200,000.00	164,078.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	118,031.25	
US TREASURY N/B	200,000.00	174,218.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,015.62	
US TREASURY N/B	200,000.00	159,281.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,757.81	
US TREASURY N/B	200,000.00	166,453.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,867.18	
US TREASURY N/B	200,000.00	177,562.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,878.90	
US TREASURY N/B	200,000.00	187,546.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,695.31	
US TREASURY N/B	290,000.00	287,938.27	
US TREASURY N/B	100,000.00	107,125.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	107,281.25	
US TREASURY N/B	24,500,000.00	25,311,562.50	
US TREASURY N/B	39,950,000.00	39,631,646.44	
US TREASURY N/B	36,700,000.00	35,750,960.02	
US TREASURY N/B	43,700,000.00	39,015,906.25	
US TREASURY N/B	23,400,000.00	22,827,795.12	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	16,719,335.50	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,128,249.92	
US TREASURY N/B	49,700,000.00	44,442,669.39	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	25,250,014.92	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	29,422,031.25	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	13,663,062.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,969,062.40	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,676,093.75	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	10,772,108.52	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	8,785,593.75	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	9,443,593.75	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,200,007.43	

小計	US TREASURY N/B	10,500,000.00	10,442,577.60	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	6,522,234.07	
	US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,475,981.84	
	US TREASURY N/B	100,000.00	97,945.31	
	US TREASURY N/B	11,250,000.00	9,714,550.50	
	US TREASURY N/B	300,000.00	266,390.61	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	813,906.20	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	1,478,812.50	
	US TREASURY N/B	9,100,000.00	6,316,679.46	
	US TREASURY N/B	7,900,000.00	5,852,171.48	
	US TREASURY N/B	14,600,000.00	11,521,452.76	
	US TREASURY N/B	56,850,000.00	50,396,632.45	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	813,554.60	
	銘柄数：244	2,461,510,000.00	2,461,648,308.92	
			(316,691,054,942)	
	組入時価比率：48.3%		49.0%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	6,680,000.00	6,614,502.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,070,000.00	3,049,529.24	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	496,589.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,171,496.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	32,996,686.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,645,343.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	317,618.35	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	285,229.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,400,000.00	10,556,913.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	183,065.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	764,229.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	14,730,000.00	17,489,503.47	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	963,929.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,156,368.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	13,800,000.00	17,439,722.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	2,377,918.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,275,648.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	11,020,122.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,277,412.50	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	10,600,000.00	8,830,372.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	869,499.00	
	銘柄数：21	126,180,000.00	129,781,699.06	
	組入時価比率：2.0%		(13,258,498,375)	2.0%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	114,500,000.00	112,299,310.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	66,608,802.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,000,000.00	98,805,377.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	80,300,000.00	75,834,388.52	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	75,890,542.72	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	76,600,000.00	71,505,717.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	366,356.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	58,363,905.08	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	25,800,000.00	25,036,345.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	60,643,440.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	43,000,000.00	39,011,268.40	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	64,800,000.00	64,102,259.52	
	銘柄数：12	779,200,000.00	748,467,712.04	
	組入時価比率：0.7%		(4,766,990,857)	0.7%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	1,852,246.08	
	BELGIUM KINGDOM	1,900,000.00	1,907,790.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,203,600.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,004,208.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,715,371.40	
	BELGIUM KINGDOM	6,700,000.00	7,715,720.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,341,382.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	1,993,980.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	991,008.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	6,424,392.00	
	BELGIUM KINGDOM	11,400,000.00	11,150,818.80	
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,371,414.40	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	99,180.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	485,787.00	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	103,402.20	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,865,059.50	

BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	5,429,036.00	
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	4,928,409.20	
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,598,817.50	
BELGIUM KINGDOM	3,100,000.00	3,357,616.20	
BELGIUM KINGDOM	2,200,000.00	2,323,877.60	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	14,586,002.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	14,730,534.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,019,475.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	7,775,003.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	20,700,000.00	22,323,681.09	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,600,000.00	14,542,480.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,700,000.00	6,012,211.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,152,962.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,800,000.00	21,058,049.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,600,000.00	6,877,272.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,105,081.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000.00	41,629,445.55	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	807,275.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,800,000.00	9,904,370.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,810,491.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,032,250.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,500,000.00	17,966,225.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,083,235.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	5,637,600.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	979,980.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	2,704,682.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	5,884,771.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000,000.00	16,736,610.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	3,575,728.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	11,315,497.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,200,000.00	6,143,113.60	
BUNDESobligation	100,000.00	100,334.00	
BUNDESobligation	2,000,000.00	1,983,660.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	203,784.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	823,392.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,500,000.00	6,081,515.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,750,541.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,100,000.00	10,369,771.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000.00	7,828,744.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,709,585.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	8,342,434.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	20,368,992.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	974,740.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	687,211.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,200,000.00	26,158,798.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	197,936.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	24,596,692.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	592,158.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	13,313,047.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,600,000.00	26,203,866.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,750,000.00	30,254,902.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,500,000.00	23,810,605.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	12,250,000.00	17,324,366.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	5,595,265.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	4,540,250.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,597,633.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	8,089,047.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	15,586,740.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	22,700,000.00	24,018,870.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,569,816.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	529,695.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,031,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	17,426,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	23,500,000.00	25,210,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	306,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,240,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	7,040,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,742,770.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,038,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,600,000.00	35,063,360.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	804,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,548,356.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	406,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,750,000.00	16,376,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,066,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	19,554,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,046,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	24,500,000.00	30,651,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	204,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	202,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	32,800,000.00	40,996,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	201,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,300,000.00	16,648,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	35,000,000.00	42,763,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	942,161.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,600,000.00	25,448,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	836,190.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	14,903,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,384,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	28,048,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,000,000.00	15,029,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,700,000.00	3,123,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	511,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	5,846,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	207,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	14,923,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	11,475,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,819,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,058,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	9,016,020.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	7,058,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	3,742,316.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	101,718.70	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	400,304.00	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	724,493.00	

FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	3,992,580.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	100,842.10	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,980,696.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,657,432.90	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,298,350.40	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,247,372.10	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	193,791.80	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,324,400.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	479,409.60	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	495,739.20	
FRANCE (GOVT OF)	970,000.00	990,617.35	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,993,600.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	99,522.00	
FRANCE (GOVT OF)	15,200,000.00	15,815,676.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,771,332.30	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	12,969,450.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,780,784.10	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	12,957,990.50	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,042,688.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	6,810,162.00	
FRANCE (GOVT OF)	15,100,000.00	14,852,299.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,921,676.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,400,000.00	10,489,460.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,100,000.00	9,831,319.80	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	96,030.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	102,681.80	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	11,138,192.74	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,878,404.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	378,029.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	435,298.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,400,000.00	12,119,340.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,700,000.00	5,887,729.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	11,267,643.15	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,067,500.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	291,646.50	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	36,712,865.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,700,000.00	6,264,870.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,700,000.00	39,058,470.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,600,000.00	14,929,843.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,650,000.00	35,255,810.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	30,100,000.00	41,775,007.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	405,609.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,150,000.00	11,873,531.25	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,450,000.00	31,553,214.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,850,000.00	10,556,596.65	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,040,000.00	22,275,414.72	
IRISH GOVERNMENT	6,130,000.00	6,984,035.27	
IRISH GOVERNMENT	7,900,000.00	7,847,480.80	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	599,250.00	
IRISH TSY 1.3% 2033	5,100,000.00	4,986,999.30	
IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	3,327,304.20	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	2,421,681.60	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	3,141,276.50	
IRISH TSY 1% 2026	7,100,000.00	7,181,650.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	7,500,000.00	8,207,302.50	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	1,685,441.60	
IRISH TSY 3.4% 2024	11,200,000.00	11,878,451.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	409,887.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	99,874.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,300,000.00	3,428,700.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,489,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,887,175.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,495,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	15,376,230.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	992,100.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	762,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,200,000.00	13,843,706.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,700,000.00	6,443,966.49	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	442,202.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,600,000.00	5,186,080.80	

小計	NETHERLANDS GOVERNMENT	9,600,000.00	12,867,321.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	851,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	901,593.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	154,044.45	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,291,940.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	723,753.10	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,328,208.70	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	6,287,220.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,000,446.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	9,733,046.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	11,600,000.00	11,168,480.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	8,600,000.00	9,578,846.84	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	546,681.76	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,848,585.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	7,024,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,636,888.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,555,341.99	
	SPANISH GOVERNMENT	25,200,000.00	32,785,666.20	
	SPANISH GOVERNMENT	27,900,000.00	38,250,900.00	
	SPANISH GOVERNMENT	6,300,000.00	8,052,521.40	
	銘柄数：211	1,461,770,000.00	1,716,762,214.48	
			(239,265,149,832)	
	組入時価比率：36.5%		37.1%	
英債券	UK TREASURY	1,350,000.00	1,336,035.60	
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,822,600.48	
	UK TREASURY	300,000.00	291,504.00	
	UK TREASURY	2,000,000.00	1,972,300.00	
	UK TREASURY	4,550,000.00	4,656,118.74	
	UK TREASURY	15,070,000.00	16,401,621.36	
	UK TREASURY	200,000.00	193,270.00	
	UK TREASURY	200,000.00	201,682.80	
	UK TREASURY	4,310,000.00	4,266,205.22	
	UK TREASURY	500,000.00	468,891.90	
	UK TREASURY	400,000.00	389,777.60	
	UK TREASURY	13,700,000.00	15,478,512.08	

小計	UK TREASURY	200,000.00	198,071.60	
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,379,571.90	
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,169,259.00	
	UK TREASURY	7,610,000.00	9,187,172.50	
	UK TREASURY	17,150,000.00	21,637,091.70	
	UK TREASURY	750,000.00	618,285.00	
	UK TREASURY	4,330,000.00	5,435,717.46	
	UK TREASURY	100,000.00	136,761.60	
	UK TREASURY	350,000.00	456,977.99	
	UK TREASURY	500,000.00	660,656.90	
	UK TREASURY	320,000.00	445,022.65	
	UK TREASURY	18,440,000.00	22,915,461.76	
	UK TREASURY	5,900,000.00	8,265,524.76	
	UK TREASURY	8,200,000.00	7,219,977.00	
	UK TREASURY	16,100,000.00	14,968,653.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	7,747,906.38	
	UK TREASURY	1,100,000.00	900,372.00	
	UK TREASURY	6,750,000.00	9,287,488.35	
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,173,771.56	
	UK TREASURY	700,000.00	658,022.26	
	UK TREASURY	8,950,000.00	13,830,882.50	
	UK TREASURY	100,000.00	117,364.00	
	UK TREASURY	200,000.00	297,320.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	6,350,000.00	7,554,187.96	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,400,000.00	9,882,624.00	
	銘柄数：37	175,830,000.00	208,622,663.61	
			(34,942,209,928)	
	組入時価比率：5.3%		5.4%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	7,900,000.00	7,974,038.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	37,647,695.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	15,704,560.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,300,000.00	16,558,695.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	17,826,574.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,100,000.00	11,516,363.27	
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	26,858,724.90	

小計	銘柄数：7	130,850,000.00	134,086,651.47 (1,810,169,794)	0.3%
	組入時価比率：0.3%			
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,318,915.70	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	37,800,000.00	38,371,656.96	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,247,625.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	6,821,786.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	9,760,380.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	9,008,490.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	28,000,000.00	26,164,544.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	6,652,933.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,625,500.00	
小計	銘柄数：9	124,700,000.00	120,971,831.16 (1,748,042,960)	0.3%
	組入時価比率：0.3%			
デンマーククロネ	KINGDOM OF DENMARK	870,000.00	889,834.26	
	KINGDOM OF DENMARK	24,800,000.00	25,659,320.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	15,300,924.84	
	KINGDOM OF DENMARK	37,250,000.00	35,633,350.00	
	KINGDOM OF DENMARK	40,200,000.00	60,370,221.36	
	KINGDOM OF DENMARK	3,500,000.00	2,575,055.00	
小計	銘柄数：6	122,320,000.00	140,428,705.46 (2,630,229,653)	0.4%
	組入時価比率：0.4%			
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	43,300,000.00	39,135,406.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	2,724,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	59,100,000.00	48,757,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,072,330.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000.00	2,163,800.00	
小計	銘柄数：5	111,100,000.00	94,853,036.00 (2,849,679,245)	0.4%
	組入時価比率：0.4%			
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	220,000.00	228,638.82	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,512,270.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	10,494,778.15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,080,000.00	18,045,838.13	

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,769,657.91	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,191,535.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	296,481.27	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,850,457.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	9,906,080.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	21,387,191.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	4,818,673.41	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	2,892,540.09	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,670,211.34	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	11,076,495.08	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,450,000.00	2,332,102.08	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	8,714,064.97	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	687,750.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,358,764.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,900,000.00	4,468,800.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,032,200.00	
	銘柄数：20	112,500,000.00	111,734,529.14	
			(10,572,321,147)	
	組入時価比率：1.6%		1.6%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,328,520.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,452,131.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,351,060.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,109,460.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,393,140.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,350,000.00	5,613,220.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	504,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	307,110.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,850,000.00	3,944,325.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,080,000.00	2,217,696.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	1,808,323.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	2,735,328.75	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,888,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,749,300.00	
	銘柄数：14	29,300,000.00	29,402,964.45	
			(2,770,053,280)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
小計				

リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	407,745.84	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,625,893.92	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,517,311.52	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	403,064.24	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3,900,000.00	3,952,117.26	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,200,000.00	2,234,437.48	
	MALAYSIA GOVERNMENT	5,800,000.00	5,925,901.18	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,700,000.00	1,723,603.82	
	MALAYSIA GOVERNMENT	16,600,000.00	17,065,208.36	
	MALAYSIA GOVERNMENT	4,600,000.00	4,622,689.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	7,000,000.00	6,888,007.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,200,000.00	2,152,327.10	
	MALAYSIA GOVERNMENT	280,000.00	274,139.46	
	MALAYSIA GOVERNMENT	15,400,000.00	15,653,103.62	
	MALAYSIA GOVERNMENT	5,400,000.00	5,374,510.38	
	MALAYSIA GOVERNMENT	9,800,000.00	9,292,848.04	
	MALAYSIA GOVERNMENT	7,100,000.00	6,875,346.06	
	MALAYSIA GOVERNMENT	9,700,000.00	9,940,645.36	
	MALAYSIA GOVERNMENT	10,500,000.00	10,456,813.50	
	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	302,902.71	
小計	銘柄数：20	108,580,000.00	108,688,616.35	
	組入時価比率：0.5%		(3,245,452,953)	0.5%
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	141,900,000.00	142,229,137.05	
	CHINA GOVERNMENT BOND	40,300,000.00	40,161,521.14	
	CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	89,860,550.75	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	32,703,145.20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	70,000,000.00	70,417,900.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,353,760.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,068,500.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	9,934,724.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,961,192.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	36,000,000.00	37,268,100.00	
小計	銘柄数：10	488,700,000.00	491,958,530.64	
			(9,810,686,213)	

	組入時価比率：1.5%		1.5%	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,160,692.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,018,116.50	
	ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,473,666.14	
	ISRAEL FIXED BOND	11,900,000.00	11,912,266.52	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	7,701,373.55	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,005,722.50	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	5,062,123.50	
	ISRAEL FIXED BOND	8,500,000.00	7,727,752.05	
	ISRAEL FIXED BOND	3,700,000.00	3,132,429.99	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	8,350,467.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,700,000.00	6,360,001.29	
小計	銘柄数：11	68,500,000.00	71,904,611.04	
	組入時価比率：0.4%		(2,846,466,265)	0.4%
合計			647,207,005,444	(647,207,005,444)

(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(2022年 4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	18,000,000	
		US TREASURY N/B	10,385,000	
		US TREASURY N/B	2,500,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	23,000,000	
		US TREASURY N/B	11,900,000	
		US TREASURY BOND	85,000	
		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	33,000,000	
		US TREASURY N/B	246,000	
		US TREASURY N/B	17,000,000	
		US TREASURY N/B	4,200,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	85,000	

US TREASURY N/B	22,185,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY BOND	43,000,000	
US TREASURY BOND	50,000,000	
US TREASURY BOND	13,000,000	
US TREASURY N/B	18,300,000	
US TREASURY N/B	15,000,000	
US TREASURY N/B	26,000,000	
US TREASURY N/B	27,000,000	
US TREASURY N/B	35,500,000	
US TREASURY BOND	50,000,000	
US TREASURY BOND	5,000,000	
US TREASURY BOND	11,000,000	
US TREASURY BOND	30,000,000	
US TREASURY N/B	11,000,000	
US TREASURY N/B	23,000,000	
US TREASURY N/B	765,000	
US TREASURY N/B	255,000	
US TREASURY N/B	170,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	14,450,000	
US TREASURY N/B	255,000	
US TREASURY N/B	13,298,000	
US TREASURY N/B	255,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	170,000	
US TREASURY N/B	850,000	
US TREASURY N/B	14,705,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	935,000	
US TREASURY N/B	29,000,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	8,400,000	
US TREASURY N/B	19,000,000	
US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
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	19,000,000	
US TREASURY N/B	6,800,000	
US TREASURY N/B	12,750,000	
US TREASURY N/B	11,050,000	
US TREASURY N/B	5,950,000	
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	1,445,000	
	US TREASURY N/B	7,395,000	
	US TREASURY N/B	37,000,000	
	US TREASURY N/B	41,000,000	
	US TREASURY N/B	35,000,000	
	US TREASURY N/B	2,000,000	
	US TREASURY N/B	1,000,000	
	US TREASURY BOND	30,618,000	
	US TREASURY N/B	22,500,000	
	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	37,000,000	
	US TREASURY N/B	12,750,000	
	US TREASURY N/B	27,000,000	
	US TREASURY N/B	578,000	
	US TREASURY N/B	23,000,000	
	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	14,000,000	
	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	8,000,000	
	US TREASURY N/B	12,000,000	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,600,000	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,900,000	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,500,000	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	500,000	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	102,000	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	351,000	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	176,000	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	759,000	
	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	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	365,000	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	219,000	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	250,000	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	407,000	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	7,200,000	

ユーロ	ISRAEL FIXED BOND	1,100,000	
	ISRAEL FIXED BOND	1,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,240,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000	
	BUNDESobligation	1,700,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000	
	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	1,375,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	945,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	960,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,410,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,235,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,380,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,300,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,170,000	
	FRANCE (GOVT OF)	1,700,000	
	FRANCE (GOVT OF)	8,058,000	
	FRANCE (GOVT OF)	5,800,000	
	FRANCE (GOVT OF)	12,000,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,700,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000	
	BELGIUM KINGDOM	850,000	
	BELGIUM KINGDOM	2,210,000	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	9,770,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000	
	SPANISH GOVERNMENT	20,000,000	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	10,400,000	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000	
	FINNISH GOVERNMENT	1,700,000	

	IRISH TSY 2.4% 2030	6,000,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,515,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	15,800,000	

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	2022年 4月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	56,258,053	—	56,182,665	△75,388
カナダドル	56,258,053	—	56,182,665	△75,388
合計	56,258,053	—	56,182,665	△75,388

（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。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2022年 4月22日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	83,175,793
コール・ローン	748,691,212
国債証券	79,782,574,897
未収入金	13,587,585
未収利息	589,885,698
前払費用	33,153,527
差入委託証拠金	250,158
流動資産合計	81,251,318,870
資産合計	81,251,318,870

(2022年 4月22日現在)

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,138,889,226
未払金	30,518,871
未払解約金	330,787,037
未払利息	224
その他未払費用	416,000
流動負債合計	3,500,611,358
負債合計	3,500,611,358
純資産の部	
元本等	
元本	70,042,547,875
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,708,159,637
元本等合計	77,750,707,512
純資産合計	77,750,707,512
負債純資産合計	81,251,318,870

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)

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1100円
(10,000口当たり純資産額)	(11,100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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する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

2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	64,602,750,087円

同期中における追加設定元本額	23,681,756,687円
同期中における一部解約元本額	18,241,958,899円
期末元本額	70,042,547,875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	1,846,908,199円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	805,279,470円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	36,451,841円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	10,505,671円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,330,281円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,502,566円
野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	9,384,069,095円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,499,193円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	818,295円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	5,149,734円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,150,183円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	3,732,854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）	40,615,813,629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）	9,199,708,984円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	596,418,746円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	163,954,304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）	236,464,192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）	449,462,414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）	628,569,609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(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	70,000.00	73,461.71	
		US TREASURY BOND	1,500,000.00	1,484,413.95	
		US TREASURY BOND	610,000.00	676,814.03	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	2,087,578.08	
		US TREASURY BOND	20,000.00	22,710.93	
		US TREASURY BOND	510,000.00	486,531.99	
		US TREASURY BOND	250,000.00	272,812.50	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,445.30	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,988,515.60	

US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,467,304.65	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	975,390.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	973,750.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	887,765.58	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,204,125.00	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,009,421.72	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,959,218.60	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,515,038.80	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,421,093.75	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	984,375.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,863,437.20	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,677,820.27	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,507,421.75	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,980,546.80	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,516,952.95	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,987,968.60	
US TREASURY N/B	700,000.00	700,273.42	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	957,734.30	
US TREASURY N/B	500,000.00	496,601.55	
US TREASURY N/B	400,000.00	400,640.60	
US TREASURY N/B	300,000.00	298,453.11	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,388,574.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,978,203.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	955,156.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,971,875.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,488,281.25	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,969,765.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,935,312.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,956,406.20	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,843,906.10	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,956,406.10	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,956,875.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,893,593.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,966,875.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,453,125.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,970,312.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	966,640.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,939,062.40	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,355,000.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,896,640.40	
US TREASURY N/B	800,000.00	787,000.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,941,718.60	

US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,951,406.20
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,494,023.40
US TREASURY N/B	1,000,000.00	951,796.80
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,480,664.00
US TREASURY N/B	500,000.00	463,496.05
US TREASURY N/B	800,000.00	781,187.44
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,997,031.20
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,978,124.80
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,996,093.60
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,832,343.60
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,696,708.42
US TREASURY N/B	600,000.00	596,109.36
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,006,562.50
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,367,636.70
US TREASURY N/B	1,000,000.00	909,531.20
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,600,025.00
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,471,484.25
US TREASURY N/B	500,000.00	453,710.90
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,093,437.50
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,457,617.00
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,921,250.00
US TREASURY N/B	700,000.00	663,085.92
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,385,976.30
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,871,562.50
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,390,039.00
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,536,206.93
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,736,562.40
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,773,124.80
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,560,351.50
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,489,500.00
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,823,750.00
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,310,058.50
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,417,089.75
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,833,750.00
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,691,640.34
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,764,296.80
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,321,054.65
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,085,499.84
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,539,437.44
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,321,875.00
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,158,749.76
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,617,187.20
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,478,125.00

US TREASURY N/B	1,000,000.00	885,781.20	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,079,898.36	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,692,148.40	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,356,152.25	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,041,015.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	910,664.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,257,324.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	924,570.30	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,325,492.06	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,078,249.92	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,196,757.55	
US TREASURY N/B	200,000.00	184,093.74	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,113,476.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,802,656.20	
US TREASURY N/B	500,000.00	619,570.30	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	2,755,500.00	
US TREASURY N/B	5,500,000.00	4,567,148.30	
US TREASURY N/B	500,000.00	595,507.80	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,808,378.88	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,332,078.06	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,333,390.49	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,004,234.26	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,549,257.77	
US TREASURY N/B	340,000.00	425,637.50	
US TREASURY N/B	1,760,000.00	2,103,887.45	
US TREASURY N/B	400,000.00	425,281.24	
US TREASURY N/B	800,000.00	931,312.48	
US TREASURY N/B	400,000.00	480,218.72	
US TREASURY N/B	500,000.00	589,960.90	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,401,921.87	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	723,906.20	
US TREASURY N/B	340,000.00	377,134.35	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	864,281.16	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,251,281.04	
US TREASURY N/B	300,000.00	371,109.36	
US TREASURY N/B	400,000.00	436,062.48	
US TREASURY N/B	500,000.00	498,789.05	
US TREASURY N/B	400,000.00	391,515.60	
US TREASURY N/B	500,000.00	468,867.15	
US TREASURY N/B	500,000.00	468,476.55	
US TREASURY N/B	800,000.00	794,312.48	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,606,875.00	

小計	US TREASURY N/B	700,000.00	750,968.75
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,686,453.04
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,558,624.96
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,517,781.25
	US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,477,888.87
	US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,636,878.05
	US TREASURY N/B	920,000.00	899,371.85
	US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,262,373.31
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,044,328.04
	US TREASURY N/B	4,030,000.00	3,436,834.37
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,213,031.25
	US TREASURY N/B	500,000.00	492,265.60
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	985,937.50
	US TREASURY N/B	1,520,000.00	1,436,281.13
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,322,562.50
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,391,687.50
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,835,296.74
	US TREASURY N/B	900,000.00	895,078.08
	US TREASURY N/B	300,000.00	320,765.61
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,506,054.50
	US TREASURY N/B	500,000.00	489,726.55
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,122,570.28
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	887,968.70
	US TREASURY N/B	300,000.00	244,171.86
	US TREASURY N/B	2,500,000.00	1,680,468.75
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	1,596,523.38
	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,185,249.92
	US TREASURY N/B	1,200,000.00	946,968.72
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,241,078.02
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,138,976.44
	US TREASURY N/B	400,000.00	315,968.72
	US TREASURY N/B	300,000.00	259,382.79
	銘柄数：168	315,970,000.00	301,518,204.19 (38,790,316,969)
	組入時価比率：49.9%		48.7%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	150,000.00	148,999.80
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	595,906.80
	CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,056,315.44
	CANADIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,919,951.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	959,206.00
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	544,488.60
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	950,764.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	915,327.00

小計	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	382,114.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,211,085.78	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	674,750.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	707,329.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	533,708.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	441,774.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	758,248.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	500,614.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	480,000.00	556,646.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,540,000.00	1,513,242.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	333,221.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	541,335.20	
	銘柄数：20	16,550,000.00	16,245,030.92	
			(1,659,592,358)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,100,000.00	12,848,218.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	11,272,258.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	12,575,229.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,700,000.00	4,438,625.48	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	16,700,000.00	15,589,366.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	2,839,259.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	6,570,045.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,200,000.00	9,898,090.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,446,000.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	3,901,126.84	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	9,199,861.32	
	銘柄数：11	97,400,000.00	93,578,081.54	
			(595,998,801)	
	組入時価比率：0.8%		0.7%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	205,805.12	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	602,460.00	
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	241,707.00	
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	301,262.40	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,210,850.40	
	BELGIUM KINGDOM	1,100,000.00	1,113,794.00	
	BELGIUM KINGDOM	950,000.00	947,140.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	952,100.00	
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	297,302.40	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	395,347.20	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,173,770.40	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	881,442.00	
	BELGIUM KINGDOM	550,000.00	686,769.60	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	485,787.00	

BELGIUM KINGDOM	120,000.00	124,082.64	
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	417,005.10	
BELGIUM KINGDOM	650,000.00	882,218.35	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	473,885.50	
BELGIUM KINGDOM	600,000.00	577,515.00	
BELGIUM KINGDOM	370,000.00	390,833.96	
BELGIUM KINGDOM GOVT	370,000.00	519,075.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	601,266.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	301,168.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,920,000.00	2,053,056.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	396,090.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	596,850.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,476,683.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	981,000.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	820,176.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,120,109.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	729,407.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	963,700.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,020,000.00	1,055,727.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	480,570.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,009,094.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	506,525.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	784,360.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,313,845.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,302,770.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,605,995.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	905,805.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	408,886.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,000,865.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	749,796.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,027,745.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	584,760.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,192,400.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	783,984.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	569,406.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	422,243.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	980,795.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	760,755.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	950,000.00	1,061,544.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	862,133.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	647,585.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	236,273.60	

BUNDESOBLIGATION	1,100,000.00	1,102,013.00
BUNDESOBLIGATION	1,000,000.00	996,860.00
BUNDESOBLIGATION	1,500,000.00	1,481,958.00
BUNDESOBLIGATION	1,000,000.00	977,990.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	621,541.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	720,468.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	442,292.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	628,135.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	718,697.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	447,356.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,003,550.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	508,685.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	898,632.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	292,422.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,270,000.00	2,228,527.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,812,986.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	841,228.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	1,973,860.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,244,210.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,322,706.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	704,405.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,221,220.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	933,940.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	935,800.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,530,133.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	922,660.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	2,020,293.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	87,618.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	605,430.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,414,234.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	710,000.00	1,073,686.14
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	97,291.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	1,060,376.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	1,043,748.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,110,000.00	1,478,742.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000.00	1,269,720.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	974,337.00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	1,000,000.00	999,650.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	366,290.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,005,210.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	203,688.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,360,160.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,600,050.00

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,210,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	519,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	970,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	489,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,350,000.00	1,497,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	503,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	807,033.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,016,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	207,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	337,293.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,932,792.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,117,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,412,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	552,475.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,082,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,535,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	499,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,814,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	907,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	548,220.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	240,000.00	279,408.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,057,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,221,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	876,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,401,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	985,490.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,130,593.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	908,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	464,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,960,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,058,230.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,610,000.00	2,025,058.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	858,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	257,670.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	94,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000.00	1,828,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	715,890.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	454,755.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	392,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	675,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	580,000.00	756,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	860,000.00	909,966.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	480,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	873,760.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	1,040,310.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	452,325.66
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	329,200.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	310,000.00	282,955.60
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	152,578.05
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	206,998.00
FINNISH GOVERNMENT	810,000.00	802,181.88
FINNISH GOVERNMENT	740,000.00	820,151.62
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	271,246.50
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	484,479.50
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	332,440.00
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	191,763.84
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	198,295.68
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	306,376.50
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,495,200.00
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,990,440.00
FRANCE (GOVT OF)	510,000.00	530,657.55
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	393,629.40
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	598,590.00
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,088,256.95
FRANCE (GOVT OF)	1,050,000.00	1,022,999.25
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	958,208.40
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,010,672.00
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,283,074.00
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	983,596.00
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,441,257.00
FRANCE (GOVT OF)	2,200,000.00	2,021,471.10
FRANCE (GOVT OF)	2,720,000.00	3,035,248.00
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,349,995.50
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,320,918.00
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	778,718.40
FRANCE (GOVT OF)	1,550,000.00	1,488,465.00
FRANCE (GOVT OF)	560,000.00	575,018.08
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	572,638.92
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	233,330.91
FRANCE (GOVT OF)	710,000.00	746,048.75
FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	845,281.80
FRANCE (GOVT OF)	1,200,000.00	907,269.60
FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	668,748.60
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	1,913,580.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,100,000.00	2,169,163.50

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,304,674.47	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,100,000.00	2,123,625.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	972,155.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,410,000.00	2,673,051.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	989,190.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,578,120.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,340,000.00	1,370,273.28	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	429,076.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,290,000.00	3,178,231.46	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	540,812.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	720,000.00	1,048,950.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	2,322,936.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	700,000.00	1,078,776.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	1,427,911.20	
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	794,681.60	
IRISH TSY 0.2%	200,000.00	193,566.40	
IRISH TSY 0.2% 2030	1,100,000.00	1,006,456.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	200,000.00	186,283.20	
IRISH TSY 1.7% 2037	550,000.00	557,323.25	
IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	657,475.00	
IRISH TSY 2% 2045	450,000.00	474,030.45	
IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	530,288.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	307,415.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,039,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	700,000.00	695,100.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	397,300.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,100,000.00	1,097,910.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	992,100.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	919,997.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,150,000.00	1,304,939.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	548,422.68	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	491,893.68	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	265,321.74	
NETHERLANDS GOVERNMENT	610,000.00	878,752.58	
NETHERLANDS GOVERNMENT	650,000.00	871,224.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	281,950.64	
REPUBLIC OF AUSTRIA	210,000.00	185,325.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	123,235.56	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,550,899.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	300,066.90	
REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	393,728.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	692,879.60	

小計	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	962,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	447,681.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	590,324.28	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	83,682.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	314,342.01	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	225,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	265,844.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	401,400.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	163,688.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	540,276.69	
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	117,091.66	
	SPANISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,508,100.00	
	SPANISH GOVERNMENT	710,000.00	907,506.38	
	銘柄数：239	201,830,000.00	212,577,100.16	
			(29,626,870,449)	
	組入時価比率：38.1%		37.2%	
英ポンド	UK TREASURY	600,000.00	593,793.60	
	UK TREASURY	950,000.00	957,668.02	
	UK TREASURY	500,000.00	493,075.00	
	UK TREASURY	400,000.00	409,329.12	
	UK TREASURY	600,000.00	574,590.00	
	UK TREASURY	400,000.00	386,540.00	
	UK TREASURY	670,000.00	663,191.99	
	UK TREASURY	800,000.00	750,227.04	
	UK TREASURY	1,000,000.00	974,444.00	
	UK TREASURY	300,000.00	338,945.52	
	UK TREASURY	400,000.00	396,143.20	
	UK TREASURY	90,000.00	113,407.74	
	UK TREASURY	800,000.00	744,920.00	
	UK TREASURY	1,400,000.00	1,234,730.00	
	UK TREASURY	600,000.00	737,076.00	
	UK TREASURY	500,000.00	455,157.95	
	UK TREASURY	600,000.00	724,350.00	
	UK TREASURY	300,000.00	264,795.00	
	UK TREASURY	200,000.00	252,327.60	
	UK TREASURY	300,000.00	247,314.00	
	UK TREASURY	260,000.00	326,394.12	
	UK TREASURY	170,000.00	161,034.20	
	UK TREASURY	300,000.00	410,284.80	
	UK TREASURY	300,000.00	256,320.00	
	UK TREASURY	400,000.00	522,260.56	
	UK TREASURY	200,000.00	171,080.00	
	UK TREASURY	850,000.00	1,182,091.43	

小計	UK TREASURY	1,000,000.00	1,242,704.00	
	UK TREASURY	1,580,000.00	2,213,479.51	
	UK TREASURY	700,000.00	616,339.50	
	UK TREASURY	550,000.00	511,351.50	
	UK TREASURY	1,240,000.00	1,795,776.43	
	UK TREASURY	500,000.00	409,260.00	
	UK TREASURY	860,000.00	1,183,294.81	
	UK TREASURY	300,000.00	270,870.36	
	UK TREASURY	300,000.00	282,009.54	
	UK TREASURY	200,000.00	309,070.00	
	UK TREASURY	530,000.00	787,898.00	
	UK TSY 0 5/8% 2050	500,000.00	346,590.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	300,000.00	356,890.77	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	780,000.00	1,204,444.80	
	銘柄数：41	23,230,000.00	25,871,470.11	
			(4,333,212,528)	
	組入時価比率：5.6%		5.4%	
スウェーデンクローナ 小計	SWEDISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,028,116.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	258,925.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,650,144.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,000,000.00	957,150.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,301,217.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,516,446.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,017,556.80	
	銘柄数：7	16,050,000.00	15,729,556.60	
			(212,349,014)	
ノルウェークローネ 小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,906,781.10	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,750,000.00	2,791,588.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,959,620.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,633,385.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,750,000.00	1,674,575.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,437,525.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,798,090.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	2,631,765.00	
	銘柄数：8	16,600,000.00	15,833,330.40	
デンマーククローネ			(228,791,624)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
	KINGDOM OF DENMARK	1,650,000.00	1,687,616.70	
	KINGDOM OF DENMARK	3,400,000.00	3,517,810.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,241,536.76	
	KINGDOM OF DENMARK	2,100,000.00	2,008,860.00	
	KINGDOM OF DENMARK	4,900,000.00	7,358,559.32	

小計	KINGDOM OF DENMARK	1,000,000.00	735,730.00	
	銘柄数：6	15,350,000.00	17,550,112.78	
	組入時価比率：0.4%		(328,713,612)	0.4%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,200,000.00	5,603,684.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	3,135,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,900,000.00	3,108,495.00	
小計	銘柄数：3	13,900,000.00	11,847,179.00	
			(355,925,983)	
	組入時価比率：0.5%		0.4%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	100,000.00	103,926.74	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	400,000.00	403,272.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	283,652.49	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,365,340.07	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	549,404.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	892,664.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	893,651.49	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	787,528.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	889,443.81	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,018,020.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	784,640.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	770,709.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	200,000.00	169,076.26	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	613,569.11	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	123,990.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	421,266.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,170,000.00	1,322,397.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	761,502.72	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	158,437.54	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	320,000.00	314,400.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	634,089.89	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	246,240.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	338,700.00	
小計	銘柄数：23	14,160,000.00	13,845,923.65	
			(1,310,101,295)	
	組入時価比率：1.7%		1.6%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,417,360.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	408,880.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	403,440.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	696,570.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	765,916.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	302,850.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	409,480.00	

	小計	SINGAPORE GOVERNMENT	1,210,000.00	1,239,645.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	184,360.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	847,651.50		
		SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	663,250.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	497,000.00		
		SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	333,200.00		
		銘柄数：13	8,240,000.00	8,169,602.50 (769,658,251)		
		組入時価比率：1.0%		1.0%		
	小計	人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,046,390.00	
			CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,024,171.00	
			CHINA GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	12,883,057.20	
			CHINA GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,053,730.00	
			CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,042,880.00	
			CHINA GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,013,700.00	
			CHINA GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,192,238.50	
			CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,070,450.00	
			銘柄数：8	61,000,000.00	61,326,616.70 (1,222,981,522)	
			組入時価比率：1.6%		1.5%	
	小計	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,505,434.95	
			ISRAEL FIXED BOND	1,500,000.00	1,566,209.55	
			ISRAEL FIXED BOND	400,000.00	385,778.36	
			ISRAEL FIXED BOND	2,000,000.00	2,002,289.00	
			ISRAEL FIXED BOND	1,000,000.00	909,147.30	
			ISRAEL FIXED BOND	1,100,000.00	1,530,918.95	
			ISRAEL FIXED BOND	800,000.00	892,631.76	
			銘柄数：7	8,300,000.00	8,792,409.87 (348,062,491)	
			組入時価比率：0.4%		0.4%	
合計				79,782,574,897 (79,782,574,897)		

(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	2022年 4月22日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	80,054,127,524	—	83,193,016,750	△3,138,889,226

米ドル	38,393,438,102	—	40,427,750,257	△2,034,312,155
カナダドル	1,663,409,305	—	1,741,143,700	△77,734,395
メキシコペソ	606,945,686	—	630,665,627	△23,719,941
ユーロ	30,262,225,442	—	30,908,103,876	△645,878,434
英ポンド	4,356,119,727	—	4,554,506,817	△198,387,090
スウェーデンクローナ	224,393,553	—	229,311,000	△4,917,447
ノルウェークローネ	235,921,045	—	239,903,717	△3,982,672
デンマーククローネ	336,474,939	—	343,524,640	△7,049,701
ズロチ	371,361,933	—	379,943,842	△8,581,909
豪ドル	1,313,679,278	—	1,356,116,805	△42,437,527
シンガポールドル	758,973,002	—	792,884,919	△33,911,917
人民元	1,186,500,596	—	1,232,707,550	△46,206,954
新シェケル	344,684,916	—	356,454,000	△11,769,084
合計	80,054,127,524	—	83,193,016,750	△3,138,889,226

(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。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	256,630,085
コール・ローン	56,178,559
国債証券	21,441,470,128
未収入金	256,145,366
未収利息	221,763,975
前払費用	47,236,507
流動資産合計	22,279,424,620
資産合計	22,279,424,620
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	595,170
未払解約金	256,168,687
未払利息	16
その他未払費用	65,400
流動負債合計	256,829,273
負債合計	256,829,273
純資産の部	
元本等	

(2022年 4月22日現在)

元本	11,422,213,334
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	10,600,382,013
元本等合計	22,022,595,347
純資産合計	22,022,595,347
負債純資産合計	22,279,424,620

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)

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.9280円
(10,000口当たり純資産額)	(19,280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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考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

2022年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	10,891,306,132円
同期中における追加設定元本額	5,759,275,943円
同期中における一部解約元本額	5,228,368,741円
期末元本額	11,422,213,334円
期末元本額の内訳※	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	510,110,836円
ネクストコア	3,868,063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	1,015,507,483円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	873,060円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	478,680円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	3,019,667円

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	677,196円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	2,212,107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）	892,656,266円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	1,540,472,223円
NEXT FUNDS 新興国債券・J. P. モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	1,206,334,386円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	388,298,666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）	3,478,694円
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,175,334円
新興国債券・インデックスF（適格機関投資家専用）	136,117,362円
野村新興国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	5,459,594,916円
野村DC運用戦略ファンド	103,635,836円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	11,130,886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）	141,571,673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(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ABU DHABI GOVT INT'L	1,200,000.00	1,092,960.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	1,600,000.00	1,579,630.40	
		ABU DHABI GOVT INT'L	1,000,000.00	967,541.00	
		ABU DHABI GOVT INT'L	1,000,000.00	715,910.00	
		ARAB REPUBLIC OF EGYPT	800,000.00	678,344.00	
		ARAB REPUBLIC OF EGYPT	800,000.00	641,236.00	
		BRAZIL GLOBAL	650,000.00	750,756.50	
		BRAZIL GLOBAL	1,070,000.00	1,272,989.70	
		CHINA GOVT INTL BOND	1,500,000.00	1,391,973.00	
		CROATIA	1,100,000.00	1,129,606.50	
		CROATIA	1,100,000.00	1,152,083.90	
		DOMINICAN REPUBLIC	1,200,000.00	1,058,400.00	
		DOMINICAN REPUBLIC	1,000,000.00	882,050.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,100,000.00	1,063,029.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000.00	639,435.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,700,000.00	1,688,856.50	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,436,040.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,400,000.00	1,256,514.00	

FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,380,825.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,256,130.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	802,872.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,100,000.00	1,652,889.00	
HUNGARY	700,000.00	715,821.40	
HUNGARY	1,750,000.00	1,822,875.25	
HUNGARY	1,400,000.00	1,455,708.80	
HUNGARY	600,000.00	458,568.00	
INDONESIA GLOBAL	900,000.00	942,488.19	
MEXICO GLOBAL	200,000.00	139,434.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	1,000,000.00	1,017,700.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	1,200,000.00	1,248,966.00	
PANAMA GLOBAL	700,000.00	782,376.00	
PANAMA GLOBAL	1,550,000.00	1,791,156.75	
PHILIPPINES GLOBAL	1,000,000.00	973,226.30	
PHILIPPINES GLOBAL	1,150,000.00	1,568,312.50	
PHILIPPINES GLOBAL	1,000,000.00	1,268,125.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	3,975,113.00	1,334,763.44	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,365,309.00	780,575.62	
REPUBLIC OF ARGENTINA	6,537,686.00	1,951,368.51	
REPUBLIC OF ARGENTINA	5,986,159.00	2,235,650.80	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000.00	729,855.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,000,000.00	302,780.00	
REPUBLIC OF CHILE	1,000,000.00	964,185.00	
REPUBLIC OF CHILE	1,100,000.00	937,673.00	
REPUBLIC OF CHILE	1,200,000.00	985,236.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000.00	685,275.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,216,137.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	745,537.50	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,134,182.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	877,723.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	291,516.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,700,000.00	1,437,775.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000.00	1,958,750.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	791,840.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	771,166.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	600,696.00	
REPUBLIC OF ECUADOR	2,200,000.00	1,413,522.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	750,000.00	1,008,011.25	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,124,156.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	415,526.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	724,500.00	

REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	597,962.40
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	717,729.95
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	636,175.50
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	471,259.75
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,007,498.20
REPUBLIC OF INDONESIA	950,000.00	1,237,156.69
REPUBLIC OF INDONESIA	900,000.00	935,811.27
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	825,740.96
REPUBLIC OF INDONESIA	1,600,000.00	1,834,002.88
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,153,431.36
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	540,461.15
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,027,125.00
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	944,987.10
REPUBLIC OF NIGERIA	800,000.00	691,920.00
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	703,549.00
REPUBLIC OF PANAMA	900,000.00	886,257.00
REPUBLIC OF PANAMA	1,500,000.00	1,388,835.00
REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000.00	1,394,867.00
REPUBLIC OF PANAMA	1,000,000.00	895,830.00
REPUBLIC OF PANAMA	2,000,000.00	1,783,265.60
REPUBLIC OF PANAMA	1,400,000.00	1,206,422.00
REPUBLIC OF PERU	800,000.00	752,400.00
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	452,775.00
REPUBLIC OF PERU	3,900,000.00	3,445,611.00
REPUBLIC OF PERU	600,000.00	474,696.00
REPUBLIC OF PERU	700,000.00	570,241.00
REPUBLIC OF PERU	1,800,000.00	2,052,504.00
REPUBLIC OF PERU	1,300,000.00	1,067,261.00
REPUBLIC OF PERU	1,900,000.00	1,288,656.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	510,530.15
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,198,070.64
REPUBLIC OF PHILIPPINES	300,000.00	271,979.13
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	502,500.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	1,196,267.50
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,100,000.00	1,036,600.07
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,086,720.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	472,026.96
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	892,500.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,300,000.00	1,065,357.80
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,450,000.00	1,531,516.10
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	908,775.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,100,000.00	1,039,672.70
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,400,000.00	1,341,893.00

REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,842,840.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	759,195.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	364,104.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,800,000.00	2,363,620.00	
REPUBLIC OF SRI LANKA	600,000.00	264,000.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,186,605.60	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	386,832.40	
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,393,515.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,257,750.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,158,749.80	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,201,248.10	
REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000.00	1,390,160.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	578,007.60	
REPUBLIC OF TURKEY	1,000,000.00	829,242.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,106,534.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,007,940.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	855,327.00	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	733,707.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,614,569.00	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	500,000.00	529,415.00	
ROMANIA	400,000.00	411,552.00	
ROMANIA	1,100,000.00	974,985.00	
ROMANIA	800,000.00	870,272.00	
ROMANIA	1,200,000.00	1,162,814.40	
ROMANIA	1,200,000.00	968,832.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,000,000.00	1,026,250.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,600,000.00	1,605,280.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,100,000.00	1,072,079.80	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	800,000.00	705,708.80	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,500,000.00	1,497,201.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,300,000.00	1,312,350.00	
STATE OF QATAR	1,000,000.00	1,007,700.00	
STATE OF QATAR	1,400,000.00	1,449,488.60	
STATE OF QATAR	1,500,000.00	1,704,123.00	
STATE OF QATAR	1,000,000.00	1,037,200.00	
TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,481,164.50	
TURKEY GLOBAL	1,000,000.00	1,005,050.00	
UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	211,350.00	
UKRAINE GOVERNMENT	2,000,000.00	701,100.00	
UKRAINE GOVERNMENT	1,200,000.00	404,493.60	
UKRAINE GOVERNMENT	1,600,000.00	531,443.20	
UKRAINE GOVERNMENT	2,100,000.00	701,295.00	

	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	304,101.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	200,000.00	71,125.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	235,550.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,186,867.50	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,203,480.00	
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	706,020.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,110,928.50	
	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000.00	1,806,921.00	
	UNITED MEXICAN STATES	800,000.00	728,808.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,364,208.00	
	UNITED MEXICAN STATES	500,000.00	496,850.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,410,000.00	1,476,481.50	
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	606,900.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,030,602.00	
	UNITED MEXICAN STATES	600,000.00	506,802.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000.00	1,823,620.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,208,708.50	
	銘柄数：162	198,694,267.00	166,665,138.97 (21,441,470,128)	
	組入時価比率：97.4%		100.0%	
	小計			
	合計		21,441,470,128 (21,441,470,128)	

(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	2022年 4月22日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	212,944,464	—	213,539,634	△595,170
米ドル	212,944,464	—	213,539,634	△595,170
合計	212,944,464	—	213,539,634	△595,170

(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。

米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2022年 4月22日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	174,407,090
コール・ローン	9,718,500
社債券	9,981,192,449
派生商品評価勘定	505,674
未収利息	110,713,592
前払費用	28,960,143
流動資産合計	10,305,497,448
資産合計	
10,305,497,448	
負債の部	
流動負債	
未払金	37,328,441
未払解約金	49,873
未払利息	2
流動負債合計	37,378,316
負債合計	
37,378,316	
純資産の部	
元本等	
元本	6,760,861,257
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,507,257,875
元本等合計	10,268,119,132
純資産合計	
10,268,119,132	
負債純資産合計	
10,305,497,448	

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	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。 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）

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1,5188円
(10,000口当たり純資産額)	(15,188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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。 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

2022年 4月22日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法

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。

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

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	3,397,783,917円
同期中における追加設定元本額	6,469,919,428円
同期中における一部解約元本額	3,106,842,088円
期末元本額	6,760,861,257円
期末元本額の内訳＊	
野村インデックスファンド・米国ハイ・イールド債券	490,668,954円
野村インデックスファンド・米国ハイ・イールド債券・為替ヘッジ型	210,029,386円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,235,531円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,845,724円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	11,630,465円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	3,027,008円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	15,744,212円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	3,653,029,279円
米国ハイ・イールド債券・インデックスF（適格機関投資家専用）	2,368,324,882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）	4,325,816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(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	1011778 BC / NEW RED FIN	250,000.00	231,593.75	
		1011778 BC / NEW RED FIN	100,000.00	93,380.50	
		1011778 BC / NEW RED FIN	220,000.00	190,454.00	

ABC SUPPLY CO INC	50,000.00	46,991.75	
ACCO BRANDS CORP	50,000.00	44,055.25	
ACRISURE LLC / FIN INC	40,000.00	39,242.00	
ACRISURE LLC / FIN INC	50,000.00	44,961.75	
ADAPTHEALTH LLC	70,000.00	61,035.10	
ADT SEC CORP	100,000.00	88,218.24	
ADTALEM GLOBAL EDUCATION	53,000.00	49,856.57	
AETHON UN/AETHIN UN FIN	60,000.00	62,526.90	
AFFINITY GAMING	100,000.00	94,876.50	
AIR CANADA	110,000.00	103,002.35	
ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	100,000.00	105,413.00	
ALBERTSONS COS/SAFEWAY	240,000.00	227,550.00	
ALBERTSONS COS/SAFEWAY	150,000.00	130,323.75	
ALCOA NEDERLAND HOLDING	200,000.00	205,368.00	
ALGONQUIN PWR & UTILITY	50,000.00	46,062.50	
ALLEN MEDIA LLC/CO-ISSR	40,000.00	36,879.39	
ALLIANT HOLD / CO-ISSUER	50,000.00	46,660.00	
ALLIANT HOLD/CO-ISSUER	120,000.00	115,512.00	
ALLIED UNI HLD / ALL FIN	200,000.00	180,771.00	
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	70,000.00	69,875.54	
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	250,000.00	249,783.75	
ALLISON TRANSMISSION INC	100,000.00	86,898.50	
ALTICE FINANCING SA	200,000.00	174,795.00	
ALTICE FRANCE HOLDING SA	400,000.00	415,380.00	
ALTICE FRANCE SA	200,000.00	205,547.00	
ALTICE FRANCE SA	200,000.00	180,282.00	
ALTICE FRANCE SA	200,000.00	174,748.00	
AMBIENCE MERGER	30,000.00	23,593.20	
AMC ENTERTAINMENT HOLDIN	100,000.00	94,019.00	
AMC NETWORKS INC	100,000.00	90,114.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP	60,000.00	55,572.00	
AMERICAN AIRLINES INC	180,000.00	210,520.80	
AMERICAN AIRLINES/AADVAN	260,000.00	259,061.40	
AMERICAN AIRLINES/AADVAN	270,000.00	264,957.75	
AMERICAN AXLE & MFG INC	40,000.00	35,135.20	
AMERICAN FIN TR/FINAN OP	50,000.00	43,257.75	
AMKOR TECHNOLOGY INC	50,000.00	51,079.25	
AMWINS GROUP INC	140,000.00	130,063.50	
ANGI HOMESERVICES INC	40,000.00	32,855.00	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	100,000.00	105,458.00	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	170,000.00	168,895.00	
ANTERO RESOURCES CORP	84,000.00	89,554.08	

ANTERO RESOURCES CORP	100,000.00	99,470.00
APACHE CORP	100,000.00	96,067.50
APOLLO CMMRL REAL EST FI	70,000.00	61,173.70
APX GROUP INC	100,000.00	100,122.00
APX GROUP INC	60,000.00	49,650.00
ARAMARK SERVICES INC	120,000.00	113,512.80
ARCHES BUYER INC	100,000.00	90,128.50
ARCHES BUYER INC	50,000.00	44,708.00
ARCHROCK PARTNERS LP/FIN	50,000.00	50,340.25
ARCHROCK PARTNERS LP/FIN	50,000.00	49,065.25
ARCONIC CORP	100,000.00	101,500.00
ARCONIC ROLLED PRODUCTS	100,000.00	97,437.50
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	199,249.00
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	174,574.00
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	100,000.00	89,603.00
ASGN INCORPORATED	80,000.00	75,196.80
ASP AMC MERGER SUB	30,000.00	25,321.20
ASSUREDPARTNERS INC	30,000.00	29,872.35
ASSUREDPARTNERS INC	60,000.00	54,021.00
AVANTOR FUNDING INC	120,000.00	116,094.00
AVANTOR FUNDING INC	100,000.00	90,782.00
AVAYA INC	70,000.00	66,425.80
AVIS BUDGET CAR/FINANCE	100,000.00	95,119.50
B&G FOODS INC	100,000.00	92,620.50
BAFFINLAND IRON CORP/LP	20,000.00	20,547.10
BALL CORP	120,000.00	121,800.00
BALL CORP	100,000.00	85,999.00
BALL CORP	50,000.00	42,683.00
BAUSCH HEALTH AMERICAS	170,000.00	162,351.70
BAUSCH HEALTH COS INC	120,000.00	118,541.40
BAUSCH HEALTH COS INC	150,000.00	143,845.50
BAUSCH HEALTH COS INC	100,000.00	83,573.00
BAUSCH HEALTH COS INC	100,000.00	91,123.50
BAUSCH HEALTH COS INC	100,000.00	76,399.00
BAUSCH HEALTH COS INC	300,000.00	239,511.00
BAUSCH HEALTH COS INC	100,000.00	72,707.50
BCPE EMPIRE HOLDINGS INC	70,000.00	67,285.75
BELLRING BRANDS INC	100,000.00	99,733.00
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	50,000.00	50,320.50
BIG RIVER STEEL/BRS FIN	100,000.00	103,617.00
BLACK KNIGHT INFOSERV LL	90,000.00	84,853.80
BLOCK INC	50,000.00	42,813.00
BLUE RACER MID LLC/FINAN	100,000.00	104,371.50

BOMBARDIER INC	24,000.00	24,420.00	
BOMBARDIER INC	50,000.00	47,997.00	
BOMBARDIER INC	220,000.00	213,717.90	
BOMBARDIER INC	100,000.00	90,880.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON INC	100,000.00	94,497.50	
BOYD GAMING CORP	100,000.00	95,987.50	
BOYD GAMING CORP	70,000.00	64,139.95	
BOYNE USA INC	50,000.00	47,188.50	
BRAND ENERGY & INFRASTRU	80,000.00	72,408.00	
BRINK'S CO/THE	20,000.00	19,215.06	
BRITISH TELECOMMUNICATIO	200,000.00	188,930.32	
BROADSTREET PARTNERS INC	70,000.00	61,719.70	
BROOKFIELD PPTY REIT INC	100,000.00	92,984.50	
BROOKFIELD RESID PROPERT	100,000.00	86,710.00	
BUCKEYE PARTNERS LP	100,000.00	97,603.13	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	180,000.00	169,676.10	
BWAY HOLDING CO	70,000.00	67,631.55	
CABLE ONE INC	50,000.00	44,183.25	
CAESARS ENTERTAIN INC	120,000.00	106,442.40	
CAESARS RESORT / FINCO	150,000.00	153,562.50	
CALIFORNIA RESOURCES CRP	100,000.00	102,437.50	
CALLON PETROLEUM	50,000.00	52,026.50	
CALPINE CORP	100,000.00	94,220.00	
CALPINE CORP	100,000.00	89,750.00	
CALPINE CORP	140,000.00	121,775.50	
CALPINE CORP	100,000.00	85,372.00	
CALUMET SPECIALTY PROD	50,000.00	50,773.75	
CAMELOT FINANCE SA	100,000.00	95,679.50	
CARGO AIRCRAFT MANAGEMEN	60,000.00	56,853.90	
CARNIVAL CORP	150,000.00	165,826.50	
CARNIVAL CORP	40,000.00	40,158.60	
CARNIVAL CORP	250,000.00	235,470.00	
CARNIVAL CORP	220,000.00	202,720.10	
CARNIVAL CORP	200,000.00	188,022.00	
CARVANA CO	50,000.00	44,940.00	
CARVANA CO	120,000.00	99,835.20	
CARVANA CO	40,000.00	32,870.80	
CATALENT PHARMA SOLUTION	50,000.00	49,469.50	
CATALENT PHARMA SOLUTION	100,000.00	88,375.50	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	20,000.00	19,497.50	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	300,000.00	294,285.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	500,000.00	461,010.00	

CCO HLDGS LLC/CAP CORP	250,000.00	219,421.87
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	100,000.00	89,663.50
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	200,000.00	175,518.00
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	100,000.00	85,366.00
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	200,000.00	165,114.00
CD&R SMOKEY BUYER INC	100,000.00	102,500.00
CDK GLOBAL INC	50,000.00	50,403.25
CEC ENTERTAINMENT CO LLC	80,000.00	76,859.20
CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	150,000.00	151,695.00
CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	30,000.00	29,325.00
CENTENE CORP	200,000.00	194,530.00
CENTENE CORP	250,000.00	219,425.00
CENTENE CORP	150,000.00	146,570.25
CENTENE CORP	100,000.00	89,750.00
CENTENE CORP	150,000.00	131,280.00
CENTENE CORP	200,000.00	167,768.00
CENTENE CORP	200,000.00	167,540.00
CENTRAL GARDEN & PET CO	50,000.00	44,317.75
CENTURY COMMUNITIES	50,000.00	42,758.00
CENTURYLINK INC	100,000.00	92,734.00
CENTURYLINK INC	100,000.00	90,500.00
CHARLES RIVER LABORATORI	100,000.00	91,123.00
CHEMOURS CO	120,000.00	114,450.60
CHEMOURS CO	50,000.00	44,067.50
CHENIERE ENERGY INC	200,000.00	195,754.00
CHENIERE ENERGY PARTNERS	330,000.00	317,212.50
CHENIERE ENERGY PARTNERS	50,000.00	43,176.25
CHESAPEAKE ESCROW ISSUER	20,000.00	20,024.20
CHOBANI LLC/FINANCE CORP	12,000.00	11,427.84
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	150,000.00	148,551.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	100,000.00	88,252.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	200,000.00	196,078.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	200,000.00	190,440.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	50,000.00	44,935.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	100,000.00	92,727.50
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	100,000.00	90,378.50
CHURCHILL DOWNS INC	80,000.00	79,608.00
CHURCHILL DOWNS INC	30,000.00	28,520.70
CINEMARK USA INC	50,000.00	45,085.25
CLARIV SCI HLD CORP	50,000.00	45,369.75
CLARIV SCI HLD CORP	90,000.00	81,177.30
CLEAN HARBORS INC	50,000.00	49,811.50
CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO	110,000.00	106,009.75

CLEAR CHANNEL OUTDOOR HO	50,000.00	48,183.75	
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	120,000.00	115,164.00	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	160,000.00	155,405.60	
CLEVELAND-CLIFFS INC	50,000.00	50,827.50	
CNX RESOURCES CORP	50,000.00	52,026.00	
CNX RESOURCES CORP	50,000.00	49,240.00	
COGENT COMMUNICATIONS GR	70,000.00	66,252.20	
COINBASE GLOBAL INC	30,000.00	25,334.10	
COINBASE GLOBAL INC	100,000.00	79,380.00	
COLGATE ENERGY P	40,000.00	40,154.00	
COLT MERGER SUB INC	280,000.00	287,411.60	
COLT MERGER SUB INC	130,000.00	138,290.10	
COMMScope FINANCE LLC	100,000.00	96,788.50	
COMMScope FINANCE LLC	120,000.00	106,375.80	
COMMScope INC	50,000.00	41,817.50	
COMMScope INC	50,000.00	43,073.25	
COMPASS GROUP DIVERSIFIE	40,000.00	37,266.60	
COMSTOCK RESOURCES INC	150,000.00	147,096.75	
CONDOR MERGER SUB INC	150,000.00	139,335.75	
CONDUENT BUS SERVICES	40,000.00	37,257.60	
CONNECT FINCO SARL/CONNE	200,000.00	198,250.00	
CONSENSUS CLOUD SOLUTION	50,000.00	48,142.25	
CORECIVIC INC	80,000.00	83,074.80	
CORELOGIC INC	60,000.00	55,172.10	
CORNERSTONE BUILDING	70,000.00	60,113.90	
COTY INC	30,000.00	29,609.10	
COTY/HFC PRESTIGE/INT US	100,000.00	91,334.50	
COVERT MERGECO INC	70,000.00	64,969.45	
CP ATLAS BUYER INC	30,000.00	24,348.90	
CRESCENT ENERGY FINANCE	50,000.00	49,811.25	
CRESTWOOD MID PARTNER LP	100,000.00	99,113.50	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	50,000.00	45,176.75	
CROWN AMER/CAP CORP VI	50,000.00	50,094.00	
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	140,000.00	140,994.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	196,783.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	171,500.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	169,225.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	169,274.00	
CSVC ACQUISITION CORP	20,000.00	15,700.00	
CURO GROUP HOLDINGS CORP	100,000.00	86,220.00	
CVR ENERGY INC	50,000.00	48,941.50	
CVR PARTNERS/CVR NITROGE	50,000.00	50,190.74	

CWT TRAVEL GROUP INC	50,000.00	50,000.00
DAVITA INC	200,000.00	180,132.00
DAVITA INC	180,000.00	151,205.40
DCP MIDSTREAM OPERATING	80,000.00	81,418.40
DCP MIDSTREAM OPERATING	100,000.00	103,659.50
DEALER TIRE LLC/DT ISSR	30,000.00	29,903.40
DELTA AIR LINES INC	56,000.00	60,711.28
DELTA AIR LINES INC	100,000.00	96,048.00
DELUXE CORP	40,000.00	39,195.60
DEUTSCHE BANK NY	200,000.00	184,862.56
DIAMOND BC BV	50,000.00	44,605.75
DIAMOND SPORTS GR/DIAMON	250,000.00	94,816.25
DIRECTV HOLDINGS/FING	350,000.00	340,105.46
DISH DBS CORP	200,000.00	187,125.00
DISH DBS CORP	100,000.00	91,088.00
DISH DBS CORP	200,000.00	184,535.00
DISH DBS CORP	120,000.00	97,125.00
DIVERSIFIED HEALTHCARE T	50,000.00	39,813.00
DOLYA HOLDCO 18 DAC	200,000.00	185,154.00
DORNOCH DEBT MERGER SUB	50,000.00	41,250.00
DT MIDSTREAM INC	80,000.00	73,902.40
DT MIDSTREAM INC	80,000.00	72,801.60
DYCOM INDUSTRIES INC	70,000.00	64,788.50
EDGEWELL PERSONAL CARE	100,000.00	90,000.00
EG GLOBAL FINANCE PLC	200,000.00	201,700.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	80,000.00	83,895.20
ELASTIC NV	70,000.00	63,554.40
ELEMENT SOLUTIONS INC	100,000.00	89,881.00
EMBECTA CORP	40,000.00	36,453.60
ENCINO ACQUISITION PARTN	60,000.00	61,117.20
ENCOMPASS HEALTH CORP	100,000.00	92,196.00
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	100,000.00	100,758.00
ENDO FIN LLC/ENDO FINCO	120,000.00	98,325.00
ENDO FIN LLC/ENDO FINCO	80,000.00	40,700.00
ENDO LUX FIN CO I SARL	50,000.00	44,985.50
ENDURANCE ACQ MERGER	40,000.00	33,566.20
ENERGIZER HOLDINGS INC	100,000.00	85,309.50
ENLINK MIDSTREAM LLC	40,000.00	40,153.40
ENSTAR FINANCE LLC	50,000.00	47,473.50
ENTERCOM MEDIA CORP	50,000.00	44,812.50
ENVIVA PARTNERS LP/FIN C	60,000.00	60,975.60
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	150,000.00	151,132.50
EQM MIDSTREAM PARTNERS L	100,000.00	90,470.00

EQM MIDSTREAM PARTNERS L	150,000.00	137,625.00	
EVERARC ESCROW SARL	50,000.00	44,243.50	
EXELA INTERMED/EXELA FIN	80,000.00	32,800.00	
FAIR ISAAC CORP	100,000.00	92,359.50	
FERRELLGAS ESCROW LLC/FG	100,000.00	88,470.00	
FERTITTA ENTERTAINMENT	100,000.00	92,430.00	
FERTITTA ENTERTAINMENT	130,000.00	117,475.80	
FIRSTCASH INC	100,000.00	94,595.50	
FIRSTENERGY CORP	250,000.00	246,012.50	
FIVE POINT OP CO LP/FIVE	60,000.00	59,978.40	
FLUOR CORP	50,000.00	48,572.25	
FMG RESOURCES AUG 2006	30,000.00	30,553.65	
FMG RESOURCES AUG 2006	50,000.00	48,352.50	
FMG RESOURCES AUG 2006	130,000.00	116,634.05	
FORD MOTOR COMPANY	150,000.00	169,128.00	
FORD MOTOR COMPANY	450,000.00	370,923.75	
FORD MOTOR CREDI	200,000.00	169,891.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	196,945.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	400,000.00	393,520.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	179,940.00	
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	188,294.00	
FORTRESS TRANS & INFRAST	150,000.00	145,122.75	
FORTRESS TRANS & INFRAST	50,000.00	44,184.50	
FOXTROT ESCROW ISSUER	50,000.00	54,062.50	
FREEDOM MORTGAGE CORP	16,000.00	15,664.32	
FREEDOM MORTGAGE CORP	120,000.00	111,024.00	
FRONT RANGE BIDCO INC	100,000.00	90,452.00	
FRONT RANGE BIDCO INC	90,000.00	79,583.40	
FRONTIER COMMUNICATIONS	100,000.00	97,893.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS	160,000.00	150,232.80	
FRONTIER COMMUNICATIONS	80,000.00	73,924.80	
FRONTIER COMMUNICATIONS	40,000.00	35,825.20	
FRONTIER COMMUNICATIONS	100,000.00	89,875.00	
FRST STU BID/FRST TRANS	50,000.00	45,165.62	
GAP INC/THE	50,000.00	44,062.50	
GAP INC/THE	70,000.00	60,571.35	
GARDA WORLD SECURITY	30,000.00	25,455.60	
GARTNER INC	100,000.00	96,890.00	
GARTNER INC	100,000.00	90,762.00	
GATES GLOBAL LLC	30,000.00	29,817.00	
GCI LLC	100,000.00	94,946.00	
GENESIS ENERGY LP/FIN	50,000.00	48,731.00	

GENESIS ENERGY LP/FIN	120,000.00	121,365.60
GENWORTH MORTGAGE HLDING	80,000.00	80,776.00
GFL ENVIRONMENTAL INC	120,000.00	119,511.00
GFL ENVIRONMENTAL INC	150,000.00	139,530.00
GLATFELTER	30,000.00	24,786.15
GLOBAL MEDICAL RESPONSE	100,000.00	97,384.50
GLOBAL NET LEASE/GLOBAL	50,000.00	44,660.18
GO DADDY OPCO/FINCO	50,000.00	49,651.00
GO DADDY OPCO/FINCO	60,000.00	53,475.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER	100,000.00	90,643.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER	50,000.00	44,819.75
GOODYEAR TIRE & RUBBER	50,000.00	44,703.00
GPC MERGER SUB INC	30,000.00	27,201.75
GRAFTECH FINANCE INC	70,000.00	64,453.55
GRAND CANYON UNIVERSITY	50,000.00	49,070.00
GRAY ESCROW II INC	100,000.00	89,147.00
GREYSTAR REAL ESTATE PAR	20,000.00	20,081.40
GRIFFON CORPORATION	100,000.00	90,714.00
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	50,000.00	45,196.00
GRUBHUB HOLDINGS INC	50,000.00	43,629.75
GUITAR CENTER ESCROW ISS	100,000.00	100,618.00
GULFPORT ENERGY OP CORP	50,000.00	51,699.75
GW B-CR SECURITY CORP	60,000.00	59,856.00
H&E EQUIPMENT SERVICES	120,000.00	106,405.20
HARSCO CORP	50,000.00	46,191.75
HARVEST MIDSTREAM I LP	100,000.00	101,635.00
HAT HOLDINGS I LLC/HAT	50,000.00	46,445.25
HAWAIIAN BRAND INTELLECT	100,000.00	99,028.00
HCA INC	100,000.00	103,081.00
HCA INC	70,000.00	73,930.15
HCA INC	100,000.00	105,846.00
HCA INC	200,000.00	183,015.00
HEALTH EQUITY INC	50,000.00	46,312.50
HERC HOLDINGS INC	130,000.00	130,611.00
HERTZ CORP/THE	50,000.00	46,608.74
HERTZ CORP/THE	100,000.00	90,067.00
HESS MIDSTREAM PARTNERS	100,000.00	97,992.00
HILCORP ENERGY I/HILCORP	50,000.00	50,710.00
HILCORP ENERGY I/HILCORP	100,000.00	99,470.00
HILTON DOMESTIC OPERATIN	30,000.00	30,601.80
HILTON DOMESTIC OPERATIN	100,000.00	92,018.75
HILTON DOMESTIC OPERATIN	150,000.00	146,600.25
HILTON DOMESTIC OPERATIN	100,000.00	88,005.50

HILTON GRAND VAC BOR ESC	150,000.00	138,944.25	
HLF FIN SARL LLC/HERBALI	60,000.00	50,030.40	
HOLLY NRG PRNTR/FIN CORP	50,000.00	47,770.25	
HOLOGIC INC	100,000.00	89,874.50	
HOME POINT CAPITAL INC	40,000.00	31,800.00	
HOSPITALITY PROP TRUST	100,000.00	94,437.00	
HOWARD HUGHES CORP	50,000.00	46,058.25	
HOWARD HUGHES CORP	100,000.00	90,368.00	
HOWMET AEROSPACE INC	4,000.00	4,255.00	
HOWMET AEROSPACE INC	100,000.00	88,125.00	
HUB INTERNATIONAL LTD	130,000.00	129,476.75	
HUB INTERNATIONAL LTD	50,000.00	46,510.00	
HUDBAY MINERALS INC	100,000.00	94,631.50	
HUNT COS INC	50,000.00	46,815.25	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	30,000.00	30,174.45	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	140,000.00	133,268.80	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	100,000.00	88,220.00	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	50,000.00	51,049.25	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	120,000.00	122,586.00	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	100,000.00	96,169.50	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	40,000.00	36,907.60	
II-VI INC	100,000.00	96,232.50	
ILIAD HOLDING SAS	200,000.00	195,364.00	
IMOLA MERGER CORP	100,000.00	95,035.00	
INGEVITY CORP	70,000.00	62,730.85	
INTELLIGENT PACKAGING	50,000.00	48,072.50	
INTELSAT JACKSON HLDG	200,000.00	192,440.00	
INTERNATIONAL GAME TECH	200,000.00	206,162.50	
IRON MOUNTAIN INC	100,000.00	96,930.50	
IRON MOUNTAIN INC	200,000.00	191,751.00	
IRON MOUNTAIN INC	180,000.00	167,524.20	
IRON MOUNTAIN INFO MGMT	100,000.00	89,128.50	
ISTAR INC	50,000.00	49,209.00	
ITT HOLDINGS LLC	50,000.00	45,766.50	
J2 GLOBAL	37,000.00	33,713.29	
JACOBS ENTERTAINMENT INC	70,000.00	70,044.80	
JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	200,000.00	177,223.00	
JANE STREET GRP/JSG FIN	50,000.00	46,442.75	
JB POINDEXTER & CO INC	100,000.00	101,036.00	
KAISER ALUMINUM CORP	50,000.00	46,310.75	
KAR AUCTION SERVICES INC	30,000.00	30,237.15	
KENNEDY-WILSON INC	150,000.00	140,805.00	

KRONOS ACQ / KIK CUSTOM	30,000.00	24,550.35
L BRANDS INC	50,000.00	49,025.00
L BRANDS INC	80,000.00	82,116.80
LABL ESCROW ISSUER LLC	100,000.00	97,691.50
LABL INC	50,000.00	49,489.50
LABL INC	50,000.00	46,593.75
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	150,000.00	139,335.00
LAMAR MEDIA CORP	200,000.00	185,240.00
LAMB WESTON HLD	70,000.00	64,142.40
LAMB WESTON HLD	60,000.00	55,272.90
LBM ACQUISITION LLC	70,000.00	60,516.40
LCM INVESTMENTS HOLDINGS	100,000.00	89,992.00
LD HOLDINGS GROUP LLC	100,000.00	87,116.00
LD HOLDINGS GROUP LLC	40,000.00	32,354.00
LEVEL 3 FINANCING INC	250,000.00	230,442.50
LEVEL 3 FINANCING INC	100,000.00	87,500.00
LEVI STRAUSS & CO	50,000.00	44,666.25
LIBERTY MUTUAL GROUP INC	50,000.00	45,937.25
LIFE TIME INC	70,000.00	69,207.25
LIFEPOINT HEALTH INC	100,000.00	94,434.00
LIFEPOINT HEALTH INC	40,000.00	36,173.60
LIONS GATE CAPITAL HOLD	80,000.00	72,676.80
LITHIA MOTORS INC	80,000.00	75,680.40
LIVE NATION ENTERTAINMEN	100,000.00	103,896.00
LIVE NATION ENTERTAINMEN	50,000.00	47,232.75
LIVE NATION ENTERTAINMEN	50,000.00	46,375.00
LOGAN MERGER SUB INC	100,000.00	90,754.00
LPL HOLDINGS INC	80,000.00	73,702.40
LSB INDUSTRIES	50,000.00	50,200.50
LSF9 ATL HLDG/VICTRA FIN	100,000.00	95,504.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	100,000.00	82,224.00
LUMEN TECHNOLOGIES INC	100,000.00	85,397.50
MACY'S RETAIL HLDGS LLC	50,000.00	48,937.50
MADISON IAQ LLC	70,000.00	62,610.45
MADISON IAQ LLC	80,000.00	66,076.00
MAGIC MERGERCO INC	50,000.00	43,181.25
MAGIC MERGERCO INC	110,000.00	88,000.00
MAJORDRIVE HOLDINGS IV L	60,000.00	49,602.00
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	70,000.00	64,189.30
MASONITE INTERNATIONAL C	50,000.00	48,650.25
MATADOR RESOURCES CO	50,000.00	50,055.00
MATCH GROUP HLD II LLC	50,000.00	42,438.25
MATCH GROUP INC	100,000.00	94,754.50

MATTAMY GROUP CORP	100,000.00	95,869.50	
MATTEL INC	150,000.00	144,281.25	
MAV ACQUISITION CORP	50,000.00	45,660.75	
MAV ACQUISITION CORP	60,000.00	54,895.20	
MEG ENERGY CORP	100,000.00	102,697.00	
MEG ENERGY CORP	50,000.00	49,311.00	
MELCO RESORTS FINANCE	200,000.00	167,600.00	
MERCER INTL INC	100,000.00	93,891.50	
METHANEX CORP	70,000.00	67,741.10	
METIS MERGER SUB LLC	80,000.00	73,817.20	
MGIC INVESTMENT CORP	50,000.00	48,791.50	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200,000.00	180,898.00	
MGM GROWTH/MGM FINANCE	50,000.00	51,030.21	
MGM GROWTH/MGM FINANCE	150,000.00	156,170.53	
MGM RESORTS INTL	160,000.00	161,124.80	
MGM RESORTS INTL	33,000.00	32,650.53	
MICROSTRATEGY INC	60,000.00	56,697.00	
MIDAS OPCO HOLDINGS LLC	100,000.00	89,511.50	
MIDWEST GAMING BORROWER	50,000.00	44,961.50	
MILLENNIUM ESCROW CORP	100,000.00	94,763.00	
MINERAL RESOURCES LTD	50,000.00	52,284.50	
MINERVA MERGER SUB INC	220,000.00	206,734.00	
MIWD HLDCO II/MIWD FIN	70,000.00	62,491.45	
MODIVCARE ESCROW ISSUER	50,000.00	45,808.00	
MOHEGAN GAMING & ENT	100,000.00	93,554.50	
MOLINA HEALTHCARE INC	70,000.00	66,970.75	
MOLINA HEALTHCARE INC	100,000.00	91,868.00	
MOOG INC	50,000.00	47,875.00	
MOSS CREEK RESOURCES HLD	60,000.00	55,312.80	
MOSS CREEK RESOURCES HLD	50,000.00	47,837.00	
MOZART DEBT MERGER SUB	350,000.00	312,375.00	
MOZART DEBT MERGER SUB	200,000.00	177,040.00	
MPH ACQUISITION HOLDINGS	70,000.00	65,712.50	
MPH ACQUISITION HOLDINGS	70,000.00	61,847.80	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	250,000.00	246,693.75	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	100,000.00	87,868.50	
MSCI INC	130,000.00	120,945.50	
MSCI INC	100,000.00	89,116.50	
MSCI INC	70,000.00	60,107.60	
MURPHY OIL CORP	30,000.00	30,423.15	
MURPHY OIL CORP	100,000.00	100,758.00	
MURPHY OIL USA INC	40,000.00	38,722.60	

MURPHY OIL USA INC	50,000.00	44,874.25
NABORS INDUSTRIES INC	50,000.00	49,079.25
NABORS INDUSTRIES INC	70,000.00	72,296.00
NABORS INDUSTRIES LTD	40,000.00	39,932.60
NATIONSTAR MTG HLD INC	100,000.00	97,432.00
NATIONSTAR MTG HLD INC	100,000.00	89,473.00
NAVIENT CORP	120,000.00	120,826.20
NAVIENT CORP	100,000.00	90,130.50
NCL CORPORATION LTD	110,000.00	103,529.80
NCL CORPORATION LTD	110,000.00	102,430.90
NCL CORPORATION LTD	100,000.00	98,540.50
NCL CORPORATION LTD	80,000.00	79,319.36
NCR CORP	100,000.00	94,375.50
NCR CORP	170,000.00	166,639.10
NESCO HOLDINGS II INC	100,000.00	95,891.00
NETFLIX INC	200,000.00	198,000.00
NETFLIX INC	100,000.00	106,250.00
NETFLIX INC	300,000.00	305,253.00
NEW ENTERPRISE STONE & L	50,000.00	46,867.25
NEW FORTRESS ENERGY INC	100,000.00	98,868.75
NEWS CORP	150,000.00	137,869.50
NEXSTAR BROADCASTING INC	100,000.00	93,137.00
NEXSTAR ESCROW INC	100,000.00	98,282.00
NEXTERA ENERGY OPERATING	50,000.00	50,143.25
NEXTERA ENERGY OPERATING	100,000.00	96,206.50
NFP CORP	150,000.00	135,282.00
NFP CORP	70,000.00	65,224.95
NGL ENRGY OP/FIN CORP	150,000.00	143,832.75
NIELSEN FINANCE LLC/CO	150,000.00	146,809.50
NIELSEN FINANCE LLC/CO	120,000.00	115,920.00
NMG HLD/CO/NEIMAN MARCUS	100,000.00	100,357.50
NORDSTROM INC	40,000.00	35,956.40
NORTHERN OIL AND GAS INC	60,000.00	61,956.60
NORTHRIVER MIDSTREAM FIN	50,000.00	49,351.12
NOVELIS CORP	200,000.00	186,770.00
NOVELIS CORP	100,000.00	93,510.00
NRG ENERGY INC	150,000.00	150,653.25
NRG ENERGY INC	100,000.00	96,383.00
NRG ENERGY INC	100,000.00	85,448.50
NUSTAR LOGISTICS LP	100,000.00	101,077.00
NUSTAR LOGISTICS LP	50,000.00	50,017.50
NUSTAR LOGISTICS LP	20,000.00	19,390.10
NUSTAR LOGISTICS LP	50,000.00	49,690.25

OCCIDENTAL PETROLEUM COR	170,000.00	185,517.60	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	100,000.00	103,844.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	200,000.00	230,323.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	200,000.00	215,255.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	200,000.00	220,340.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	200,000.00	215,368.00	
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	70,000.00	77,700.00	
OLIN CORP	50,000.00	48,088.25	
ON SEMICONDUCTOR CORP	50,000.00	46,436.00	
ONEMAIN FINANCE CORP	100,000.00	89,623.00	
ONEMAIN FINANCE CORP	50,000.00	42,863.50	
ONEMAIN FINANCE CORP	100,000.00	83,838.00	
OPEN TEXT HOLDINGS INC	100,000.00	90,831.00	
OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD	100,000.00	90,378.50	
OPEN TEXT/OPEN TEXT HOLD	50,000.00	44,576.00	
OPTION CARE HEALTH INC	50,000.00	45,520.75	
ORGANON FINANCE 1 LLC	200,000.00	186,500.00	
ORGANON FINANCE 1 LLC	200,000.00	183,336.00	
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	50,000.00	47,555.25	
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	50,000.00	45,293.25	
OWENS & MINOR INC	70,000.00	64,485.75	
OWENS-BROCKWAY	75,000.00	73,044.75	
PANTHER BF AGGREGATOR 2	44,000.00	44,993.74	
PANTHER BF AGGREGATOR 2	160,000.00	161,200.00	
PAR PHARMACEUTICAL INC	200,000.00	188,288.00	
PARAMOUNT GLOBAL	100,000.00	98,000.00	
PARK INTERMED HOLDINGS	70,000.00	68,772.20	
PARK INTERMED HOLDINGS	50,000.00	45,934.50	
PARKLAND CORP/CANADA	100,000.00	89,250.00	
PARTY CITY HOLDINGS INC	40,000.00	37,548.20	
PATTERN ENERGY OP LP/PAT	50,000.00	47,812.50	
PATTERSON-UTI ENERGY INC	50,000.00	45,843.98	
PBF HOLDING CO LLC	80,000.00	82,416.00	
PBF HOLDING CO LLC	30,000.00	28,458.90	
PBF HOLDING CO LLC	50,000.00	42,587.25	
PDC ENERGY INC	20,000.00	20,054.00	
PEARL MERGER SUB INC	84,000.00	83,687.10	
PECF USS INTERMEDIATE HO	40,000.00	37,969.60	
PENINSULA PACIFIC ENTERT	40,000.00	44,044.60	
PENNYMAC FIN SVCS INC	100,000.00	95,608.00	
PENNYMAC FIN SVCS INC	80,000.00	66,409.60	
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP	50,000.00	43,535.00	

PERFORMANCE FOOD GROUP I	100,000.00	97,958.00
PERFORMANCE FOOD GROUP I	100,000.00	88,780.00
PG&E CORP	120,000.00	110,511.00
PGT INNOVATIONS INC	50,000.00	44,478.50
PHOTO HOLDINGS MERGER SU	100,000.00	95,002.00
PIKE CORP	60,000.00	55,562.10
PILGRIM'S PRIDE CORP	200,000.00	202,279.00
PILGRIM'S PRIDE CORP	50,000.00	43,107.75
PLANTRONICS INC	70,000.00	71,482.25
PLAYTIKA HOLDING CORP	50,000.00	45,715.75
PM GENERAL PURCHASER LLC	60,000.00	58,566.30
PMHC II INC	80,000.00	66,851.60
POST HOLDINGS INC	100,000.00	95,970.00
POST HOLDINGS INC	180,000.00	167,625.00
POST HOLDINGS INC	50,000.00	43,245.00
POST HOLDINGS INC	50,000.00	42,593.75
POWERTEAM SERVICES LLC	100,000.00	97,119.00
PREMIER ENTERTAINMENT SU	50,000.00	40,939.50
PREMIER ENTERTAINMENT SU	70,000.00	56,613.20
PRESIDIO HOLDING INC	100,000.00	95,605.50
PRESTIGE BRANDS INC	80,000.00	68,522.80
PRIME HEALTHCARE SERVICE	50,000.00	51,104.00
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	250,000.00	249,573.75
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	120,000.00	118,270.80
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	150,000.00	138,972.00
PRIMO WATER HOLDINGS INC	80,000.00	70,500.00
PROG HOLDINGS INC	70,000.00	63,262.50
PTC INC	30,000.00	28,126.04
PUMA INTERNATIONAL FINAN	200,000.00	187,968.00
QUICKEN LOANS LLC/QUICKN	100,000.00	84,805.00
QVC INC	100,000.00	91,835.50
RACKSPACE TECHNOLOGY	50,000.00	43,440.00
RACKSPACE TECHNOLOGY	50,000.00	41,719.00
RADIAN GROUP INC	70,000.00	72,357.60
RADIATE HOLDCO / FINANCE	100,000.00	94,008.50
RADIATE HOLDCO / FINANCE	100,000.00	91,127.00
RADIOLOGY PARTNERS INC	50,000.00	48,521.00
RAKUTEN GROUP INC	200,000.00	186,000.00
RANGE RESOURCES CORP	50,000.00	48,517.00
RATTLER MIDSTREAM LP	100,000.00	100,383.00
REAL HERO MERGER SUB 2	70,000.00	59,756.20
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	100,000.00	88,651.00
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	50,000.00	42,008.50

REDWOOD STAR MERGER SUB	50,000.00	47,055.00	
REGIONALCARE/LIFEPOINT	130,000.00	136,464.90	
RENEWABLE ENERGY GROUP I	50,000.00	53,250.00	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	100,000.00	88,645.50	
RHP HOTEL PPTY/ RHP FINA	50,000.00	47,286.50	
RHP HOTEL PPTY/RHP FINAN	70,000.00	64,444.80	
RITCHIE BROS HLDGS INC	50,000.00	46,438.25	
RITE AID CORP	100,000.00	87,367.50	
RITE AID CORP	70,000.00	61,512.50	
RLJ LODGING TRUST LP	50,000.00	44,851.00	
ROBLOX CORP	100,000.00	86,892.00	
ROCKCLIFF ENERGY II LLC	50,000.00	49,069.50	
ROCKET SOFTWARE INC	40,000.00	34,865.80	
ROCKETMTGE CO-ISSUER INC	100,000.00	90,605.50	
ROCKETMTGE CO-ISSUER INC	100,000.00	81,952.00	
ROCKIES EXPRESS PIPELINE	50,000.00	47,594.00	
ROLLER BEARING CO OF AME	50,000.00	45,750.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	140,000.00	145,208.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	72,000.00	78,739.56	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	150,000.00	142,528.50	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES	100,000.00	94,323.00	
RP ESCROW ISSUER LLC	70,000.00	67,216.10	
SABRE GLBL INC	80,000.00	86,864.40	
SBA COMMUNICATIONS CORP	150,000.00	143,081.25	
SBA COMMUNICATIONS CORP	100,000.00	87,388.00	
SC GAMES HOLDIN/US FINCO	50,000.00	48,575.75	
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	50,000.00	51,875.00	
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	80,000.00	84,200.00	
SCIH SALT HOLDINGS INC	50,000.00	44,826.25	
SCIH SALT HOLDINGS INC	70,000.00	58,567.95	
SCRIPPS ESCROW II INC	70,000.00	63,416.50	
SEAGATE HDD CAYMAN	140,000.00	120,137.50	
SEASPAN CORP	30,000.00	27,298.80	
SEAWORLD PARKS & ENTERTA	70,000.00	65,411.85	
SELECT MEDICAL CORP	150,000.00	150,798.00	
SENIOR HOUSING PROPERTIE	50,000.00	43,706.00	
SENSATA TECHNOLOGIES INC	150,000.00	128,424.75	
SERVICE CORP INTL	30,000.00	29,385.60	
SERVICE CORP INTL	50,000.00	49,159.50	
SERVICE CORP INTL	50,000.00	43,633.25	
SERVICE CORP INTL	100,000.00	89,770.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	60,000.00	61,740.90	

SIMMONS FOOD INC/SIMMONS	60,000.00	54,978.60
SINCLAIR TELEVISION GROU	30,000.00	25,155.60
SINCLAIR TELEVISION GROU	50,000.00	42,513.75
SIRIUS XM RADIO INC	30,000.00	27,756.90
SIRIUS XM RADIO INC	200,000.00	195,000.00
SIRIUS XM RADIO INC	100,000.00	97,469.00
SIRIUS XM RADIO INC	300,000.00	258,069.00
SIX FLAGS ENTERTAINMENT	30,000.00	29,639.10
SLM CORP	50,000.00	48,824.00
SONIC AUTOMOTIVE INC	100,000.00	88,188.00
SOUTHWESTERN ENERGY	40,000.00	39,788.00
SOUTHWESTERN ENERGY CO	100,000.00	100,395.50
SOUTHWESTERN ENERGY CO	100,000.00	96,754.00
SPECIALTY BUILDING PRODU	100,000.00	100,349.00
SPIRIT AEROSYSTEMS INC	30,000.00	29,916.00
SPIRIT AEROSYSTEMS INC	100,000.00	102,360.00
SPIRIT AEROSYSTEMS INC	60,000.00	53,921.40
SPRINGLEAF FINANCE CORP	50,000.00	51,567.25
SPRINGLEAF FINANCE CORP	220,000.00	202,334.00
SPRINT CORP	120,000.00	131,707.50
SQUARE INC	150,000.00	138,165.75
SRM ESCROW ISSUER LLC	100,000.00	97,389.00
SRS DISTRIBUTION INC	100,000.00	93,425.50
SRS DISTRIBUTION INC	60,000.00	54,000.00
SS&C TECHNOLOGIES INC	200,000.00	198,078.00
SSL ROBOTICS LLC	36,000.00	38,476.44
STANDARD INDUSTRIES INC	150,000.00	139,762.50
STANDARD INDUSTRIES INC	100,000.00	88,567.00
STAPLES INC	130,000.00	125,704.15
STAPLES INC	80,000.00	71,845.20
STATION CASINOS LLC	30,000.00	27,534.00
STATION CASINOS LLC	70,000.00	61,045.95
STERICYCLE INC	50,000.00	50,396.00
STRATHCONA RESOURCES	30,000.00	30,047.10
SUBURBAN PROPANE PARTNRS	50,000.00	46,186.25
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	50,000.00	47,460.00
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	100,000.00	94,562.50
SUNOCO LP/FINANCE CORP	150,000.00	151,132.50
SUNOCO LP/FINANCE CORP	50,000.00	45,221.87
SUPERIOR PLUS/GEN PRTRN	70,000.00	65,086.00
SURGERY CENTER HOLDINGS	50,000.00	52,423.00
SWF ESCROW ISSUER CORP	40,000.00	33,150.40
SWITCH LTD	100,000.00	95,116.50

SYNEOS HEALTH INC	50,000.00	44,584.50	
T-MOBILE USA INC	200,000.00	185,784.00	
T-MOBILE USA INC	200,000.00	187,728.00	
T-MOBILE USA INC	180,000.00	180,779.40	
T-MOBILE USA INC	150,000.00	137,212.50	
T-MOBILE USA INC	120,000.00	108,442.50	
T-MOBILE USA INC	100,000.00	90,368.75	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	70,000.00	25,312.35	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	50,000.00	47,875.00	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	100,000.00	94,073.00	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	70,000.00	65,026.50	
TALOS PRODUCTION INC	80,000.00	86,490.80	
TAP ROCK RESOURCES LLC	50,000.00	51,278.00	
TAYLOR MORRISON COMM	50,000.00	46,610.00	
TAYLOR MORRISON COMM/MON	50,000.00	50,150.50	
TECHNIPFMC PLC	34,000.00	35,208.02	
TEGNA INC	100,000.00	98,970.00	
TEGNA INC	150,000.00	146,842.50	
TELEFLEX INC	30,000.00	29,413.50	
TELEFLEX INC	50,000.00	47,550.00	
TELENET FINANCE LUX NOTE	200,000.00	194,000.00	
TELESAT CANADA/TELESAT L	50,000.00	36,146.50	
TELESAT CANADA/TELESAT L	30,000.00	13,849.20	
TEMPUR SEALY INTL INC	50,000.00	44,575.00	
TEMPUR SEALY INTL INC	80,000.00	67,680.00	
TENET HEALTHCARE CORP	100,000.00	99,448.50	
TENET HEALTHCARE CORP	100,000.00	101,234.00	
TENET HEALTHCARE CORP	300,000.00	300,853.50	
TENET HEALTHCARE CORP	200,000.00	193,502.00	
TENET HEALTHCARE CORP	200,000.00	199,864.00	
TENNECO INC	100,000.00	97,769.00	
TEREX CORP	50,000.00	46,434.50	
TERRAFORM POWER OPERATIN	100,000.00	92,588.00	
TERRIER MEDIA BUYER INC	100,000.00	98,970.00	
THOR INDUSTRIES	70,000.00	59,762.50	
TITAN ACQ/CO-BORROWER	40,000.00	39,154.80	
TKC HOLDINGS INC	60,000.00	59,556.00	
TOPBUILD CORP	70,000.00	61,687.15	
TOWNSQUARE MEDIA INC	80,000.00	81,641.20	
TRANSDIGM INC	200,000.00	208,310.00	
TRANSDIGM INC	280,000.00	282,304.40	
TRANSDIGM INC	150,000.00	153,393.00	

TRANSDIGM INC	100,000.00	94,363.00
TRANSDIGM INC	100,000.00	90,162.00
TRANSDIGM INC	100,000.00	90,125.00
TRANSOCEAN INC	60,000.00	61,350.00
TRAVEL + LEISURE CO	70,000.00	63,783.30
TREEHOUSE FOODS INC	40,000.00	33,660.40
TRINET GROUP INC	30,000.00	27,038.10
TRINSEO OP / TRINSEO FIN	30,000.00	29,148.45
TRITON WATER HOLDINGS IN	90,000.00	74,388.60
TRIUMPH GROUP INC	100,000.00	104,970.00
TRIUMPH GROUP INC	50,000.00	49,183.25
TRONOX INC	100,000.00	91,064.00
TWILIO INC	100,000.00	89,889.00
TWITTER INC	20,000.00	19,222.60
TWITTER INC	100,000.00	98,046.00
UBER TECHNOLOGIES INC	50,000.00	52,836.00
UBER TECHNOLOGIES INC	150,000.00	158,481.00
UBER TECHNOLOGIES INC	220,000.00	221,546.60
UNICREDIT SPA	200,000.00	181,478.38
UNIFRAX ESCROW ISS CORP	40,000.00	35,557.00
UNITED AIRLINES INC	100,000.00	97,352.00
UNITED AIRLINES INC	180,000.00	168,978.60
UNITED NATURAL FOODS INC	30,000.00	30,259.35
UNITED RENTALS NORTH AM	150,000.00	149,330.25
UNITED RENTALS NORTH AM	80,000.00	73,052.00
UNITED RENTALS NORTH AM	100,000.00	88,817.00
UNITED STATES STEEL CORP	100,000.00	102,371.00
UNITED WHOLESALE MTGE LL	100,000.00	87,552.00
UNITED WHOLESALE MTGE LL	50,000.00	42,191.25
UNITI GROUP/CSL CAPITAL	70,000.00	63,784.35
UNITI GROUP/CSL CAPITAL	120,000.00	107,552.40
UNITI GRP/UNITI HLD/CSL	120,000.00	123,000.00
UNITI GRP/UNITI HLD/CSL	30,000.00	25,390.50
UNIVISION COMMUNICATIONS	80,000.00	81,308.80
UNIVISION COMMUNICATIONS	100,000.00	90,648.00
UPC HOLDING BV	200,000.00	193,827.00
URBAN ONE INC	100,000.00	98,335.00
US ACUTE CARE SOLUTIONS	50,000.00	49,108.25
US FOODS INC	20,000.00	18,729.30
US FOODS INC	100,000.00	90,702.50
US RENAL CARE INC	50,000.00	44,771.50
USA COM PART/USA COM FIN	70,000.00	69,251.00
USA COM PART/USA COM FIN	70,000.00	69,379.80

USI INC	30,000.00	29,821.20	
VALEANT PHARMACEUTICALS	300,000.00	300,135.00	
VALVOLINE INC	90,000.00	80,263.80	
VECTOR GROUP LTD	30,000.00	30,870.15	
VECTOR GROUP LTD	100,000.00	89,119.50	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	100,000.00	93,270.00	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	100,000.00	92,638.50	
VENTURE GLOBAL CALCASIEU	100,000.00	89,720.00	
VERICAST MERGER SUB INC	90,300.00	86,602.21	
VERITAS US INC/BERMUDA L	190,000.00	170,343.55	
VERSCEND HOLDING CORP	60,000.00	62,409.90	
VERTIV GROUP CORPORATION	100,000.00	88,122.50	
VIASAT INC	30,000.00	28,812.30	
VIASAT INC	100,000.00	96,694.00	
VICI PROPERTIES / NOTE	190,000.00	185,053.35	
VICI PROPERTIES / NOTE	150,000.00	141,988.50	
VICI PROPERTIES / NOTE	100,000.00	96,469.00	
VICTORIA'S SECRET & CO	70,000.00	61,687.50	
VICTORS MERGER CORP	70,000.00	49,117.95	
VIDTRON LTD/VIDTRON LTEE	50,000.00	44,811.25	
VIKING CRUISES LTD	50,000.00	55,122.25	
VIKING CRUISES LTD	90,000.00	78,750.00	
VIKING CRUISES LTD	40,000.00	36,460.80	
VINE ENERGY HOLDINGS LLC	150,000.00	153,597.00	
VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000.00	191,046.00	
VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000.00	177,255.00	
VISTAJET MALTA/XO MGMT	80,000.00	72,922.00	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	40,000.00	40,221.40	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	150,000.00	149,019.75	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	120,000.00	116,064.00	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	100,000.00	92,249.00	
VOC ESCROW LTD	50,000.00	46,360.00	
VODAFONE GROUP PLC	150,000.00	162,549.00	
VODAFONE GROUP PLC	100,000.00	91,467.90	
VODAFONE GROUP PLC	50,000.00	43,450.25	
VZ SECURED FINANCING BV	200,000.00	178,992.00	
W & T OFFSHORE INC	50,000.00	49,696.17	
WASH MULTIFAM ACQ INC	50,000.00	48,948.50	
WASTE PRO USA INC	30,000.00	27,139.65	
WATCO COS LLC/FINANCE CO	60,000.00	57,985.10	
WEATHERFORD INTERNATIONA	70,000.00	71,204.00	
WEATHERFORD INTERNATIONA	150,000.00	151,455.00	

小計	WESCO DISTRIBUTION INC	220,000.00	230,637.00	
	WEST CORP	42,000.00	37,708.44	
	WESTERN MIDSTREAM OPERAT	50,000.00	48,150.00	
	WESTERN MIDSTREAM OPERAT	100,000.00	94,887.50	
	WEWORK COS INC	60,000.00	52,650.00	
	WEWORK COS LLC/WW CO-OBL	40,000.00	32,669.60	
	WHITE CAP BUYER LLC	60,000.00	55,879.20	
	WILLIAMS SCOTSMAN INTL	60,000.00	57,490.20	
	WMG ACQUISITION CORP	100,000.00	90,884.50	
	WMG ACQUISITION CORP	40,000.00	36,250.40	
	WOLVERINE ESCROW LLC	100,000.00	68,801.00	
	WOLVERINE WORLD WIDE	50,000.00	43,688.75	
	WR GRACE HOLDING LLC	100,000.00	95,250.00	
	WR GRACE HOLDING LLC	100,000.00	88,375.00	
	WW INTERNATIONAL INC	70,000.00	57,182.65	
	WYNDHAM DESTINATIONS INC	20,000.00	20,710.70	
	WYNDHAM HOTELS & RESORTS	50,000.00	47,030.00	
	WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	90,000.00	85,023.00	
	WYNN MACAU LTD	200,000.00	174,340.00	
	WYNN MACAU LTD	200,000.00	159,500.00	
	WYNN RESORTS FINANCE LLC	100,000.00	103,942.00	
	WYNN RESORTS FINANCE LLC	50,000.00	44,760.00	
	XEROX HOLDINGS CORP	100,000.00	97,575.50	
	XEROX HOLDINGS CORP	20,000.00	18,426.70	
	XHR LP	50,000.00	46,239.50	
	XPO LOGISTICS INC	54,000.00	55,814.40	
	YUM! BRANDS INC	200,000.00	192,566.00	
	ZI TECH LLC/ZI FIN CORP	50,000.00	45,177.25	
	ZIPRECRUITER INC	70,000.00	66,504.90	
	銘柄数：839	82,490,300.00	77,584,084.33	
			(9,981,192,449)	
	組入時価比率：97.2%		100.0%	
	合計		9,981,192,449	
		(9,981,192,449)		

(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	2022年 4月22日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
買建	315,941,720	—	316,447,394	505,674
米ドル	315,941,720	—	316,447,394	505,674
合計	315,941,720	—	316,447,394	505,674

(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。

J-REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	988,701,522
投資証券	41,798,451,500
派生商品評価勘定	71,349,300
未収配当金	349,870,047
差入委託証拠金	9,362,690
流動資産合計	43,217,735,059
資産合計	43,217,735,059
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	231,660
未払金	26,757,000
未払解約金	102,223,215
未払利息	296
流動負債合計	129,212,171
負債合計	129,212,171
純資産の部	
元本等	
元本	15,980,605,892
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	27,107,916,996
元本等合計	43,088,522,888
純資産合計	43,088,522,888
負債純資産合計	43,217,735,059

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。 受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 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）

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.6963円
(10,000口当たり純資産額)	(26,963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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考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

2022年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	16,577,285,389円
同期中における追加設定元本額	4,277,181,917円
同期中における一部解約元本額	4,873,861,414円
期末元本額	15,980,605,892円
期末元本額の内訳※	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,716,962,318円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,230,180,929円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	915,596,955円
野村資産設計ファンド2015	14,074,278円
野村資産設計ファンド2020	14,412,519円
野村資産設計ファンド2025	18,473,099円
野村資産設計ファンド2030	20,307,068円
野村資産設計ファンド2035	20,878,808円
野村資産設計ファンド2040	38,174,048円
野村資産設計ファンド2045	4,607,505円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,128,119,317円
ネクストコア	6,146,109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	1,168,307,210円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	1,597,508,279円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	439,271,874円
野村資産設計ファンド2050	4,837,994円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	937,624円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	681,853円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	5,369,198円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,197,904円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	3,904,898円
野村6資産均等バランス	2,218,750,093円
野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	96,162,475円
野村資産設計ファンド2060	3,181,526円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	226,164,293円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用）	83,196,838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）	8,362,185円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,691,016,314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）	14,369,469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）	483,412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）	11,379,921円
野村DC運用戦略ファンド	190,576,578円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	14,677,623円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	9,565,576円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	4,394,784円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	10,375,834円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	5,922,991円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	6,247,821円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,537,736円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,481,267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）	31,809,369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(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考

投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	763	102,318,300	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,199	119,780,100	
		S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	1,762	273,638,600	
		東海道リート投資法人 投資証券	290	33,379,000	
		日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,308	839,736,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,453	660,825,200	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,376	1,001,011,200	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,786	1,347,816,000	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,710	571,810,000	
		アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,018	838,479,000	
		G L P投資法人 投資証券	12,264	2,143,747,200	
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,762	574,412,000	
		日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,196	2,258,442,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投資証券	635	426,085,000	
		O n e リート投資法人 投資証券	657	184,748,400	
		イオンリート投資法人 投資証券	4,453	664,832,900	
		ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,533	574,819,100	
		日本リート投資法人 投資証券	1,168	439,752,000	
		積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,495	910,404,000	
		トーセイ・リート投資法人 投資証券	791	106,626,800	
		ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,512	418,824,000	
		ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	928	148,201,600	
		サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	858	111,196,800	
		野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,246	2,023,039,200	
		いちごホテルリート投資法人 投資	627	57,119,700	

証券			
ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,636	821,035,600	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	3,913	237,519,100	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	443	58,963,300	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,492	829,552,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	611	42,586,700	
投資法人みらい 投資証券	4,587	238,982,700	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	888	116,328,000	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,100	510,400,000	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,467	287,238,600	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	611	76,680,500	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,493	177,816,300	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,477	233,809,100	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,415	3,019,860,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,787	2,374,449,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	19,106	2,002,308,800	
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,545	1,333,201,500	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,588	1,031,318,000	
NTT都市開発リート投資法人	3,630	569,910,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,539	470,984,500	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,630	300,083,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,525	1,228,452,500	
森トラスト総合リート投資法人 投	2,706	384,522,600	

小計	資証券			
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	16,667	733,348,000	
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,328	678,608,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証券	2,453	369,667,100	
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,553	819,513,000	
	福岡リート投資法人 投資証券	1,958	323,853,200	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,171	829,068,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,103	270,581,600	
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	801	583,929,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,710	257,697,000	
	スターツプロシード投資法人 投資証券	590	138,414,000	
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,686	1,791,090,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	11,601	777,267,000	
	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,117	584,873,100	
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,514	463,496,600	
	銘柄数：61	221,231	41,798,451,500	
	組入時価比率：97.0%		100.0%	
合計		41,798,451,500		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 4月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				

買建	1,213,106,190	—	1,284,295,000	71,117,640
合計	1,213,106,190	—	1,284,295,000	71,117,640

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	305,451,320
コール・ローン	234,438,900
投資証券	59,154,501,355
派生商品評価勘定	12,072,604
未収配当金	41,925,909
差入委託証拠金	217,574,442
流動資産合計	59,965,964,530
資産合計	59,965,964,530
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,479,475
未払解約金	93,036,885
未払利息	70
その他未払費用	250,100
流動負債合計	94,766,530
負債合計	94,766,530
純資産の部	
元本等	
元本	16,057,199,759
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	43,813,998,241
元本等合計	59,871,198,000
純資産合計	59,871,198,000
負債純資産合計	59,965,964,530

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引

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

2022年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	3,7286円
(10,000口当たり純資産額)	(37,286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 2021年 4月23日 至 2022年 4月22日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

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

2022年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 4月22日現在	
期首	2021年 4月23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	14,118,822,282円
同期中における追加設定元本額	5,489,169,713円
同期中における一部解約元本額	3,550,792,236円
期末元本額	16,057,199,759円
期末元本額の内訳※	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,319,918,827円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	1,714,436,861円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	703,866,991円
野村資産設計ファンド2015	10,819,664円

野村資産設計ファンド2020	11,079,659円
野村資産設計ファンド2025	14,201,049円
野村資産設計ファンド2030	15,611,076円
野村資産設計ファンド2035	16,050,572円
野村資産設計ファンド2040	29,346,370円
野村資産設計ファンド2045	3,542,031円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,602,681,037円
ネクストコア	3,358,623円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	410,362,489円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	687,024,454円
野村資産設計ファンド2050	3,719,223円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,871,187円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,532,803円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	10,475,567円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,879,283円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	10,581,917円
野村6資産均等バランス	1,705,668,193円
野村資産設計ファンド2060	2,445,813円
NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	4,231,218,254円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	2,582,650,495円
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA（適格機関投資家専用）	738,762,357円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT（適格機関投資家専用）	63,377,549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）	371,623円
野村DC運用戦略ファンド	104,607,793円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	7,281,183円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	7,353,557円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,378,501円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	7,976,448円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	4,553,310円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	4,803,023円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,950,891円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,138,728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）	16,302,358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(2022年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	24,900	533,856.00	
		AGREE REALTY CORP	19,600	1,406,104.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	20,000	453,400.00	
		ALEXANDERS INC	620	163,140.60	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	40,440	8,074,250.40	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,700	51,921.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,300	527,098.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	38,600	2,499,350.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	82,000	3,532,560.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	73,700	2,092,343.00	
		APARTMENT INCOME REIT CO	43,500	2,394,240.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	43,000	300,140.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	58,300	1,037,157.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	18,300	269,010.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,200	78,108.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	38,800	9,933,188.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7,900	209,350.00	
		BOSTON PROPERTIES	39,600	5,034,348.00	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	16,000	97,760.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	47,400	612,408.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	82,300	2,179,304.00	
		BROADSTONE NET LEASE INC-A	45,100	1,012,044.00	
		BRT APARTMENTS CORP	3,500	82,635.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	28,470	4,857,836.10	
		CARETRUST REIT INC ACQUIRES	26,700	456,837.00	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,200	224,712.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	3,200	90,720.00	
		CENTERSPACE	4,200	433,314.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	13,000	182,130.00	
		CITY OFFICE REIT INC	12,400	199,516.00	
		CLIPPER REALTY INC	4,000	36,640.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,600	265,848.00	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	31,600	889,856.00	

COUSINS PROPERTIES INC	41,100	1,622,628.00	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	5,200	38,740.00	
CTO REALTY GROWTH INC	1,600	103,984.00	
CUBESMART	60,800	3,260,704.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	60,000	618,000.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	78,810	11,848,295.40	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	141,000	999,690.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	68,000	177,480.00	
DOUGLAS EMMETT INC	48,600	1,533,330.00	
DUKE REALTY CORP	105,900	6,460,959.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	24,300	496,935.00	
EASTGROUP PROPERTIES	11,240	2,397,829.20	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	39,000	345,150.00	
EPR PROPERTIES	21,000	1,164,030.00	
EQUINIX INC	24,990	18,933,173.70	
EQUITY COMMONWEALTH	31,000	836,690.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	48,000	3,971,520.00	
EQUITY RESIDENTIAL	94,800	8,839,152.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	34,100	888,305.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,160	6,525,069.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	37,200	8,072,772.00	
FARMLAND PARTNERS INC	8,000	123,200.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,800	2,480,742.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	36,000	2,304,720.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	21,800	650,512.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	138,750.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	65,200	3,096,348.00	
GETTY REALTY CORP	10,800	310,500.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,400	234,936.00	
GLADSTONE LAND CORP	8,700	345,129.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17,200	275,200.00	
GLOBAL NET LEASE INC	29,800	453,854.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	41,300	1,175,811.00	

HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	61,200	1,959,012.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	150,200	5,317,080.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,600	91,680.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	29,300	1,314,691.00	
HOTEL HOTELS & RESORTS INC	198,500	4,097,040.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	42,800	1,092,256.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	60,700	1,708,705.00	
INDUS REALTY TRUST INC	1,800	131,832.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	18,000	368,820.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	7,470	1,185,787.80	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	18,900	582,687.00	
INVITATION HOMES INC	166,100	7,268,536.00	
IRON MOUNTAIN INC	80,500	4,635,190.00	
JBG SMITH PROPERTIES	31,300	869,201.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	210,000	155,400.00	
KILROY REALTY CORP	29,100	2,180,754.00	
KIMCO REALTY CORP	170,900	4,436,564.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	60,100	1,360,063.00	
LIFE STORAGE INC	22,790	3,377,933.80	
LTC PROPERTIES INC	11,200	409,472.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	78,900	1,035,957.00	
MACERICH CO /THE	58,400	817,600.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	489,515	313,289.60	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	165,900	3,372,747.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	32,100	6,819,966.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	48,700	2,340,035.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	22,900	1,492,164.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	12,500	692,250.00	
NETSTREIT CORP	11,400	265,506.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,400	576,512.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	13,200	328,944.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	66,200	1,821,162.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,200	131,754.00	
ORION OFFICE REIT INC	15,500	209,250.00	

PARAMOUNT GROUP INC	47,000	484,100.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	65,900	1,302,843.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	36,000	892,800.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	15,000	8,700.00	
PHILLIPS EDISON & CO INC	31,800	1,146,072.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	60,300	1,066,104.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	35,400	599,676.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	9,600	244,608.00	
POSTAL REALTY TRUST INC-A	4,000	70,680.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	14,900	371,755.00	
PRIME US REIT	170,000	129,200.00	
PROLOGIS INC	205,640	35,119,199.20	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	5,640	963,030.00	
PUBLIC STORAGE	42,350	17,472,339.50	
REALTY INCOME CORP	157,100	11,713,376.00	
REGENCY CENTERS CORP	42,800	3,103,428.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	33,100	648,429.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	44,500	3,677,925.00	
RLJ LODGING TRUST	47,300	666,457.00	
RPT REALTY	23,700	334,170.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,400	1,486,562.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	62,700	780,615.00	
SAFEHOLD INC	3,900	181,935.00	
SAUL CENTERS INC	3,400	186,932.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	9,300	107,880.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	46,000	404,800.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	91,200	11,933,520.00	
SITE CENTERS CORP	48,900	822,009.00	
SL GREEN REALTY CORP	17,700	1,332,102.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	35,300	1,673,220.00	
STAG INDUSTRIAL INC	48,700	2,013,745.00	
STORE CAPITAL CORP	68,000	2,061,080.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	30,000	290,700.00	
SUN COMMUNITIES INC	32,290	6,154,151.10	

小計	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	60,000	732,000.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	29,300	515,387.00	
	TERRENO REALTY CORP	20,900	1,650,055.00	
	THE NECESSITY RETAIL REIT WHERE AMERICA	34,000	274,380.00	
	UDR INC	83,300	4,952,185.00	
	UMH PROPERTIES INC	12,300	305,040.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,700	214,526.00	
	URBAN EDGE PROPERTIES	30,600	598,842.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	8,400	155,148.00	
	VENTAS INC	111,100	6,668,222.00	
	VERIS RESIDENTIAL INC	21,800	366,894.00	
	VICI PROPERTIES INC	175,200	5,277,024.00	
	VORNADO REALTY TRUST	44,100	1,849,113.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	23,800	618,800.00	
	WELLTOWER INC	120,900	11,763,570.00	
	WHITESTONE REIT	14,000	186,200.00	
	WP CAREY INC	53,000	4,526,200.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	31,000	605,430.00	
	銘柄数：153	7,184,425	354,398,263.00	
			(45,593,336,534)	
	組入時価比率：76.2%		77.1%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	17,100	757,530.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	18,000	243,540.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	6,000	84,840.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,300	361,053.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	9,000	38,520.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	23,800	1,238,076.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	44,000	683,320.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	13,200	241,560.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	266,742.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	522,060.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,700	179,091.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,000	52,580.00	

小計	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	30,800	536,536.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,100	900,445.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	40,000	526,400.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	4,000	35,560.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,100	292,230.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	15,900	338,670.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,000	102,100.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,800	110,200.00	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	6,000	81,420.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	30,000	413,700.00	
	PLAZA RETAIL REIT	12,000	59,160.00	
	PRIMARIS REIT	13,425	192,783.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	41,600	1,033,760.00	
	SLATE GROCERY REIT	8,000	130,000.00	
	SLATE OFFICE REIT	8,000	41,440.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	20,100	654,456.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	26,000	552,500.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	14,000	98,840.00	
	銘柄数：30	511,525	10,769,112.00	
			(1,100,172,481)	
	組入時価比率：1.8%		1.9%	
ユーロ	AEDIFICA	10,100	1,171,600.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,000	56,200.00	
	ALTAREA	1,220	185,440.00	
	BEFIMMO S.C.A.	6,500	309,400.00	
	CARE PROPERTY INVEST	8,000	198,400.00	
	CARMILA	13,000	203,320.00	
	COFINIMMO	8,230	1,099,528.00	
	COIMA RES SPA	6,000	50,040.00	
	COVIVIO	13,200	980,760.00	
	CROMWELL REIT EUR	81,000	186,300.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	10,600	270,724.00	
	GECINA SA	15,100	1,712,340.00	
	HAMBORNER REIT AG	20,000	192,800.00	
	HIBERNIA REIT PLC	180,000	291,960.00	

小計	ICADE	9,000	554,400.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	14,000	64,820.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	77,000	638,330.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	6,800	193,800.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	120,000	178,800.00	
	KLEPIERRE	53,900	1,274,735.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	16,000	82,240.00	
	MERCIALYS	13,000	122,785.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	92,000	998,200.00	
	MONTEA	2,780	328,040.00	
	NSI NV	5,000	186,250.00	
	RETAIL ESTATES	3,300	247,170.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	32,200	2,305,520.00	
	VASTNED RETAIL NV	5,200	132,080.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	38,900	1,559,112.00	
	WERELDHAVE NV	11,400	207,480.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,500	283,800.00	
	銘柄数：31	882,930	16,266,374.00	
			(2,267,044,544)	
	組入時価比率：3.8%		3.8%	
英ボンド	AEW UK REIT PLC	48,000	60,000.00	
	ASSURA PLC	830,000	562,325.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	47,400	717,636.00	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	213,000	244,524.00	
	BRITISH LAND	259,000	1,357,678.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	233,000	382,586.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	190,000	166,250.00	
	CUSTODIAN REIT PLC	120,000	120,960.00	
	DERWENT LONDON PLC	31,300	1,010,364.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	172,000	154,800.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	71,000	503,745.00	
	HAMMERSON PLC	970,000	310,012.00	
	HOME REIT PLC	150,000	189,300.00	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	105,750	132,187.50	
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	0.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	208,000	1,594,112.00	

小計	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	270,000	749,520.00	
	LXI REIT PLC	240,000	361,440.00	
	NEWRIVER REIT PLC	80,000	76,000.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	150,000	150,300.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	379,000	567,363.00	
	PRS REIT PLC/THE	162,000	172,044.00	
	REGIONAL REIT LTD	120,000	104,400.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	57,800	765,272.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	160,000	95,520.00	
	SEGRO PLC	334,800	4,610,196.00	
	SHAFTESBURY PLC	81,000	491,265.00	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	110,000	94,710.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	283,000	349,505.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	96,000	86,496.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	517,000	1,281,126.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	240,000	221,280.00	
	UNITE GROUP PLC	111,900	1,289,088.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	36,000	247,140.00	
	銘柄数：34	7,260,950	19,219,144.50	
			(3,219,014,512)	
	組入時価比率：5.4%		5.4%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	106,000	361,460.00	
	ARENA REIT	97,000	475,300.00	
	BWP TRUST	138,000	579,600.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	170,000	482,800.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	153,000	604,350.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	120,000	272,400.00	
	CHARTER HALL GROUP	131,000	2,084,210.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	173,000	937,660.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	142,000	620,540.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	93,000	378,510.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	410,000	356,700.00	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	60,000	207,600.00	
	DEXUS/AU	298,000	3,257,140.00	

小計	GDI PROPERTY GROUP	130,000	146,250.00	
	GOODMAN GROUP	472,400	11,039,988.00	
	GPT GROUP	531,000	2,729,340.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	80,000	358,400.00	
	HEALTHCO REIT	73,000	142,350.00	
	HOME CONSORTIUM LTD	52,000	383,240.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	402,000	586,920.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	56,000	225,120.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	105,000	507,150.00	
	IRONGATE GROUP	150,000	287,250.00	
	MIRVAC GROUP	1,089,000	2,678,940.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	298,000	804,600.00	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	100,000	94,500.00	
	RURAL FUNDS GROUP	103,000	316,210.00	
	SCENTRE GROUP	1,442,000	4,398,100.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	316,000	966,960.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	659,000	2,767,800.00	
	VICINITY CENTRES	1,070,000	2,059,750.00	
	WAYPOINT REIT	201,000	546,720.00	
	銘柄数：32	9,420,400	41,657,858.00	
			(3,941,666,523)	
	組入時価比率：6.6%		6.7%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	240,000	320,400.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	300,000	702,000.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	440,000	473,000.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	360,000	554,400.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	111,000	350,760.00	
	銘柄数：5	1,451,000	2,400,560.00	
小計			(207,408,384)	
	組入時価比率：0.3%		0.4%	
香港ドル	CHAMPION REIT	550,000	1,919,500.00	
	FORTUNE REIT	400,000	2,752,000.00	
	LINK REIT	585,000	39,780,000.00	
	PROSPERITY REIT	360,000	979,200.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	290,000	1,113,600.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT	602,800	1,922,932.00	

小計	TRUST			
	銘柄数：6	2,787,800	48,467,232.00	
			(794,862,604)	
	組入時価比率：1.3%		1.3%	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	130,000	183,300.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	369,869	314,388.65	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	930,762	2,708,517.42	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	549,956	626,949.84	
	CAPITALAND CHINA TRUST	320,279	377,929.22	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,411,694	3,246,896.20	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	200,000	268,000.00	
	EC WORLD REIT	60,000	39,600.00	
	ESR REIT	769,952	323,379.84	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	320,000	211,200.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	356,400	110,484.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	303,838	735,287.96	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	819,746	1,196,829.16	
	IREIT GLOBAL	141,212	89,669.62	
	KEPPEL DC REIT	365,211	759,638.88	
	KEPPEL REIT	560,000	677,600.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	479,400	376,329.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	599,716	1,139,460.40	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	541,900	1,452,292.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	879,980	1,601,563.60	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	590,000	725,700.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	690,216	286,439.64	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	108,000	532,440.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	140,000	116,900.00	
	SPH REIT	250,000	240,000.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	360,000	216,000.00	
	SUNTEC REIT	610,000	1,116,300.00	
小計	銘柄数：27	12,858,131	19,673,095.43	
			(1,853,402,320)	
	組入時価比率：3.1%		3.1%	

ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,000	86,560,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	42,000	302,400,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	7,000	43,540,000.00	
	JR REIT XXVII	34,000	197,540,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11,445	81,831,750.00	
	LOTTE REIT CO LTD	34,000	201,280,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	25,000	124,625,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	15,198	121,584,000.00	
	SK REITS CO LTD	18,000	123,840,000.00	
	小計	銘柄数：9	202,643	1,283,200,750.00
				(133,067,917)
		組入時価比率：0.2%		0.2%
	新シェケル	REIT 1 LTD	52,000	1,124,760.00
	小計	銘柄数：1	52,000	1,124,760.00
				(44,525,536)
		組入時価比率：0.1%		0.1%
合計				59,154,501,355
				(59,154,501,355)

(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	2022年 4月22日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	669,336,360	—	679,449,537	10,113,177
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	126,870,777	—	127,350,729	479,952
米ドル	126,870,777	—	127,350,729	479,952
合計	—	—	—	10,593,129

（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。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

インデックス・ブレンド（タイプⅠ）

2022年5月31日現在

I 資産総額	174,196,451円
II 負債総額	2,864,091円
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	171,332,360円
IV 発行済口数	149,839,956口
V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1434円

インデックス・ブレンド（タイプⅡ）

2022年5月31日現在

I 資産総額	92,681,551円
II 負債総額	1,466,856円
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	91,214,695円
IV 発行済口数	74,218,762口
V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2290円

インデックス・ブレンド（タイプⅢ）

2022年5月31日現在

I 資産総額	578,337,304円
II 負債総額	8,988,579円
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	569,348,725円
IV 発行済口数	431,317,462口
V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3200円

インデックス・ブレンド（タイプⅣ）

2022年5月31日現在

I 資産総額	134,143,820円
II 負債総額	2,232,727円
III 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	131,911,093円
IV 発行済口数	95,293,145口
V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3843円

インデックス・ブレンド（タイプV）

2022年5月31日現在

I 資産総額	447,290,781円
II 負債総額	7,322,117円
III 純資産総額（I－II）	439,968,664円
IV 発行済口数	290,587,321口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.5141円

（参考）国内株式マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	459,847,808,605円
II 負債総額	25,218,156,314円
III 純資産総額（I－II）	434,629,652,291円
IV 発行済口数	212,237,149,837口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.0478円

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAマザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	1,287,121,051,371円
II 負債総額	4,603,671,047円
III 純資産総額（I－II）	1,282,517,380,324円
IV 発行済口数	282,835,132,933口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.5345円

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	196,780,401,411円
II 負債総額	97,177,824,513円
III 純資産総額（I－II）	99,602,576,898円
IV 発行済口数	37,480,842,751口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.6574円

（参考）新興国株式マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	74,327,156,884円
II 負債総額	872,739,432円
III 純資産総額（I－II）	73,454,417,452円
IV 発行済口数	46,548,487,229口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.5780円

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	72,028,391,264円
II 負債総額	514,552,632円
III 純資産総額（I－II）	71,513,838,632円
IV 発行済口数	33,772,389,401口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.1175円

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	868,950,493,358円
II 負債総額	21,120,345,728円
III 純資産総額（I－II）	847,830,147,630円
IV 発行済口数	650,309,928,602口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3037円

（参考）外国債券マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	652,015,233,949円
II 負債総額	1,697,940,147円
III 純資産総額（I－II）	650,317,293,802円
IV 発行済口数	253,646,530,892口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.5639円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	162,186,394,232円

II 負債総額	81,211,208,012円
III 純資産総額（I－II）	80,975,186,220円
IV 発行済口数	73,248,610,125口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.1055円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	6,953,473,192円
II 負債総額	8,851,822円
III 純資産総額（I－II）	6,944,621,370円
IV 発行済口数	4,965,484,224口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3986円

（参考）新興国債券マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	24,642,443,313円
II 負債総額	614,791,198円
III 純資産総額（I－II）	24,027,652,115円
IV 発行済口数	12,604,792,211口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.9062円

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	7,404,506,677円
II 負債総額	230,479円
III 純資産総額（I－II）	7,404,276,198円
IV 発行済口数	4,940,239,857口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.4988円

（参考）J－REITインデックス マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	46,085,592,691円
II 負債総額	1,378,511,790円
III 純資産総額（I－II）	44,707,080,901円
IV 発行済口数	16,407,770,259口

V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.7248円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	53,709,462,412円
II 負債総額	326,790,513円
III 純資産総額（I－II）	53,382,671,899円
IV 発行済口数	16,133,118,321口
V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3089円

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

2022年5月31日現在

I 資産総額	13,878,143,990円
II 負債総額	7,151,095,940円
III 純資産総額（I－II）	6,727,048,050円
IV 発行済口数	3,906,403,523口
V 1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7221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。

第三部【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6月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

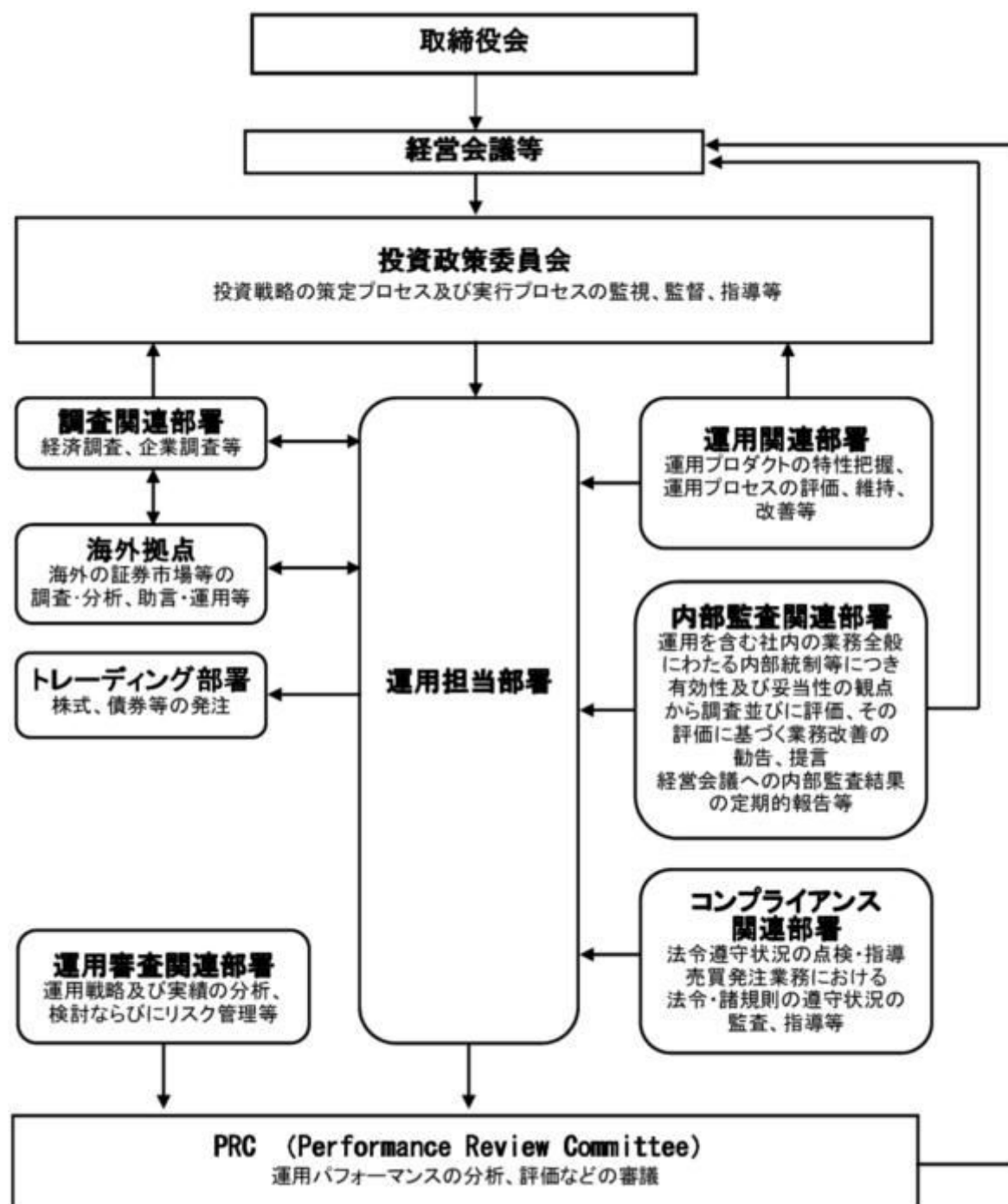
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2022年5月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

種類	本数	純資産総額(百万円)

追加型株式投資信託	1,007	38,742,985
単位型株式投資信託	196	743,186
追加型公社債投資信託	14	6,246,104
単位型公社債投資信託	510	1,398,981
合計	1,727	47,131,256

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

		前事業年度 (2021年3月31日)	当事業年度 (2022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		4,281	2,006
金銭の信託		35,912	35,894
有価証券		30,400	29,300
前払金		-	11
前払費用		167	454
未収入金		632	694
未収委託者報酬		24,499	27,176
未収運用受託報酬		4,347	4,002
短期貸付金		-	1,835
その他		268	57
貸倒引当金		△14	△15
流動資産計		100,496	101,417
固定資産			
有形固定資産		2,666	1,744
建物	※ 2	1,935	1,219
器具備品	※ 2	731	525
無形固定資産		5,429	5,210
ソフトウェア		5,428	5,209
その他		0	0

投資その他の資産			16,487		16,067
投資有価証券		1,767		2,201	
関係会社株式		9,942		9,214	
長期差入保証金		330		443	
長期前払費用		15		13	
前払年金費用		1,301		1,297	
繰延税金資産		3,008		2,784	
その他		122		112	
固定資産計			24,583		23,023
資産合計			125,080		124,440

		前事業年度 (2021年3月31日)		当事業年度 (2022年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			123		120
未払金			16,948		17,615
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		8		17	
未払手数料		7,256		8,357	
関係会社未払金		8,671		8,149	
その他未払金		1,011		1,089	
未払費用	※ 1		9,171		9,512
未払法人税等			2,113		1,319
前受収益			22		22
賞与引当金			3,795		4,416
その他			-		121
流動負債計			32,175		33,127
固定負債					
退職給付引当金			3,299		3,194
時効後支払損引当金			580		588
資産除去債務			1,371		1,123
固定負債計			5,250		4,905
負債合計			37,425		38,033
(純資産の部)					
株主資本			87,596		86,232
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,686		55,322
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		56,001		54,637	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		31,395		30,030	
評価・換算差額等			57		174
その他有価証券評価差額金			57		174
純資産合計			87,654		86,407
負債・純資産合計			125,080		124,440

(2) 【損益計算書】

		前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022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			106,355		115,733
運用受託報酬			16,583		17,671
その他営業収益			428		530
営業収益計			123,367		133,935
営業費用					
支払手数料			34,739		39,087
広告宣伝費			1,005		804
公告費			0		0
調査費			24,506		26,650
調査費		5,532		4,867	
委託調査費		18,974		21,783	
委託計算費			1,358		1,384
営業雑経費			4,149		3,094
通信費		73		72	
印刷費		976		918	
協会費		88		79	
諸経費		3,011		2,023	
営業費用計			65,760		71,021
一般管理費					
給料			10,985		12,033
役員報酬		147		229	
給料・手当		7,156		7,375	
賞与		3,682		4,427	
交際費			35		47
旅費交通費			64		65
租税公課			1,121		1,049
不動産賃借料			1,147		1,432
退職給付費用			1,267		1,212
固定資産減価償却費			2,700		2,525
諸経費			10,739		11,190
一般管理費計			28,063		29,556
営業利益			29,542		33,357

		前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	※ 1	4,540		3,530	

受取利息		0		10	
金銭の信託運用益		1,698		-	
その他		447		1,268	
営業外収益計			6,687		4,809
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,387	
時効後支払損引当金繰入額		13		12	
為替差損		26		23	
その他		32		266	
営業外費用計			72		1,689
経常利益			36,157		36,477
特別利益					
投資有価証券等売却益		71		26	
株式報酬受入益		48		53	
固定資産売却益		-		9	
資産除去債務履行差額		-		141	
移転補償金		2,077		-	
特別利益計			2,197		230
特別損失					
投資有価証券等売却損		-		0	
投資有価証券等評価損		36		-	
関係会社株式評価損		582		727	
固定資産除却損	※ 2	105		374	
資産除去債務履行差額		-		0	
事務所移転費用		406		54	
特別損失計			1,129		1,158
税引前当期純利益			37,225		35,549
法人税、住民税及び事業税			11,239		10,474
法人税等調整額			△290		171
当期純利益			26,276		24,904

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	31,395	56,686	87,596
当期変動額									
剰余金の配当							△26,268	△26,268	△26,268
当期純利益							24,904	24,904	24,904
株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	－	－	－	－	－	－	△1,364	△1,364	△1,364
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,030	55,322	86,232

(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
当期変動額			
剰余金の配当			△26,268
当期純利益			24,904
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	116	116	116
当期変動額合計	116	116	△1,247
当期末残高	174	174	86,407

[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. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	時価法						
4. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。						
5. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 <table> <tr> <td>建物</td> <td>6年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>6～15年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。	建物	6年	附属設備	6～15年	器具備品	4～15年
建物	6年						
附属設備	6～15年						
器具備品	4～15年						
6. 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业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 ① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
7. 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。
8. 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。
9. 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。

[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。）等を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度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、当事業年度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。

これによる財務諸表に与える影響は軽微であります。

なお、収益認識会計基準第89-3項に定める経過的な取扱いに従って、前事業年度に係る「収益認識に関する注記」については記載しておりません。

（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。ただし、「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 2019年7月4日）第7-4項に定める経過的な取扱いに従って、当該注記のうち前事業年度に係るものについては記載しておりません。

[未適用の会計基準等]

- ・「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 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

2023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

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

- ・「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号 2021年8月12日 企業会計基準委員会）

(1) 概要

2020年3月27日に成立した「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、連結納税制度を見直しグループ通算制度へ移行することとされたことを受け、グループ通算制度を適用する場合における法人税及び地方法人税並びに税効果会計の会計処理及び開示の取扱いを明らかにすることを目的として企業基準委員会から公表されたものです。

(2) 適用予定日

2023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

「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価中であります。

[注記事項]

◇ 貸借対照表関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022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 1,256百万円	※ 1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,223百万円
※ 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	※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 589百万円 器具備品 618 合計 1,207

◇ 損益計算書関係

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022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 4,334百万円	※ 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 3,525百万円

※ 2. 固定資産除却損		※ 2. 固定資産除却損	
建物	-百万円	建物	346百万円
器具備品	2	器具備品	28
ソフトウェア	102	ソフトウェア	-
合計	105	合計	374

◇ 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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

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

（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

2022年5月18日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,877百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,830円
基準日	2022年3月31日
効力発生日	2022年6月30日

◇ 金融商品関係

前事業年度（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	-	-	-

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022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

2022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。

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1)金銭の信託	35,894	35,894	-
資産計	35,894	35,894	-
(2)その他（デリバティブ取引）	121	121	-
負債計	121	121	-

（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、短期貸付金、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。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

	当事業年度（百万円）
市場価格のない株式等（※）１、２	9,529
組合出資金等	1,886
合計	11,415

（※）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、当事業年度において727百万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	2,006	-	-	-
金銭の信託	35,894	-	-	-
未収委託者報酬	27,176	-	-	-
未収運用受託報酬	4,002	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	29,300	-	-	-
短期貸付金	1,835			
合計	100,215	-	-	-

3. 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。

区分	貸借対照表計上額（単位：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）（※）	-	1,736	-	1,736
資産計	-	1,736	-	1,736
デリバティブ取引（通貨関連）	-	121	-	121
負債計	-	121	-	121

（※）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34,157百万円は表中に含まれておりません。

(注1) 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。

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル2の時価に分類しております。

◇ 有価証券関係

前事業年度（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)

時価を把握することが極めて困難と認められる子会社株式及び関連会社株式の貸借対照表計上額

区分	前事業年度 (百万円)
子会社株式	9,835
関連会社株式	106

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	-

※非上場株式（貸借対照表計上額312百万円）及び投資事業有限責任組合への出資金（貸借対照表計上額1,455百万円）は、記載しておりません。

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。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 売買目的有価証券(2022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(2022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(2022年3月31日)

市場価格のない株式等の貸借対照表計上額

区分	当事業年度 (百万円)
子会社株式	9,107
関連会社株式	106

4. その他有価証券(2022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	29,300	29,300	-
小計	29,300	29,300	-
合計	29,300	29,300	-

※市場価格のない株式等（貸借対照表計上額315百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,886百万円）は、記載していません。

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当事項はありません。

◇ デリバティブ取引関係

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 通貨関連

前事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	取引の種類	契約額等 (百万円)	契約額等の うち一年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引以外の取引	為替予約取引 売建 米ドル	1,714	-	△121	△121

◇ 退職給付関係

前事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,761 百万円
勤務費用	1,016
利息費用	139
数理計算上の差異の発生額	△893
退職給付の支払額	△781
その他	28
退職給付債務の期末残高	23,270

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

積立型制度の退職給付債務	19,959 百万円
年金資産	△19,349
	610
非積立型制度の退職給付債務	3,311
未積立退職給付債務	3,921
未認識数理計算上の差異	△2,074
未認識過去勤務費用	151
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998
退職給付引当金	3,299
前払年金費用	△1,301
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,998

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	52%
株式	30%
生保一般勘定	11%
生保特別勘定	7%
その他	0%
合計	100%

②長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	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。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	23,270 百万円
勤務費用	961
利息費用	176
数理計算上の差異の発生額	△1,521
退職給付の支払額	△904
その他	△14
退職給付債務の期末残高	21,967

(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	19,349 百万円
期待運用収益	454
数理計算上の差異の発生額	△258
事業主からの拠出額	814
退職給付の支払額	△672
年金資産の期末残高	19,687

(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	18,807 百万円
年金資産	△19,687
	△879
非積立型制度の退職給付債務	3,159
未積立退職給付債務	2,279
未認識数理計算上の差異	△489
未認識過去勤務費用	106
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896
退職給付引当金	3,194
前払年金費用	△1,297
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,896

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	961 百万円
利息費用	176
期待運用収益	△454
数理計算上の差異の費用処理額	322
過去勤務費用の費用処理額	△45
確定給付制度に係る退職給付費用	959

(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	51%
株式	32%
生保一般勘定	10%
生保特別勘定	6%
その他	1%
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	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

◇ 税効果会計関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022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 1,176	賞与引当金 1,381
退職給付引当金 1,022	退職給付引当金 990
関係会社株式評価減 784	関係会社株式評価減 1,010
未払事業税 430	未払事業税 285
投資有価証券評価減 428	投資有価証券評価減 110
減価償却超過額 223	減価償却超過額 272
時効後支払損引当金 179	時効後支払損引当金 182
関係会社株式売却損 148	関係会社株式売却損 505
ゴルフ会員権評価減 135	ゴルフ会員権評価減 92
資産除去債務 425	資産除去債務 348
未払社会保険料 95	未払社会保険料 114
その他 358	その他 84
繰延税金資産小計 5,410	繰延税金資産小計 5,376
評価性引当額 △1,530	評価性引当額 △1,795
繰延税金資産合計 3,879	繰延税金資産合計 3,581
繰延税金負債	繰延税金負債
資産除去債務に対応する除去費用 △361	資産除去債務に対応する除去費用 △233
関係会社株式評価益 △80	関係会社株式評価益 △81
その他有価証券評価差額金 △25	その他有価証券評価差額金 △78
前払年金費用 △403	前払年金費用 △402
繰延税金負債合計 △871	繰延税金負債合計 △796
繰延税金資産の純額 3,008	繰延税金資産の純額 2,784

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

◇ 資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

		(単位：百万円)	
前事業年度		当事業年度	
自	2020年4月 1日	自	2021年4月 1日
至	2021年3月31日	至	2022年3月31日
期首残高	-	1,371	
有形固定資産の取得に伴う増加	1,371	48	
資産除去債務の履行による減少	-	△296	
期末残高	1,371	1,123	

◇ 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

当事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

委託者報酬	115,670百万円
運用受託報酬	16,675百万円
成功報酬（注）	1,058百万円
その他営業収益	530百万円
合計	133,935百万円

（注）成功報酬は、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] 7. 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事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度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

前事業年度(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。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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 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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（１）親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022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

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)
子会社	ノムラ・エー ム・ファイ ナンス・イン ク	ケイマン	2,500 (米ドル)	資金管理	直接100%	資産の賃貸借	資金の貸付	3,427	短期貸付金	1,835
							資金の返済	1,709		
							貸付金利息 の受取	9	未収利息	4

(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 及び売上の取 扱ならびに投 資信託に係る 事務代行の委 託等 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (*1)	29,119	未払手数料	6,013

(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. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

◇ 1株当たり情報

前事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		当事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
1株当たり純資産額	17,018円01銭	1株当たり純資産額	16,775円81銭
1株当たり当期純利益	5,101円61銭	1株当たり当期純利益	4,835円10銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	26,276百万円	損益計算書上の当期純利益	24,904百万円
普通株式に係る当期純利益	26,276百万円	普通株式に係る当期純利益	24,904百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(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。

＊2022年5月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
株式会社SBI証券 auカブコム証券株式会社 松井証券株式会社 マネックス証券株式会社 山和証券株式会社 楽天証券株式会社	48,323百万円 7,196百万円 11,945百万円 12,200百万円 585百万円 17,495百万円	「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 株式会社京葉銀行 株式会社第四北越銀行 株式会社百五銀行	35,000百万円 49,759百万円 32,776百万円 20,000百万円	

＊2022年5月末現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託者

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

(2) 販売会社

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【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。
- (2) 目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。
- (3) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (4) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5) 目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- (6) 目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含む）も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載する場合があります。
- (7) 目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8) 目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

独立監査人の監査報告書

2022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	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

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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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6月28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

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプI）の2021年4月23日から2022年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプI）の2022年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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6月28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

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプⅡ）の2021年4月23日から2022年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプⅡ）の2022年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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6月28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

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプⅢ）の2021年4月23日から2022年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプⅢ）の2022年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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6月28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

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプIV）の2021年4月23日から2022年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプIV）の2022年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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6月28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

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプV）の2021年4月23日から2022年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプV）の2022年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。