

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年11月16日提出
【計算期間】	第19期(自 2022年2月18日至 2022年8月17日)
【ファンド名】	ネクストコア
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【電話番号】	03-6387-5000
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

◆国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象[※]とし、また為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。

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

■信託金の限度額■

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

<商品分類>

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

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

（ネクストコア）

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国 内	株 式
		債 券
	海 外	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			
	年4回	日本		
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)	北米	ファミリーファンド	あり (適時ヘッジ)
	年12回 (毎月)	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)		
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定型 資産配分変更型				

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

<属性区分表定義>

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信…これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産…組入れている資産を記載するものとする。

資産複合…以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

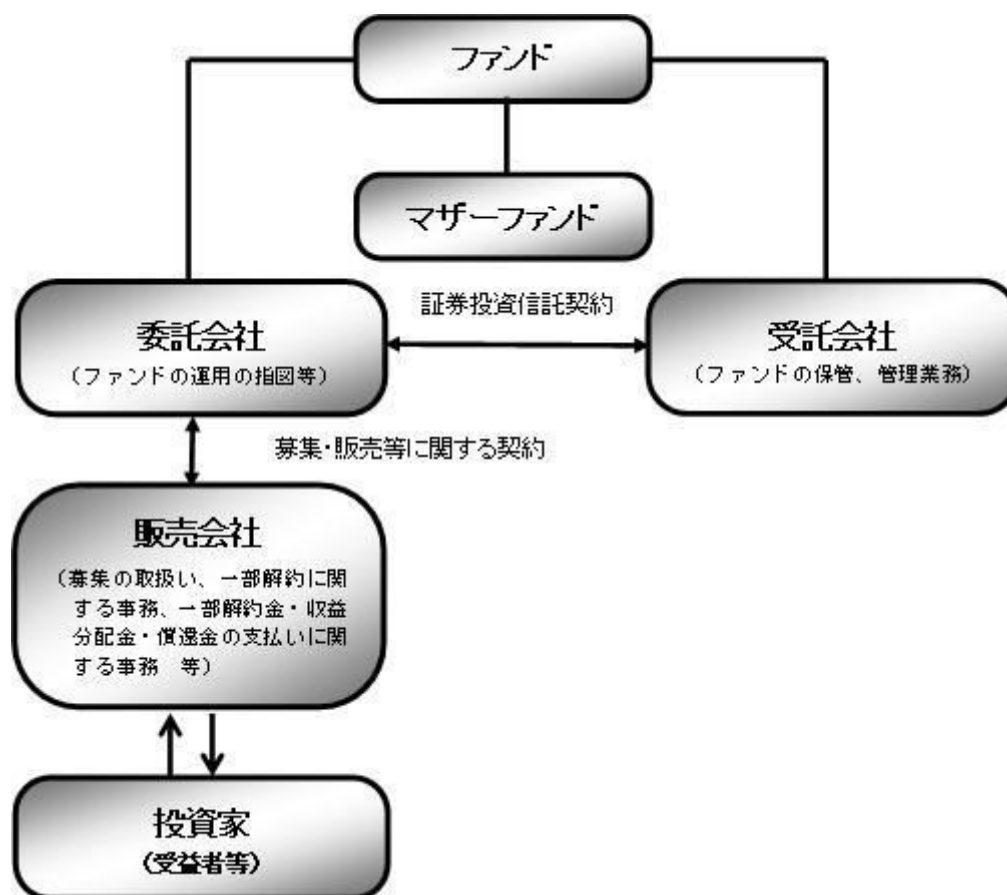
- (1)ブル・ベア型…目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右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

(2) 【ファンドの沿革】

2013年1月31日

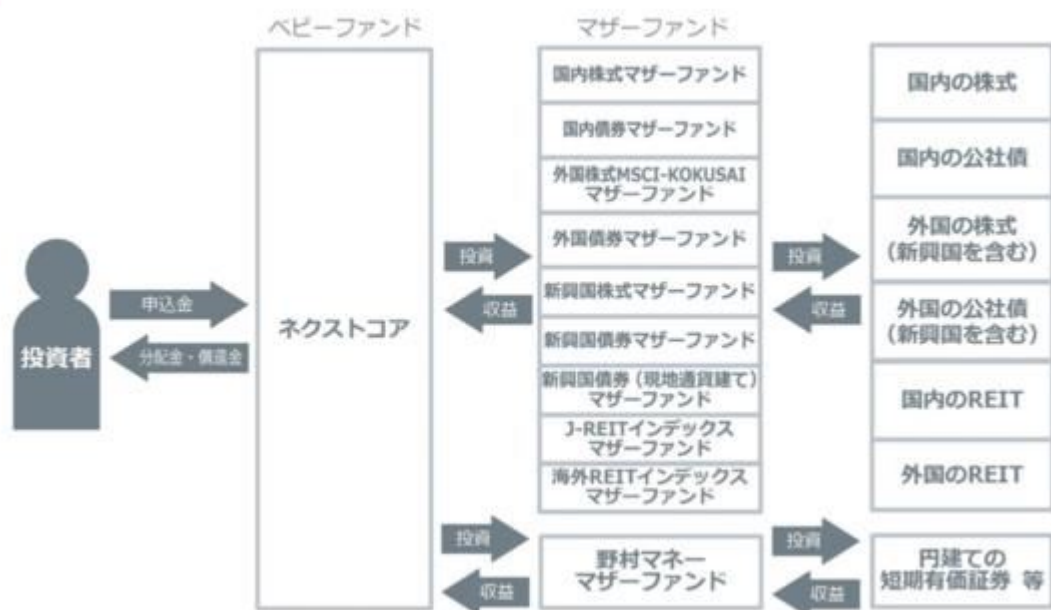
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



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

- ファ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。



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

■委託会社の概況(2022年9月末現在)■

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

※1 リスク水準とは、推定されるポートフォリオの変動の大きさのことです。ファンドでは推定される基準価額の「振れ幅」（上下変動の程度）を表しています。なお、市場環境等によってはポートフォリオのリスク水準をより引き下げた運用を行なう場合があります。

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

となります。

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

- ◆各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジションは適宜見直しを行ないます。
- ◆一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。
- ◆各マザーファンド（「野村マネー マザーファンド」を除く）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。

「野村マネー マザーファンド」は、円建ての短期有価証券等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）
国内債券マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI 国債指数
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）*1
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、 ヘッジなし・円ベース）
新興国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）*2
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）*3
新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債	JP モルガン・ガバメント・ボンド・イン デックス－エマージング・マーケッ ツ・グローバル・ディバーシファイド（円 換算ベース）*4
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）*5

※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。

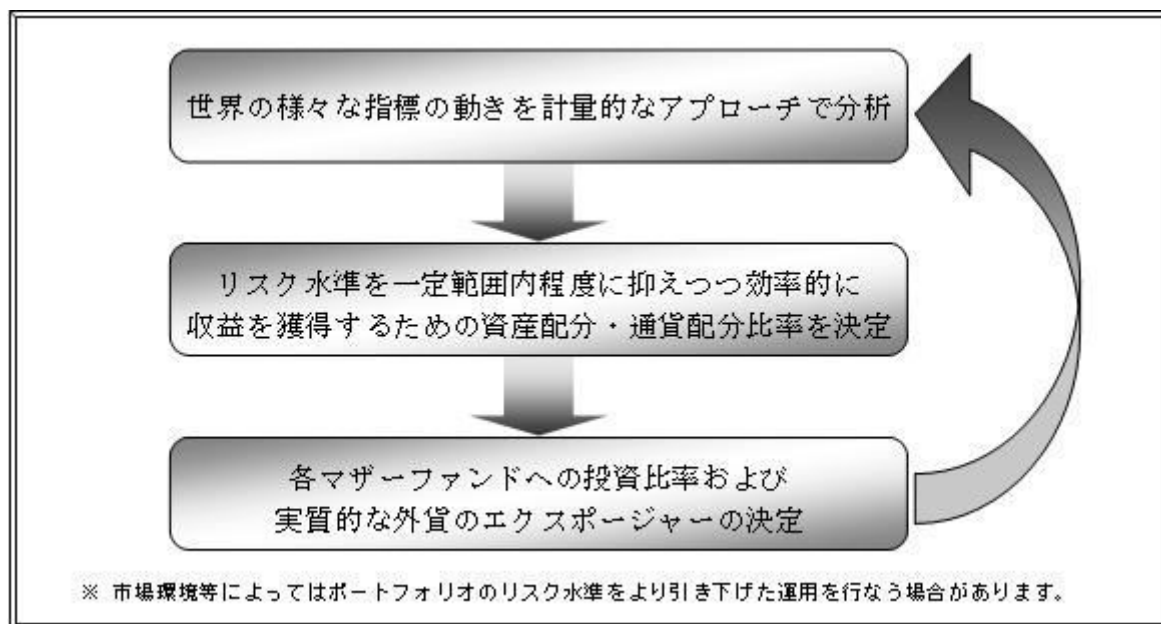
※3 世界の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。なお、国によっては、「不動産投資信託証券」について、「REIT」という表記を用いていない場合もありますが、当ファンドにおいては、こうした場合も含め、全て「REIT」といいます。

*1 MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したものです。
 *2 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。
 *3 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。
 *4 JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。
 *5 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。

- ◆内外の株式およびREITをそれぞれ主な投資対象とする「国内株式マザーファンド」、「外国株式 MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」への投資比率の合計は、原則として、信託

財産の純資産総額の50%以内とします。

■運用プロセスについて■



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

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

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

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

「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。

「NOMURA-BPI国債指数」

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

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

関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、本ファンドを現金に償還する方程式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

「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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス」

「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・グロバル・ディバーシファイド」

本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、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、信頼できるとされる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

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

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

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

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

「S&P先進国REIT指数」

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

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

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

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

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

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

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

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

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

て何ら保証を行なうものではないことを明記します。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

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

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

①投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（５）投資制限 ④、⑤、⑧および⑩」に定めるものに限り、）に係る権利

ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

ロ. 次に掲げるものをすべてみだす資産

- ・ リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・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親投資信託である国内株式マザーファンド、国内債券マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、外国債券マザーファンド、新興国株式マザーファンド、新興国債券マザーファンド、新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド、J-REITインデックス マザーファンド、海外REITインデックス マザーファンドおよび野村マネー マザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。

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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）
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ブリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
17. 外国貸付債権信託受益証券（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

④その他の投資対象

1. 先物取引等

2. スワップ取引

3. 金利先渡取引^{※1}

4. 為替先渡取引^{※2}

5. 直物為替先渡取引^{※3}

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

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

※3 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行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。

（国内債券マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

- ① 主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI国債指数の動きに連動する投資成果を目指します。
- ② 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

（外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ④ 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

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

※転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)をいいます。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑪ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国債券マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

- ① 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ② 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。
- ③ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。
- ④ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ない

ません。

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

（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。

（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。

（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。

(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

- ①J-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

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

(3)投資制限

- ①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ②外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③株式への直接投資は行ないません。

- ④不動産投信指数先物取引は約款第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。

(野村マネー マザーファンド)
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

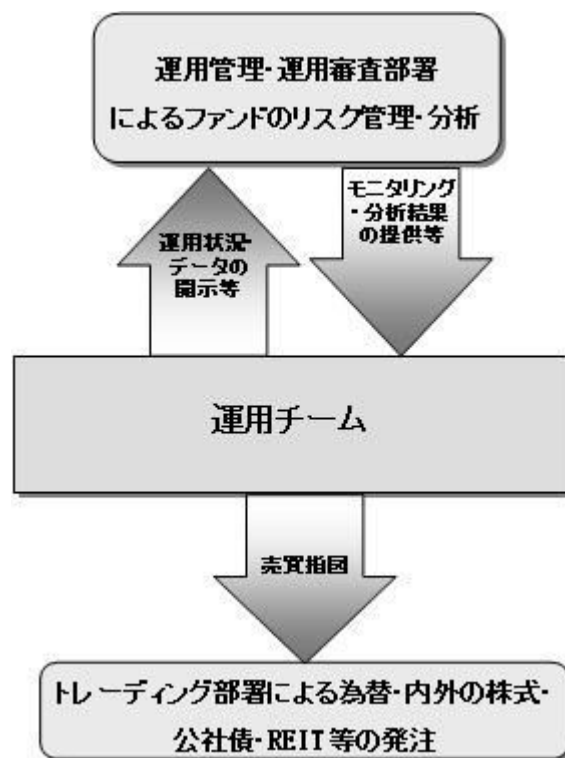
- ①残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。
- ②資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(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。

（３）【運用体制】

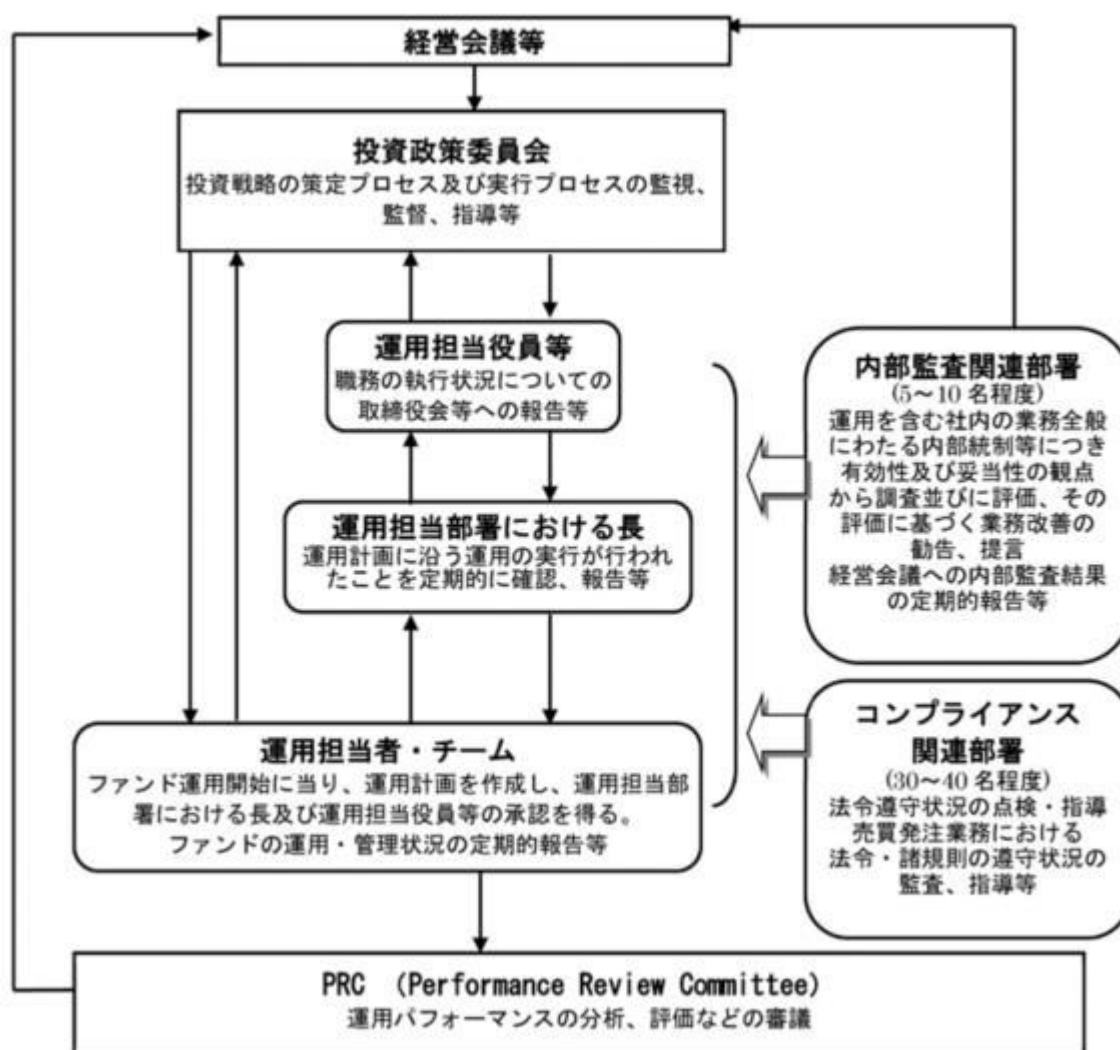
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



《委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等》

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

- ① 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、上記①の範囲内で、基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

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

◆ファンドの決算日

原則として**毎年2月および8月の各17日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

(5) 【投資制限】

①運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限

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

②投資する株式等の範囲(信託約款)

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

③信用取引の指図範囲(信託約款)

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

により行なうことの指図をすることができるものとします。

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
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。

⑤スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

(ii) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

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

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

⑥有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

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

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

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

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

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

⑦公社債の借入れ(信託約款)

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

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

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

(iv) 上記(i)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

⑧金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

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

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

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

⑨特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

⑩直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

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

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

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

⑪資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

(iv)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑫同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

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

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

(ii)当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

3【投資リスク】

《基準価額の変動要因》

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

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

[株価変動リスク]

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

[REITの価格変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

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

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

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

《その他の留意点》

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

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

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

《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

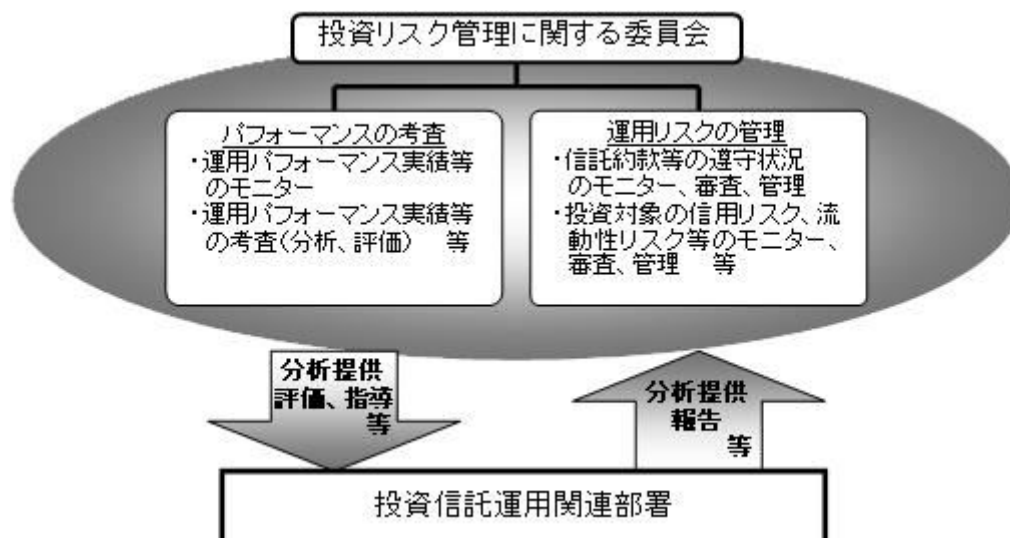
投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

※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。



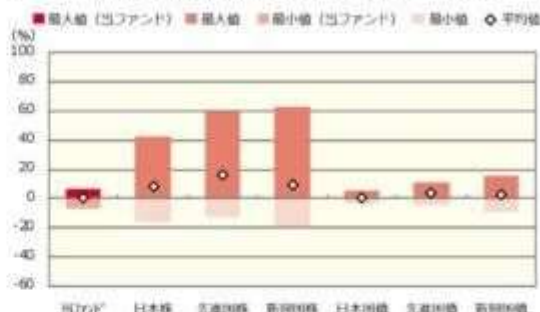
投資リスク

■ リスクの定量的比較（2017年10月末～2022年9月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値（％）	6.7	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	15.7
最小値（％）	△7.4	△16.0	△12.4	△19.4	△3.7	△4.5	△9.4
平均値（％）	0.3	7.7	15.7	9.2	0.1	3.4	2.2

※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10月末を10,000として指数化しております。
※年間騰落率は、2017年10月から2022年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
※2017年10月から2022年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
※決算日に対応した数値とは異なります。
※当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<代表的な資産クラスの指数>

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

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）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 証券又は株式会社 J P X 証券の関連会社（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 J P X は責任を負いません。
- MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。両指数に対する著作権、知的財産権その他の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、両指数の内容を変更する権利および公表を中止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。両指数は 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・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含まれ、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値段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、JPMC）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMC やその従業員がロング・ショート両方を兼ね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、ブレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または買主になっている可能性もあります。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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年1.485%（税抜年1.35%）の率を乗じた額とします。ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

信託報酬の配分については次の通り(税抜)とします。

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

《支払先の役務の内容》

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

(4) 【その他の手数料等】

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

②ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等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。

④ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する

費用はファンドから支払われます。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

＜収益分配金に対する課税＞

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

なお、配当控除は適用されません。

＜換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税＞

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

《損益通算について》

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

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

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

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

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

◆法人の投資家に対する課税

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

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■換金（解約）時および償還時の課税について■

〔個人の投資家の場合〕

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

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

〔法人の投資家の場合〕

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

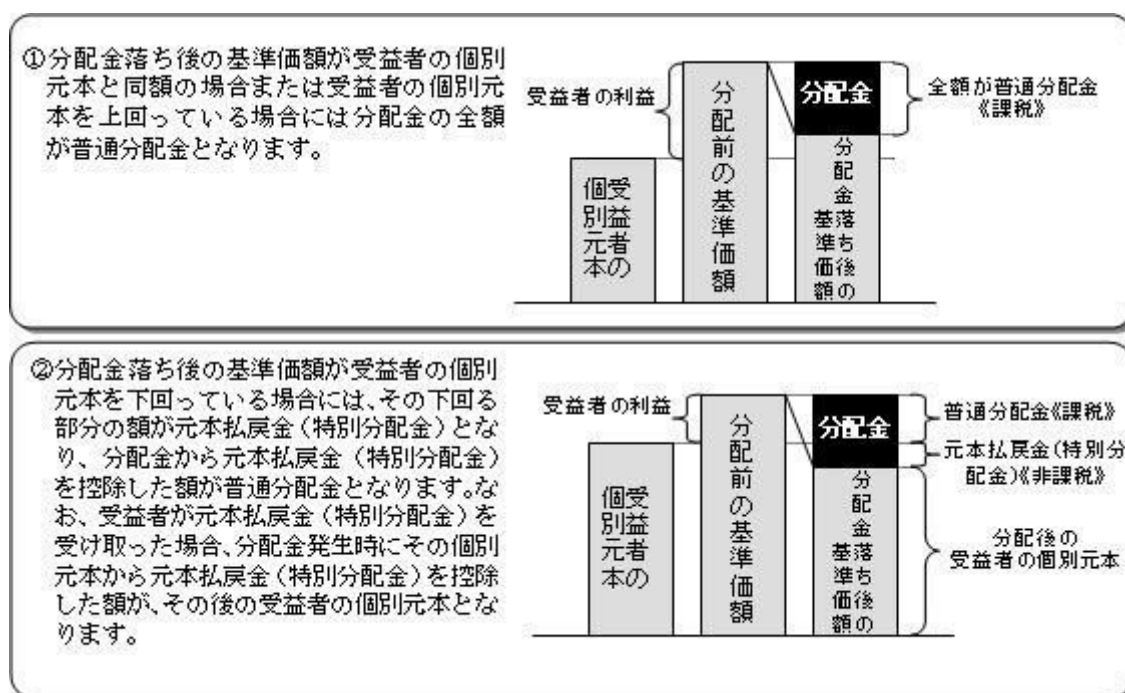
■個別元本について■

◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

■分配金の課税について■

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



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

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

※税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2022年9月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2022年9月30日現在の運用状況であります。

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

（１）【投資状況】

ネクストコア

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	665,528,485	63.26
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	386,521,304	36.73
合計（純資産総額）		1,052,049,789	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	426,035,515,840	97.08
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	12,782,810,527	2.91
合計（純資産総額）		438,818,326,367	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	12,778,560,000	2.91

（参考）国内債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	23,305,599,330	99.16
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	197,193,663	0.83
合計（純資産総額）		23,502,792,993	100.00

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	943,669,513,975	71.47
	カナダ	48,341,918,602	3.66
	ドイツ	27,346,889,503	2.07
	イタリア	8,033,237,315	0.60
	フランス	39,704,297,685	3.00
	オランダ	15,641,607,501	1.18
	スペイン	8,584,225,636	0.65
	ベルギー	2,875,191,152	0.21
	オーストリア	628,097,298	0.04
	ルクセンブルグ	296,603,704	0.02
	フィンランド	3,680,261,134	0.27
	アイルランド	2,097,920,760	0.15
	ポルトガル	847,523,000	0.06
	イギリス	56,209,136,231	4.25
	スイス	39,092,370,158	2.96
	スウェーデン	12,140,535,586	0.91
	ノルウェー	2,865,297,831	0.21
	デンマーク	9,653,723,240	0.73
	オーストラリア	28,262,974,845	2.14
	ニュージーランド	667,453,812	0.05
	香港	10,046,335,925	0.76
	シンガポール	4,452,429,635	0.33
	イスラエル	2,053,778,012	0.15
	小計	1,267,191,322,540	95.97
投資証券	アメリカ	26,568,757,943	2.01
	カナダ	117,787,880	0.00
	フランス	395,620,424	0.02
	ベルギー	97,981,627	0.00
	イギリス	508,303,102	0.03
	オーストラリア	1,615,416,664	0.12
	香港	484,745,152	0.03
	シンガポール	584,011,409	0.04
	小計	30,372,624,201	2.30
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	22,804,106,749	1.72
合計（純資産総額）		1,320,368,053,490	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	16,959,960,743	1.28
	買建	カナダ	851,419,152	0.06
	買建	ドイツ	1,925,521,282	0.14
	買建	イギリス	989,812,107	0.07
	買建	スイス	677,034,478	0.05
	買建	オーストラリア	524,051,339	0.03

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	356,202,411,027	52.37
	カナダ	13,940,827,174	2.04
	メキシコ	5,611,810,011	0.82
	ドイツ	36,754,356,721	5.40
	イタリア	54,536,402,569	8.01
	フランス	50,749,960,501	7.46
	オランダ	8,275,716,452	1.21
	スペイン	38,913,920,696	5.72
	ベルギー	12,452,653,906	1.83
	オーストリア	7,936,729,888	1.16
	フィンランド	2,133,025,516	0.31
	アイルランド	8,341,215,542	1.22
	イギリス	28,424,953,138	4.17
	スウェーデン	1,683,357,710	0.24
	ノルウェー	1,327,754,798	0.19
	デンマーク	2,372,923,260	0.34
	ポーランド	2,822,397,180	0.41
	オーストラリア	10,290,678,301	1.51
	シンガポール	2,966,959,718	0.43
	マレーシア	3,446,144,067	0.50
	中国	19,773,648,311	2.90
	イスラエル	2,490,935,109	0.36
小計		671,448,781,595	98.72
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	8,657,773,695	1.27
合計（純資産総額）		680,106,555,290	100.00

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	2,839,872,061	3.77
	メキシコ	1,611,170,077	2.14
	ブラジル	4,105,643,524	5.45
	チリ	165,070,967	0.21
	コロンビア	47,163,313	0.06
	ギリシャ	192,634,998	0.25
	トルコ	268,088,594	0.35
	チェコ	113,071,769	0.15
	ハンガリー	106,630,164	0.14
	ポーランド	378,352,588	0.50
	香港	16,754,111,286	22.27
	マレーシア	1,111,055,607	1.47
	タイ	1,544,462,996	2.05
	フィリピン	523,869,482	0.69
	インドネシア	1,603,112,850	2.13
	韓国	7,811,175,881	10.38
	台湾	10,211,023,818	13.57
	インド	10,944,304,154	14.55
	カタール	918,777,947	1.22
	エジプト	43,106,606	0.05
	南アフリカ	2,472,850,396	3.28
	アラブ首長国連邦	1,032,478,463	1.37
	クウェート	638,369,520	0.84
	サウジアラビア	3,507,477,071	4.66
小計		68,943,874,132	91.65
投資信託受益証券	アメリカ	3,252,943,634	4.32
投資証券	メキシコ	48,577,422	0.06
	南アフリカ	28,072,980	0.03
	小計	76,650,402	0.10
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	2,943,613,574	3.91
合計（純資産総額）		75,217,081,742	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	2,160,631,081	2.87
	買建	香港	704,428,245	0.93

（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	25,806,535,384	97.63
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	624,621,045	2.36
合計（純資産総額）		26,431,156,429	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	699,720,715	9.87
	ブラジル	697,176,846	9.84
	チリ	135,480,673	1.91
	コロンビア	284,714,753	4.01
	ペルー	166,625,947	2.35
	ウルグアイ	12,363,460	0.17
	セルビア	20,936,159	0.29
	トルコ	73,057,536	1.03
	チェコ	352,159,924	4.97
	ハンガリー	183,828,577	2.59
	ポーランド	461,421,475	6.51
	ロシア	0	0.00
	ルーマニア	239,809,385	3.38
	マレーシア	695,000,537	9.81
	タイ	676,694,807	9.55
	インドネシア	696,753,855	9.83
	中国	707,610,006	9.98
	エジプト	103,418,086	1.45
	南アフリカ	669,733,083	9.45
小計		6,876,505,824	97.06
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	207,969,873	2.93
合計（純資産総額）		7,084,475,697	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	43,558,473,500	97.10
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,299,077,139	2.89
合計（純資産総額）		44,857,550,639	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	1,295,853,000	2.88

（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	40,743,239,503	77.12
	カナダ	946,600,720	1.79
	ドイツ	25,216,257	0.04
	イタリア	6,839,899	0.01
	フランス	756,650,043	1.43
	オランダ	86,401,049	0.16
	スペイン	186,228,709	0.35
	ベルギー	529,345,009	1.00
	アイルランド	21,595,637	0.04
	シンガポール	29,716,416	0.05
	イギリス	2,290,710,270	4.33
	オーストラリア	3,268,686,843	6.18
	ニュージーランド	209,219,950	0.39
	香港	781,509,269	1.47
	シンガポール	1,859,032,840	3.51
	韓国	134,805,911	0.25
	イスラエル	81,030,162	0.15
	小計	51,956,828,487	98.35
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	867,411,932	1.64
合計（純資産総額）		52,824,240,419	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	719,804,170	1.36

（参考）野村マネー マザーファンド

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

地方債証券	日本	2,708,988,056	34.57
特殊債券	日本	790,418,430	10.08
社債券	日本	300,385,017	3.83
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	4,035,161,895	51.50
合計（純資産総額）		7,834,953,398	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ネクストコア

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド	241,825,387	1.3373	323,393,091	1.3140	317,758,558	30.20
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	106,159,475	2.6122	277,309,781	2.5872	274,655,793	26.10
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI－KOKUSA Iマザーファンド	4,352,481	4.8303	21,023,789	4.4073	19,182,689	1.82
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	8,600,858	2.1522	18,510,767	1.9903	17,118,287	1.62
5	日本	親投資信託 受益証券	J－REITインデックス マ ザーファンド	5,043,246	2.7696	13,967,775	2.6801	13,516,403	1.28
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	3,868,063	1.9457	7,526,090	1.8827	7,282,402	0.69
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券（現地通貨建て）マ ザーファンド	4,142,066	1.4342	5,940,551	1.4311	5,927,710	0.56
8	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	1,392,881	3.4996	4,874,527	2.9597	4,122,509	0.39
9	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,441,227	1.5995	3,904,742	1.4898	3,636,939	0.34
10	日本	親投資信託 受益証券	野村マネー マザーファンド	2,282,012	1.0199	2,327,424	1.0198	2,327,195	0.22

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	63.26
合 計	63.26

（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	8,280,800	2,172.03	17,986,228,644	1,876.00	15,534,780,800	3.54
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	1,137,900	10,582.31	12,041,615,826	9,286.00	10,566,539,400	2.40
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	164,600	50,325.31	8,283,547,057	47,900.00	7,884,340,000	1.79

4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,997,900	3,860.98	7,713,854,302	3,906.00	7,803,797,400	1.77
5	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,486,600	748.43	7,848,530,198	651.50	6,832,019,900	1.55
6	日本	株式	任天堂	その他製品	1,025,400	5,663.20	5,807,054,209	5,854.00	6,002,691,600	1.36
7	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,299,500	4,348.42	5,650,772,761	4,243.00	5,513,778,500	1.25
8	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,427,700	3,775.73	5,390,613,484	3,767.00	5,378,145,900	1.22
9	日本	株式	日立製作所	電気機器	873,600	6,461.51	5,644,782,720	6,114.00	5,341,190,400	1.21
10	日本	株式	第一三共	医薬品	1,317,600	3,309.01	4,359,959,895	4,042.00	5,325,739,200	1.21
11	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,068,800	4,943.22	5,283,316,349	4,900.00	5,237,120,000	1.19
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,243,400	4,367.60	5,430,684,699	4,161.00	5,173,787,400	1.17
13	日本	株式	HOYA	精密機器	346,200	12,535.11	4,339,655,082	13,880.00	4,805,256,000	1.09
14	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,162,600	3,933.06	4,572,583,659	4,024.00	4,678,302,400	1.06
15	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,173,000	4,128.57	4,842,819,456	3,968.00	4,654,464,000	1.06
16	日本	株式	ダイキン工業	機械	198,400	19,791.54	3,926,641,618	22,295.00	4,423,328,000	1.00
17	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,328,000	3,349.06	4,447,564,584	3,137.00	4,165,936,000	0.94
18	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	115,300	52,976.36	6,108,174,315	35,700.00	4,116,210,000	0.93
19	日本	株式	信越化学工業	化学	282,000	17,743.16	5,003,572,183	14,330.00	4,041,060,000	0.92
20	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	2,699,700	1,511.17	4,079,719,693	1,446.50	3,905,116,050	0.88
21	日本	株式	三井物産	卸売業	1,257,300	3,142.22	3,950,713,206	3,089.00	3,883,799,700	0.88
22	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	1,495,600	2,322.86	3,474,083,978	2,565.00	3,836,214,000	0.87
23	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,072,600	3,693.63	3,961,788,039	3,501.00	3,755,172,600	0.85
24	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	184,600	17,321.93	3,197,628,728	19,705.00	3,637,543,000	0.82
25	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	599,900	5,693.02	3,415,243,382	5,806.00	3,483,019,400	0.79
26	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	2,148,000	1,583.35	3,401,046,585	1,562.50	3,356,250,000	0.76
27	日本	株式	村田製作所	電気機器	495,500	8,212.61	4,069,351,765	6,632.00	3,286,156,000	0.74
28	日本	株式	日本電産	電気機器	403,500	8,342.63	3,366,252,800	8,130.00	3,280,455,000	0.74
29	日本	株式	ファナック	電気機器	159,400	19,673.00	3,135,876,890	20,260.00	3,229,444,000	0.73
30	日本	株式	SMC	機械	53,200	61,724.49	3,283,743,241	58,220.00	3,097,304,000	0.70

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.28
		建設業	2.19
		食料品	3.47
		繊維製品	0.45
		パルプ・紙	0.18
		化学	5.97
		医薬品	5.55
		石油・石炭製品	0.49

		ゴム製品	0.67
		ガラス・土石製品	0.70
		鉄鋼	0.78
		非鉄金属	0.72
		金属製品	0.56
		機械	5.05
		電気機器	16.08
		輸送用機器	7.37
		精密機器	2.76
		その他製品	2.48
		電気・ガス業	1.21
		陸運業	3.25
		海運業	0.49
		空運業	0.47
		倉庫・運輸関連業	0.15
		情報・通信業	8.99
		卸売業	5.48
		小売業	4.55
		銀行業	5.19
		証券、商品先物取引業	0.71
		保険業	2.20
		その他金融業	1.10
		不動産業	1.96
		サービス業	5.30
		合 計	97.08

（参考）国内債券マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第15 3回	470,000,000	100.16	470,798,400	99.71	468,674,600	0.005	2027/6/20	1.99
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第43 8回	400,000,000	100.19	400,784,000	100.10	400,416,000	0.005	2024/7/1	1.70
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	370,000,000	101.33	374,941,200	101.12	374,151,400	0.6	2024/6/20	1.59
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 0回	370,000,000	100.30	371,132,200	100.26	370,980,500	0.1	2024/6/20	1.57
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第14 1回	340,000,000	100.33	341,122,000	100.29	340,999,600	0.1	2024/9/20	1.45
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 57回	310,000,000	99.67	308,995,800	99.18	307,467,300	0.1	2029/12/20	1.30

7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 44回	300,000,000	100.43	301,308,000	100.37	301,128,000	0.1	2026/9/20	1.28
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第15 2回	300,000,000	100.44	301,338,000	100.28	300,867,000	0.1	2027/3/20	1.28
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年) 第43 6回	280,000,000	100.19	280,549,000	100.11	280,308,000	0.005	2024/5/1	1.19
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第14 5回	270,000,000	100.43	271,179,900	100.41	271,120,500	0.1	2025/9/20	1.15
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 46回	270,000,000	100.41	271,112,400	100.28	270,780,300	0.1	2027/3/20	1.15
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 33回	250,000,000	101.21	253,042,500	100.99	252,485,000	0.6	2024/3/20	1.07
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年) 第43 3回	250,000,000	100.16	250,400,000	100.11	250,297,500	0.005	2024/2/1	1.06
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年) 第14 9回	250,000,000	100.02	250,052,500	100.00	250,000,000	0.005	2026/9/20	1.06
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 45回	240,000,000	100.43	241,048,800	100.33	240,806,400	0.1	2026/12/20	1.02
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 59回	240,000,000	99.19	238,065,300	98.82	237,184,800	0.1	2030/6/20	1.00
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年) 第1 47回	210,000,000	114.20	239,838,800	112.81	236,917,800	1.6	2033/12/20	1.00
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 61回	240,000,000	98.86	237,267,600	98.63	236,719,200	0.1	2030/12/20	1.00
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年) 第1 49回	210,000,000	113.32	237,979,000	111.74	234,662,400	1.5	2034/6/20	0.99
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 42回	230,000,000	100.44	231,018,900	100.43	230,993,600	0.1	2026/3/20	0.98
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 48回	230,000,000	100.40	230,922,100	100.12	230,282,900	0.1	2027/9/20	0.97
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 58回	230,000,000	99.20	228,163,800	98.97	227,637,900	0.1	2030/3/20	0.96
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 47回	220,000,000	100.41	220,922,800	100.18	220,411,400	0.1	2027/6/20	0.93
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 50回	220,000,000	100.11	220,242,000	99.97	219,938,400	0.1	2028/3/20	0.93
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 52回	220,000,000	99.92	219,830,200	99.79	219,542,400	0.1	2028/9/20	0.93
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 60回	220,000,000	99.34	218,564,200	98.75	217,252,200	0.1	2030/9/20	0.92
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年) 第1 46回	190,000,000	115.13	218,747,000	113.83	216,284,600	1.7	2033/9/20	0.92
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年) 第1 50回	190,000,000	111.91	212,629,700	110.53	210,014,600	1.4	2034/9/20	0.89
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (30年) 第3 4回	170,000,000	124.97	212,449,000	121.05	205,798,600	2.2	2041/3/20	0.87

30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年) 第3 35回	200,000,000	101.27	202,552,000	101.08	202,162,000	0.5	2024/9/20	0.86
----	----	------	----------------------------	-------------	--------	-------------	--------	-------------	-----	-----------	------

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.16
合 計	99.16

(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	3,337,800	25,385.93	84,733,184,358	20,632.52	68,867,254,629	5.21
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,465,300	44,792.52	65,634,491,519	34,392.37	50,395,147,088	3.81
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	1,888,400	23,425.76	44,237,214,934	16,624.18	31,393,116,619	2.37
4	アメリカ	株式	TESLA INC	自動車	544,800	51,015.34	27,793,161,950	38,839.49	21,159,754,206	1.60
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	1,240,500	20,161.41	25,010,229,888	14,107.39	17,500,217,543	1.32
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	1,163,300	20,295.13	23,609,325,075	14,204.41	16,523,993,527	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	193,480	75,165.37	14,542,996,375	73,683.67	14,256,316,917	1.07
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	542,700	25,934.77	14,074,802,320	23,825.58	12,930,147,313	0.97
9	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	868,700	12,209.71	10,606,579,537	12,841.75	11,155,628,920	0.84
10	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	265,200	50,960.79	13,514,803,772	39,037.87	10,352,845,723	0.78
11	アメリカ	株式	META PLATFORMS INC- CLASS A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	473,000	32,365.13	15,308,709,035	19,753.53	9,343,420,683	0.70
12	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	605,700	20,071.52	12,157,322,584	15,373.02	9,311,444,029	0.70
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	494,800	22,222.08	10,995,487,360	18,637.04	9,221,610,856	0.69
14	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	580,500	17,843.82	10,358,340,568	15,832.68	9,190,873,526	0.69
15	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・ 半導体製 造装置	516,440	38,662.36	19,966,789,879	17,695.78	9,138,809,656	0.69
16	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	339,400	32,162.62	10,915,994,277	26,074.48	8,849,681,431	0.67

17	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	212,000	44,453.53	9,424,150,200	40,304.96	8,544,653,068	0.64
18	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	384,900	23,876.03	9,189,885,535	20,964.14	8,069,098,910	0.61
19	アメリカ	株式	ELI LILLY & CO.	医薬品	166,600	42,208.80	7,031,986,560	47,788.74	7,961,605,433	0.60
20	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	364,400	23,500.65	8,563,638,464	20,667.28	7,531,157,998	0.57
21	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	179,100	52,066.04	9,325,028,232	41,527.16	7,437,515,019	0.56
22	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	1,157,300	7,555.25	8,743,696,411	6,394.80	7,400,713,150	0.56
23	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	849,300	9,012.20	7,654,067,565	8,191.90	6,957,382,114	0.52
24	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	144,900	54,474.31	7,893,327,831	47,582.74	6,894,739,751	0.52
25	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	285,100	24,339.05	6,939,065,003	24,126.79	6,878,548,998	0.52
26	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,495,000	6,111.85	9,137,220,986	4,439.87	6,637,612,527	0.50
27	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	521,500	12,027.11	6,272,143,058	12,546.33	6,542,915,476	0.49
28	アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORPORATION	食品・生活必需品小売り	91,360	82,321.93	7,520,931,994	69,361.09	6,336,829,530	0.47
29	アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	ライフサイエンス・ツール/サービス	80,730	85,463.27	6,899,450,484	74,810.29	6,039,435,043	0.45
30	アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	312,200	21,466.78	6,701,928,916	19,151.12	5,978,980,444	0.45

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	3.51
		メディア	0.71
		娯楽	1.15
		不動産管理・開発	0.32
		エネルギー設備・サービス	0.22
		石油・ガス・消耗燃料	5.13
		化学	1.98
		建設資材	0.23
		容器・包装	0.25
		金属・鉱業	1.45
		紙製品・林産品	0.10
		航空宇宙・防衛	1.55
		建設関連製品	0.53
		建設・土木	0.24
		電気設備	0.75
		コングロマリット	0.84
		機械	1.58
		商社・流通業	0.34
		商業サービス・用品	0.53

航空貨物・物流サービス	0.54
旅客航空輸送業	0.04
海運業	0.06
陸運・鉄道	1.08
運送インフラ	0.13
自動車部品	0.16
自動車	2.21
家庭用耐久財	0.25
レジャー用品	0.02
繊維・アパレル・贅沢品	1.25
ホテル・レストラン・レジャー	1.82
販売	0.11
インターネット販売・通信販売	2.70
複合小売り	0.48
専門小売り	1.64
食品・生活必需品小売り	1.57
飲料	1.90
食品	1.73
タバコ	0.72
家庭用品	1.16
パーソナル用品	0.61
ヘルスケア機器・用品	2.24
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.59
バイオテクノロジー	2.07
医薬品	5.50
銀行	5.73
各種金融サービス	1.00
保険	3.14
情報技術サービス	3.71
ソフトウェア	7.03
通信機器	0.65
コンピュータ・周辺機器	5.42
電子装置・機器・部品	0.53
半導体・半導体製造装置	3.99
各種電気通信サービス	1.15
無線通信サービス	0.30
電力	1.95
ガス	0.13
総合公益事業	0.86
水道	0.10
消費者金融	0.39
資本市場	3.16

		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	0.15
		ヘルスケア・テクノロジー	0.06
		ライフサイエンス・ツール/サービス	1.50
		専門サービス	0.69
投資証券	—	—	2.30
合 計			98.27

（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	155,050,000	17,045.09	26,428,413,574	16,097.66	24,959,433,503	5.375	2031/2/15	3.66
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	130,750,000	16,324.36	21,344,108,962	15,460.72	20,214,903,733	5.25	2028/11/15	2.97
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	82,000,000	14,424.61	11,828,182,490	14,079.37	11,545,090,086	2.5	2024/5/15	1.69
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	81,000,000	13,655.12	11,060,655,093	13,140.37	10,643,703,819	1.625	2026/11/30	1.56
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	66,600,000	16,073.91	10,705,224,060	15,307.99	10,195,127,849	6	2026/2/15	1.49
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	67,500,000	14,060.14	9,490,598,507	13,467.89	9,090,828,962	2.375	2027/5/15	1.33
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	59,850,000	14,278.60	8,545,747,911	13,907.41	8,323,588,643	2.25	2024/11/15	1.22
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	58,700,000	14,358.80	8,428,617,377	13,999.05	8,217,444,401	2.375	2024/8/15	1.20
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,100,000	17,758.45	8,541,817,921	16,759.49	8,061,316,672	6.25	2030/5/15	1.18
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	55,700,000	14,245.05	7,934,493,204	13,911.94	7,748,951,467	2.125	2024/9/30	1.13
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	53,600,000	14,329.96	7,680,862,588	13,657.39	7,320,362,715	2.875	2028/5/15	1.07
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	65,150,000	12,139.74	7,909,042,970	10,984.06	7,156,117,959	2.375	2051/5/15	1.05
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,850,000	14,341.06	7,292,429,404	14,031.86	7,135,201,646	2.125	2024/3/31	1.04
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,300,000	14,161.54	7,264,873,921	13,667.57	7,011,465,830	2.25	2025/11/15	1.03
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,800,000	14,478.47	7,065,496,802	14,005.84	6,834,850,988	2.875	2025/4/30	1.00
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,900,000	14,408.59	6,613,545,105	14,124.63	6,483,205,757	2.25	2023/12/31	0.95
17	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	37,700,000	19,048.89	7,181,435,064	16,883.42	6,365,049,943	4.75	2035/4/25	0.93
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,750,000	14,510.33	6,348,270,113	13,999.05	6,124,585,903	3	2025/9/30	0.90
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	14,535.30	6,192,039,398	14,241.72	6,066,974,082	2.75	2023/11/15	0.89
20	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	35,200,000	18,268.18	6,430,401,509	16,772.11	5,903,783,821	5.5	2029/4/25	0.86
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	14,175.54	5,996,253,708	13,644.38	5,771,573,563	2.375	2026/4/30	0.84

22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	37,600,000	16,755.54	6,300,083,710	15,276.62	5,744,012,429	5.25	2029/11/1	0.84
23	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	34,000,000	18,089.21	6,150,333,069	16,771.62	5,702,353,941	6	2029/1/31	0.83
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	35,450,000	17,329.46	6,143,294,676	16,011.00	5,675,899,500	6.5	2027/11/1	0.83
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,350,000	13,626.10	5,770,653,612	13,139.24	5,564,469,884	1.5	2026/8/15	0.81
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,700,000	12,237.57	6,082,075,255	11,145.84	5,539,484,810	2.5	2046/2/15	0.81
27	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,050,000	16,953.15	5,772,550,435	15,990.50	5,444,767,266	5.9	2026/7/30	0.80
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	36,400,000	15,681.78	5,708,171,129	14,859.63	5,408,905,757	3.5	2026/4/25	0.79
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	32,900,000	16,568.35	5,450,988,276	15,872.53	5,222,063,314	6.125	2027/11/15	0.76
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,300,000	13,438.29	5,684,399,679	12,251.15	5,182,237,255	3	2044/11/15	0.76

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.72
合 計	98.72

(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	2,165,000	2,352.98	5,094,205,173	1,978.51	4,283,475,233	5.69
2	アメリカ	投資信託受 益証券	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	4,885,500	684.67	3,344,990,502	665.83	3,252,943,634	4.32
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	548,800	6,398.78	3,511,651,555	4,992.57	2,739,922,416	3.64
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	419,490	6,616.40	2,775,517,552	5,323.12	2,232,995,609	2.96
5	香港	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インター ネット販 売・通信販 売	1,333,380	1,676.51	2,235,426,138	1,417.88	1,890,576,168	2.51

6	香港	株式	MEITUAN-CLASS B	インター ネット販 売・通信販 売	386,900	2,953.74	1,142,805,313	3,140.19	1,214,939,511	1.61
7	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	267,500	4,529.82	1,211,729,353	4,162.28	1,113,411,773	1.48
8	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	295,700	2,795.19	826,537,799	2,503.58	740,309,641	0.98
9	香港	株式	JD.COM, INC.	インター ネット販 売・通信販 売	189,417	4,198.02	795,178,105	3,726.89	705,938,217	0.93
10	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	8,447,000	100.63	850,058,032	81.36	687,285,932	0.91
11	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	451,900	1,290.34	583,105,750	1,510.58	682,631,554	0.90
12	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	351,252	2,029.27	712,785,994	1,833.49	644,018,045	0.85
13	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	各種金融 サービス	151,400	3,909.31	591,870,781	4,005.12	606,375,925	0.80
14	サウジア ラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	172,200	4,255.21	732,748,264	3,138.18	540,394,596	0.71
15	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	1,095,649	474.71	520,123,730	461.65	505,809,045	0.67
16	サウジア ラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	192,700	3,009.07	579,848,389	2,435.66	469,351,682	0.62
17	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	80,300	6,126.08	491,924,719	5,365.16	430,822,910	0.57
18	香港	株式	BAIDU INC-CLASS A	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	193,710	1,980.56	383,654,457	2,129.12	412,433,772	0.54
19	香港	株式	NETEASE, INC.	娯楽	182,150	2,608.08	475,063,154	2,169.72	395,214,498	0.52
20	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	556,000	895.86	498,098,737	707.55	393,401,970	0.52
21	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	47,960	10,744.33	515,298,215	8,176.96	392,167,002	0.52
22	インドネ シア	株式	BANK CENTRAL ASIA	銀行	4,880,000	72.34	353,040,514	79.56	388,265,000	0.51
23	アメリカ	株式	PINDUODUO INC ADR	インター ネット販 売・通信販 売	44,030	5,586.85	245,989,338	8,800.10	387,468,566	0.51

24	インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	パーソナル用品	72,000	3,849.34	277,153,049	4,833.98	348,046,884	0.46
25	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	72,300	5,924.97	428,375,626	4,796.88	346,814,424	0.46
26	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	19,020	12,222.92	232,480,018	17,713.46	336,910,047	0.44
27	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	133,538	3,577.29	477,704,585	2,469.72	329,802,391	0.43
28	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガス・消耗燃料	418,000	858.24	358,746,253	785.32	328,265,159	0.43
29	カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	415,000	893.07	370,625,950	784.65	325,632,655	0.43
30	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,930,000	83.72	412,775,011	66.05	325,631,430	0.43

種類別及び業種別投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.09
		メディア	0.14
		娯楽	0.92
		不動産管理・開発	1.75
		エネルギー設備・サービス	0.05
		石油・ガス・消耗燃料	4.85
		化学	3.03
		建設資材	0.95
		容器・包装	0.06
		金属・鉱業	3.51
		紙製品・林産品	0.17
		航空宇宙・防衛	0.15
		建設関連製品	0.01
		建設・土木	0.47
		電気設備	0.65
		コングロマリット	1.04
		機械	0.26

商社・流通業	0.23
商業サービス・用品	0.07
航空貨物・物流サービス	0.28
旅客航空輸送業	0.22
海運業	0.35
陸運・鉄道	0.28
運送インフラ	0.70
自動車部品	0.42
自動車	2.90
家庭用耐久財	0.28
レジャー用品	0.07
繊維・アパレル・贅沢品	1.15
ホテル・レストラン・レジャー	1.08
インターネット販売・通信販売	6.36
複合小売り	0.15
専門小売り	0.76
食品・生活必需品小売り	1.33
飲料	1.12
食品	1.72
タバコ	0.37
家庭用品	0.08
パーソナル用品	0.86
ヘルスケア機器・用品	0.10
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.79
バイオテクノロジー	0.56
医薬品	1.09
銀行	15.49
各種金融サービス	1.56
保険	2.39
情報技術サービス	2.29
ソフトウェア	0.17
通信機器	0.11
コンピュータ・周辺機器	4.46
電子装置・機器・部品	2.39
半導体・半導体製造装置	7.73
各種電気通信サービス	1.51

		無線通信サービス	1.68
		電力	1.22
		ガス	0.65
		総合公益事業	0.03
		水道	0.11
		消費者金融	0.71
		資本市場	0.71
		各種消費者サービス	0.10
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.85
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.74
		その他の業種	0.01
投資信託受益証券	—	—	4.32
投資証券	—	—	0.10
合 計			96.08

（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 INDONESIA	4,000,000	14,145.36	565,814,737	13,036.84	521,473,843	3.85	2030/10/15	1.97
2	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	3,000,000	14,643.83	439,314,905	13,875.92	416,277,777	4	2029/3/14	1.57
3	アメリカ	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2,800,000	14,928.31	417,992,907	14,166.90	396,673,400	4.375	2029/4/16	1.50
4	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	2,900,000	15,006.68	435,193,728	13,433.87	389,582,488	4.817	2049/3/14	1.47
5	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	2,700,000	15,671.23	423,123,235	14,043.19	379,166,290	5.103	2048/4/23	1.43
6	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	2,700,000	14,352.41	387,515,180	13,490.49	364,243,489	5.625	2028/1/17	1.37
7	アメリカ	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2,600,000	14,405.92	374,553,961	13,645.44	354,781,604	3.625	2028/3/4	1.34
8	アメリカ	国債証券	CHINA GOVT INTL BOND	2,500,000	14,033.97	350,849,289	13,799.52	344,988,104	1.95	2024/12/3	1.30
9	アメリカ	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	2,500,000	14,184.68	354,617,244	13,744.30	343,607,702	2.9	2025/10/22	1.30
10	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,500,000	14,025.94	350,648,726	13,389.76	334,744,063	4.625	2028/1/13	1.26
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ECUADOR	6,600,000	7,870.79	519,472,461	4,965.81	327,743,558	2.5	2035/7/31	1.23
12	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	2,800,000	12,348.56	345,759,941	11,560.45	323,692,646	2.783	2031/1/23	1.22
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000	14,395.56	345,493,491	13,463.27	323,118,608	8.6	2027/9/24	1.22
14	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	2,400,000	13,893.91	333,453,987	12,759.20	306,221,018	4.4	2050/4/16	1.15
15	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	3,100,000	10,548.22	326,994,882	9,819.28	304,397,841	4.75	2050/1/14	1.15

16	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	2,200,000	14,025.57	308,562,596	13,514.24	297,313,466	6	2029/8/1	1.12
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	2,500,000	12,802.61	320,065,466	11,449.16	286,229,021	4.35	2048/1/11	1.08
18	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000	12,414.77	297,954,539	11,916.71	286,001,082	3.875	2030/6/12	1.08
19	アメリカ	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	2,100,000	14,146.48	297,076,267	13,545.17	284,448,777	3.125	2027/10/11	1.07
20	アメリカ	国債証券	HUNGARY	2,100,000	14,598.05	306,559,150	13,071.01	274,491,294	5.25	2029/6/16	1.03
21	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,400,000	12,183.40	292,401,801	11,169.28	268,062,877	5	2051/4/27	1.01
22	アメリカ	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	1,800,000	14,121.79	254,192,234	13,799.45	248,390,131	2.125	2024/9/30	0.93
23	アメリカ	国債証券	SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,900,000	14,607.13	277,535,605	13,020.51	247,389,856	5	2049/4/17	0.93
24	アメリカ	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	1,900,000	14,672.85	278,784,158	12,951.83	246,084,900	4.975	2055/4/20	0.93
25	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,000,000	12,815.68	256,313,700	12,218.34	244,366,875	4.75	2026/1/26	0.92
26	アメリカ	国債証券	OMAN GOV INTERNTL BOND	1,800,000	14,421.95	259,595,211	13,517.14	243,308,604	6.25	2031/1/25	0.92
27	アメリカ	国債証券	STATE OF QATAR	1,700,000	15,187.45	258,186,672	14,295.49	243,023,472	4.5	2028/4/23	0.91
28	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000	14,102.68	253,848,309	13,434.56	241,822,253	4.5	2029/4/22	0.91
29	アメリカ	国債証券	ABU DHABI GOVT INT'L	2,000,000	12,913.72	258,274,427	11,821.23	236,424,625	3.875	2050/4/16	0.89
30	アメリカ	国債証券	DOMINICAN REPUBLIC	2,000,000	12,652.77	253,055,475	11,817.82	236,356,478	6	2033/2/22	0.89

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.63
合 計	97.63

（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	9,100,000	2,041.57	185,783,727	2,044.84	186,080,895	2.47	2024/9/2	2.62
2	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000	2,049.38	159,852,098	2,048.95	159,818,613	2.69	2026/8/12	2.25
3	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	7,200,000	2,052.63	147,789,836	2,062.78	148,520,623	2.91	2028/10/14	2.09
4	ブラジル	国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	6,300,000	2,199.90	138,594,192	2,197.79	138,461,036	—	2024/1/1	1.95
5	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	481,000	2,631.94	126,599,745	2,643.13	127,134,587	10	2025/1/1	1.79
6	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000	2,063.35	123,801,233	2,063.86	123,831,709	3.02	2031/5/27	1.74
7	ブラジル	国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	5,200,000	2,287.14	118,931,437	2,286.30	118,888,041	—	2023/7/1	1.67
8	南アフリ カ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,200,000	883.68	125,483,866	832.59	118,227,828	10.5	2026/12/21	1.66

9	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000	2,501.87	112,584,350	2,251.92	101,336,478	2.75	2029/10/25	1.43
10	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000	758.70	106,977,737	714.77	100,783,166	10	2024/12/5	1.42
11	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	2,954.49	103,407,220	2,841.26	99,444,278	4	2023/10/25	1.40
12	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,600,000	746.53	101,529,245	687.85	93,548,344	8	2030/1/31	1.32
13	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,500,000	667.67	96,813,475	631.18	91,522,128	5.75	2026/3/5	1.29
14	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,200,000	691.27	98,161,307	603.61	85,713,034	8.75	2048/2/28	1.20
15	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000	716.85	95,341,227	636.42	84,644,255	7.75	2031/5/29	1.19
16	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000	2,737.22	84,853,879	2,661.68	82,512,388	2.25	2024/10/25	1.16
17	ブラジル	国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	4,100,000	1,872.73	76,782,235	1,913.32	78,446,166	—	2025/7/1	1.10
18	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	14,000,000	548.73	76,822,452	543.35	76,069,848	0.45	2023/10/25	1.07
19	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000	3,147.32	78,683,088	3,039.40	75,985,235	3.733	2028/6/15	1.07
20	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000	3,202.92	76,870,151	3,106.59	74,558,356	3.9	2026/11/30	1.05
21	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000	749.50	80,946,944	676.09	73,018,013	8.5	2029/5/31	1.03
22	ブラジル	国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	3,500,000	2,063.99	72,239,789	2,073.22	72,562,969	—	2024/7/1	1.02
23	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000	3,218.25	70,801,500	3,129.67	68,852,782	3.955	2025/9/15	0.97
24	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,500,000	721.63	68,555,453	698.15	66,324,272	8	2023/12/7	0.93
25	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000	746.29	73,883,099	655.85	64,929,287	8.875	2035/2/28	0.91
26	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,600,000	700.08	74,208,922	599.44	63,541,151	8	2047/11/7	0.89
27	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000	1,952.50	66,385,040	1,848.92	62,863,386	1.75	2032/4/25	0.88
28	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	250,000	2,535.48	63,390,632	2,513.53	62,838,380	10	2029/1/1	0.88
29	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000	655.82	64,927,038	618.04	61,186,039	8.5	2037/1/31	0.86
30	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,700,000	2,352.00	63,504,193	2,234.90	60,342,407	0.25	2026/10/25	0.85

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.06
合 計	97.06

(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	4,698	715,894	3,363,271,671	636,000	2,987,928,000	6.66
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,027	646,151	2,602,052,351	597,000	2,404,119,000	5.35
3	日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	20,318	105,998	2,153,678,800	108,800	2,210,598,400	4.92
4	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,599	350,838	2,315,181,581	316,500	2,088,583,500	4.65
5	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	13,022	169,589	2,208,393,438	159,700	2,079,613,400	4.63
6	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	12,402	167,534	2,077,760,307	160,100	1,985,560,200	4.42
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	6,070	318,452	1,933,009,310	301,000	1,827,070,000	4.07
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,024	186,814	1,499,000,205	185,000	1,484,440,000	3.30
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	4,026	358,811	1,444,576,266	354,500	1,427,217,000	3.18
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	9,066	146,234	1,325,765,585	149,500	1,355,367,000	3.02
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	2,754	413,634	1,139,148,719	393,000	1,082,322,000	2.41
12	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,238	79,512	973,074,498	81,200	993,725,600	2.21
13	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	6,018	185,022	1,113,467,449	164,100	987,553,800	2.20
14	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,986	65,839	854,996,955	72,100	936,290,600	2.08
15	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	1,390	672,591	934,901,851	656,000	911,840,000	2.03
16	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	2,126	419,366	891,573,710	423,000	899,298,000	2.00
17	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	2,715	325,274	883,121,353	310,500	843,007,500	1.87
18	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,725	41,397	733,776,037	45,600	808,260,000	1.80
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	1,183	665,175	786,902,226	681,000	805,623,000	1.79
20	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	4,930	177,756	876,337,609	161,900	798,167,000	1.77
21	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,494	531,693	794,350,178	533,000	796,302,000	1.77
22	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	1,591	550,072	875,165,040	495,000	787,545,000	1.75

23	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,735	151,877	719,138,903	156,300	740,080,500	1.64
24	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,458	153,320	683,500,776	156,000	695,448,000	1.55
25	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,484	116,981	641,524,367	114,800	629,563,200	1.40
26	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,768	161,361	608,010,207	165,500	623,604,000	1.39
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	2,888	214,706	620,071,534	214,200	618,609,600	1.37
28	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	1,873	335,192	627,814,953	329,000	616,217,000	1.37
29	日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	3,871	150,001	580,656,098	147,700	571,746,700	1.27
30	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	842	691,117	581,920,581	672,000	565,824,000	1.26

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.10
合 計	97.10

（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	229,500	17,694.13	4,060,803,146	14,653.32	3,362,937,835	6.36
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	28,240	95,254.93	2,689,999,292	81,294.88	2,295,767,578	4.34
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	48,990	45,023.11	2,205,682,175	41,631.42	2,039,523,604	3.86
4	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	191,500	9,605.23	1,839,401,672	8,391.73	1,607,018,114	3.04
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	143,700	11,933.50	1,714,844,219	9,170.81	1,317,846,446	2.49
6	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	101,400	15,016.79	1,522,703,215	12,906.91	1,308,761,211	2.47
7	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	298,700	4,429.73	1,323,162,710	4,255.96	1,271,257,014	2.40
8	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	89,200	19,164.91	1,709,510,432	14,033.53	1,251,791,509	2.36
9	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	43,380	28,280.19	1,226,794,813	26,283.01	1,140,157,191	2.15
10	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	41,490	24,717.61	1,025,534,008	24,448.27	1,014,358,818	1.92
11	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	105,000	10,466.77	1,099,011,746	9,589.31	1,006,878,411	1.90
12	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	46,000	21,740.32	1,000,054,963	20,047.49	922,184,834	1.74
13	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	179,600	5,294.25	950,847,947	4,906.16	881,146,839	1.66
14	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	119,500	7,573.83	905,073,216	6,946.53	830,111,016	1.57
15	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	528,000	1,798.06	949,380,373	1,528.37	806,984,165	1.52
16	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	35,760	24,500.40	876,134,443	22,245.71	795,506,668	1.50
17	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	38,200	22,832.19	872,189,761	19,417.57	741,751,285	1.40

18	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	124,100	7,666.36	951,395,763	5,741.71	712,547,018	1.34
19	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,210	39,194.14	792,113,755	34,560.35	698,464,766	1.32
20	香港	投資証券	LINK REIT	655,000	1,276.96	836,413,449	1,000.91	655,597,687	1.24
21	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	64,400	11,877.33	764,900,611	9,958.58	641,332,790	1.21
22	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	90,300	7,545.84	681,389,553	6,344.12	572,874,587	1.08
23	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	32,980	19,478.39	642,397,405	17,119.43	564,599,072	1.06
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	94,700	6,549.75	620,261,922	5,948.79	563,350,868	1.06
25	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	167,200	3,763.07	629,186,852	3,269.80	546,712,199	1.03
26	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	221,500	2,857.50	632,938,010	2,286.54	506,470,803	0.95
27	アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	191,400	3,084.45	590,364,305	2,618.16	501,116,743	0.94
28	アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	79,100	6,784.34	536,641,966	6,309.37	499,071,301	0.94
29	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	54,300	10,327.26	560,770,498	9,020.21	489,797,669	0.92
30	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	44,200	14,121.99	624,192,065	10,814.41	477,996,957	0.90

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.35
合 計	98.35

（参考）野村マネー マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	日本	地方債証券	大阪府 公募第3 6 5回	500,000,000	100.05	500,280,969	100.05	500,280,969	0.77	2022/10/28	6.38
2	日本	地方債証券	山梨県 公募平成2 4年度第1回	400,000,000	100.06	400,251,750	100.06	400,251,750	0.8	2022/10/28	5.10
3	日本	地方債証券	愛知県 公募平成2 4年度第1 1回	320,000,000	100.05	320,173,390	100.05	320,173,390	0.786	2022/10/26	4.08
4	日本	特殊債券	日本政策金融公庫社債 第3 0回財投機関債	300,000,000	100.06	300,189,522	100.06	300,189,522	0.825	2022/10/26	3.83
5	日本	地方債証券	北海道 公募平成2 4年度第9回	300,000,000	100.06	300,183,750	100.06	300,183,750	0.79	2022/10/31	3.83
6	日本	地方債証券	埼玉県 公募平成2 4年度第6回	250,000,000	100.05	250,138,556	100.05	250,138,556	0.801	2022/10/26	3.19
7	日本	地方債証券	横浜市 公募平成2 4年度第3回	210,000,000	100.16	210,346,647	100.16	210,346,647	0.729	2022/12/22	2.68
8	日本	社債券	東京三菱銀行 第5 7回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.15	200,317,181	100.15	200,317,181	2.22	2022/10/27	2.55
9	日本	地方債証券	広島市 公募平成2 4年度第2回	200,000,000	100.15	200,308,000	100.15	200,308,000	0.7	2022/12/22	2.55
10	日本	地方債証券	新潟市 公募平成2 4年度第1回	200,000,000	100.15	200,304,386	100.15	200,304,386	0.7	2022/12/21	2.55
11	日本	地方債証券	相模原市 公募平成2 4年度第1回	200,000,000	100.15	200,304,342	100.15	200,304,342	0.71	2022/12/20	2.55

12	日本	地方債証券	千葉市 公募平成24年度第2回	126,550,000	100.11	126,696,266	100.11	126,696,266	0.81	2022/11/22	1.61
13	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	120,000,000	100.06	120,082,800	100.06	120,082,800	0.791	2022/10/31	1.53
14	日本	社債券	電源開発 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.06	100,067,836	100.06	100,067,836	1.126	2022/10/20	1.27
15	日本	特殊債券	地方公共団体金融機構債券 第41回	100,000,000	100.05	100,058,519	100.05	100,058,519	0.801	2022/10/28	1.27
16	日本	特殊債券	東日本高速道路 第48回	100,000,000	100.02	100,024,140	100.02	100,024,140	0.09	2022/12/20	1.27
17	日本	特殊債券	日本学生支援債券 財投機関債第61回	100,000,000	100.00	100,000,000	100.00	100,000,000	0.001	2022/11/18	1.27
18	日本	特殊債券	地方公共団体金融機構債券 第42回	40,000,000	100.12	40,050,777	100.12	40,050,777	0.801	2022/11/28	0.51
19	日本	特殊債券	商工債券 利付第811回い号	30,000,000	100.04	30,012,672	100.04	30,012,672	0.17	2022/12/27	0.38

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	34.57
特殊債券	10.08
社債券	3.83
合 計	48.49

②【投資不動産物件】

ネクストコア

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J－R E I Tインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

ネクストコア

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2022年12月限)	買建	696	日本円	13,002,680,720	12,778,560,000	2.91

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式M S C I－K O K U S A Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地 域	取引所	名称	買建／ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2022 年12月限)	買建	641	米ドル	124,916,290	18,089,127,951	117,118,712.5	16,959,960,743	1.28
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2022年12 月限)	買建	36	カナダド ル	8,375,540	886,132,132	8,047,440	851,419,152	0.06

	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2022年12月限)	買建	414	ユーロ	14,424,570	2,052,904,800	13,529,520	1,925,521,282	0.14
	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12月限)	買建	34	豪ドル	5,742,125	540,735,910	5,564,950	524,051,339	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12月限)	買建	89	英ポンド	6,437,040	1,040,998,109	6,120,530	989,812,107	0.07
	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12月限)	買建	45	スイスフラン	4,744,490	704,936,322	4,556,700	677,034,478	0.05

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）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12月限)	買建	341	米ドル	16,264,430	2,355,252,107	14,920,455	2,160,631,081	2.87
	香港	香港先物取引所	MSCI China A 50 Connect 指数先物(2022年10月限)	買建	90	米ドル	5,170,500	748,740,105	4,864,500	704,428,245	0.93

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J－REITインデックス マザーファンド

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

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

REIT指数先物取引	大阪取引所	REIT指数先物(2022年12月限)	買建	669	日本円	1,341,950,610	1,295,853,000	2.88
------------	-------	---------------------	----	-----	-----	---------------	---------------	------

（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12月限)	買建	158	米ドル	5,953,230	862,087,236	4,970,680	719,804,170	1.36

（参考）野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

ネクストコア

2022年9月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2013年 8月19日)	1,335	1,335	0.9583	0.9583
第2計算期間	(2014年 2月17日)	1,850	1,850	0.9721	0.9721
第3計算期間	(2014年 8月18日)	1,925	1,925	1.0181	1.0181
第4計算期間	(2015年 2月17日)	2,341	2,341	1.0461	1.0461
第5計算期間	(2015年 8月17日)	2,712	2,712	1.0175	1.0175
第6計算期間	(2016年 2月17日)	3,004	3,004	0.9984	0.9984
第7計算期間	(2016年 8月17日)	3,714	3,714	1.0329	1.0329
第8計算期間	(2017年 2月17日)	4,295	4,295	1.0153	1.0153
第9計算期間	(2017年 8月17日)	3,911	3,911	1.0230	1.0230
第10計算期間	(2018年 2月19日)	3,134	3,134	1.0190	1.0190
第11計算期間	(2018年 8月17日)	2,822	2,822	1.0165	1.0165
第12計算期間	(2019年 2月18日)	2,882	2,882	1.0211	1.0211
第13計算期間	(2019年 8月19日)	2,545	2,545	1.0574	1.0574
第14計算期間	(2020年 2月17日)	1,926	1,926	1.0840	1.0840
第15計算期間	(2020年 8月17日)	1,767	1,767	1.0471	1.0471
第16計算期間	(2021年 2月17日)	1,611	1,611	1.0732	1.0732

第17計算期間	(2021年 8月17日)	1,472	1,472	1.0775	1.0775
第18計算期間	(2022年 2月17日)	1,296	1,296	1.0414	1.0414
第19計算期間	(2022年 8月17日)	1,093	1,093	1.0217	1.0217
	2021年 9月末日	1,406	—	1.0681	—
	10月末日	1,391	—	1.0688	—
	11月末日	1,359	—	1.0670	—
	12月末日	1,338	—	1.0658	—
	2022年 1月末日	1,312	—	1.0518	—
	2月末日	1,162	—	1.0416	—
	3月末日	1,154	—	1.0345	—
	4月末日	1,132	—	1.0249	—
	5月末日	1,109	—	1.0198	—
	6月末日	1,086	—	1.0090	—
	7月末日	1,091	—	1.0178	—
	8月末日	1,078	—	1.0111	—
	9月末日	1,052	—	0.9894	—

②【分配の推移】

ネクストコア

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2013年 1月31日～2013年 8月19日	0.0000円
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	0.0000円
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	0.0000円
第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	0.0000円
第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	0.0000円
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	0.0000円
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	0.0000円
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	0.0000円
第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	0.0000円
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	0.0000円
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	0.0000円
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	0.0000円
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	0.0000円
第14計算期間	2019年 8月20日～2020年 2月17日	0.0000円
第15計算期間	2020年 2月18日～2020年 8月17日	0.0000円
第16計算期間	2020年 8月18日～2021年 2月17日	0.0000円
第17計算期間	2021年 2月18日～2021年 8月17日	0.0000円
第18計算期間	2021年 8月18日～2022年 2月17日	0.0000円
第19計算期間	2022年 2月18日～2022年 8月17日	0.0000円

③【収益率の推移】

ネクストコア

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 1月31日～2013年 8月19日	△4.2%
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	1.4%
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	4.7%
第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	2.8%
第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	△2.7%
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	△1.9%
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	3.5%
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	△1.7%
第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	0.8%
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	△0.4%
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	△0.2%
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	0.5%
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	3.6%
第14計算期間	2019年 8月20日～2020年 2月17日	2.5%
第15計算期間	2020年 2月18日～2020年 8月17日	△3.4%
第16計算期間	2020年 8月18日～2021年 2月17日	2.5%
第17計算期間	2021年 2月18日～2021年 8月17日	0.4%
第18計算期間	2021年 8月18日～2022年 2月17日	△3.4%
第19計算期間	2022年 2月18日～2022年 8月17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。

（４）【設定及び解約の実績】

ネクストコア

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2013年 1月31日～2013年 8月19日	1,445,052,123	51,972,335	1,393,079,788
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	670,704,216	160,711,546	1,903,072,458
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	582,888,344	594,495,481	1,891,465,321
第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	858,557,285	512,113,562	2,237,909,044
第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	774,652,374	346,882,589	2,665,678,829
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	547,418,537	203,743,660	3,009,353,706
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	954,092,064	366,986,976	3,596,458,794
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	939,380,069	304,883,559	4,230,955,304

第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	332,500,890	739,734,400	3,823,721,794
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	110,489,900	857,902,021	3,076,309,673
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	172,843,131	472,676,803	2,776,476,001
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	414,396,154	367,449,793	2,823,422,362
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	145,606,121	562,058,695	2,406,969,788
第14計算期間	2019年 8月20日～2020年 2月17日	177,689,783	807,437,000	1,777,222,571
第15計算期間	2020年 2月18日～2020年 8月17日	71,260,857	160,465,274	1,688,018,154
第16計算期間	2020年 8月18日～2021年 2月17日	97,049,943	283,704,095	1,501,364,002
第17計算期間	2021年 2月18日～2021年 8月17日	34,398,882	168,986,079	1,366,776,805
第18計算期間	2021年 8月18日～2022年 2月17日	25,162,458	147,393,429	1,244,545,834
第19計算期間	2022年 2月18日～2022年 8月17日	21,412,466	195,892,679	1,070,065,621

※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9月30日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2022年8月	0 円
2022年2月	0 円
2021年8月	0 円
2021年2月	0 円
2020年8月	0 円
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

銘柄	投資比率（%）
国内株式マザーファンド	1.6
国内債券マザーファンド	30.2
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1.8
外国債券マザーファンド	26.1
新興国株式マザーファンド	0.3
新興国債券マザーファンド	0.7
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	0.6
J-REITインデックス マザーファンド	1.3
海外REITインデックス マザーファンド	0.4
野村マネー マザーファンド	0.2

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（%）
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.1
2	ソニーグループ	電気機器	0.0
3	キーエンス	電気機器	0.0
4	日本電信電話	情報・通信業	0.0
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.0

・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	国庫債券 利付（5年）第153回	国債証券	0.6
2	国庫債券 利付（2年）第438回	国債証券	0.5
3	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.5
4	国庫債券 利付（5年）第140回	国債証券	0.5
5	国庫債券 利付（5年）第141回	国債証券	0.4



運用実績（2022年9月30日現在）

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（%）
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.1
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.0
4	TESLA INC	自動車	0.0
5	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	US TREASURY N/B	国債証券	1.0
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.8
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.4
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.4
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.4

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	REPUBLIC OF INDONESIA	国債証券	0.0
2	STATE OF QATAR	国債証券	0.0
3	SAUDI INTERNATIONAL BOND	国債証券	0.0
4	STATE OF QATAR	国債証券	0.0
5	STATE OF QATAR	国債証券	0.0

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
3	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
4	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1
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
3	日本都市ファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1
4	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	投資証券	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



運用実績（2022年9月30日現在）

・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

・「野村マネー マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（%）
1	大阪府 公募第365回	地方債証券	0.0
2	山梨県 公募平成24年度第1回	地方債証券	0.0
3	愛知県 公募平成24年度第11回	地方債証券	0.0
4	日本政策金融公庫社債 第30回財投機関債	特殊債券	0.0
5	北海道 公募平成24年度第9回	地方債証券	0.0

年間収益率の推移（暦年ベース）



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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・販売の単位は、1万口以上1万口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。
- ・受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消すことができます。

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

2【換金（解約）手続等】

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して6営業日目から申込みの販売会社において支払います。
- ・金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約金の支払いを延期する場合があります。
- ・金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

＜基準価額の計算方法＞

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

なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ^{※1} の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ^{※1} における以下のいずれかの価額で評価します。 ^{※2} 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】

2028年2月17日までとします(2013年1月31日設定)。

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年2月18日から8月17日までおよび8月18日から翌年2月17日までとします。

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

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

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

(b) 信託期間の終了

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

(ii) 上記(i)の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。

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

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

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

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更等

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

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

(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っては、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

① 収益分配金に対する請求権

■ 収益分配金の支払い開始日 ■

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）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。

上記にかかわらず、累積投資契約を結んでいる場合には、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投

資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

■収益分配金請求権の失効■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

② 償還金に対する請求権

■償還金の支払い開始日■

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

■償還金請求権の失効■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

③ 換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

(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19期計算期間(2022年2月18日から2022年8月17日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ネクストコア】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)		
	第18期 (2022年 2月17日現在)	第19期 (2022年 8月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	604,410,616	277,397,109
親投資信託受益証券	712,405,883	822,213,489
派生商品評価勘定	-	2,859,680
未収入金	-	467,297
流動資産合計	1,316,816,499	1,102,937,575
資産合計	1,316,816,499	1,102,937,575
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	6,842,730	-
未払金	345,607	-
未払解約金	3,201,524	1,387,639
未払受託者報酬	382,071	306,318
未払委託者報酬	9,933,708	7,964,324
未払利息	409	109
その他未払費用	22,858	18,322
流動負債合計	20,728,907	9,676,712
負債合計	20,728,907	9,676,712
純資産の部		
元本等		
元本	1,244,545,834	1,070,065,621
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	51,541,758	23,195,242
（分配準備積立金）	82,922,585	69,918,160
元本等合計	1,296,087,592	1,093,260,863
純資産合計	1,296,087,592	1,093,260,863
負債純資産合計	1,316,816,499	1,102,937,575

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自 2021年 8月18日 至 2022年 2月17日	第19期 自 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
営業収益		
有価証券売買等損益	△11,687,022	20,987,606
為替差損益	△23,609,342	△34,786,960
営業収益合計	△35,296,364	△13,799,354
営業費用		
支払利息	35,096	29,290
受託者報酬	382,071	306,318
委託者報酬	9,933,708	7,964,324
その他費用	28,798	18,322
営業費用合計	10,379,673	8,318,254
営業利益又は営業損失（△）	△45,676,037	△22,117,608
経常利益又は経常損失（△）	△45,676,037	△22,117,608
当期純利益又は当期純損失（△）	△45,676,037	△22,117,608
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△1,018,997	△1,367,105
期首剰余金又は期首欠損金（△）	105,914,786	51,541,758
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,700,593	509,587
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,700,593	509,587
剰余金減少額又は欠損金増加額	11,416,581	8,105,600
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	11,416,581	8,105,600
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	51,541,758	23,195,242

(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、2022年 2月18日から2022年 8月17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18期 2022年 2月17日現在	第19期 2022年 8月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,244,545,834口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,070,065,621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 1.0414円 (10,000口当たり純資産額) (10,414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 1.0217円 (10,000口当たり純資産額) (10,217円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自 2021年 8月18日 至 2022年 2月17日	第19期 自 2022年 2月18日 至 2022年 8月17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>1,051,342円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>110,954,501円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>81,871,243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>193,877,086円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,051,342円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	110,954,501円	分配準備積立金額	D	81,871,243円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	193,877,086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>0円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>96,798,606円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>69,918,160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>166,716,766円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	0円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	96,798,606円	分配準備積立金額	D	69,918,160円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	166,716,766円
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	1,051,342円																																			
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																			
収益調整金額	C	110,954,501円																																			
分配準備積立金額	D	81,871,243円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	193,877,086円																																			
項目																																					
費用控除後の配当等収益額	A	0円																																			
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																			
収益調整金額	C	96,798,606円																																			
分配準備積立金額	D	69,918,160円																																			
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	166,716,766円																																			

当ファンドの期末残存口数	F	1,244,545,834口	当ファンドの期末残存口数	F	1,070,065,621口
10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,557円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,557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18期 自 2021年 8月18日 至 2022年 2月17日	第19期 自 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 当ファンドは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされておりますが、主要投資対象である親投資信託受益証券の保有状況によっては、市場リスクの内容は変動する場合があります。 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。	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18期 2022年 2月17日現在	第19期 2022年 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 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。	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 同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第18期 自 2021年 8月18日 至 2022年 2月17日	第19期 自 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第18期 自 2021年 8月18日 至 2022年 2月17日	第19期 自 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
期首元本額 1,366,776,805円	期首元本額 1,244,545,834円
期中追加設定元本額 25,162,458円	期中追加設定元本額 21,412,466円
期中一部解約元本額 147,393,429円	期中一部解約元本額 195,892,679円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第18期 自 2021年 8月18日 至 2022年 2月17日	第19期 自 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
----	--	--

	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	△13,575,667	19,898,999
合計	△13,575,667	19,898,999

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18期(2022年 2月17日現在)				第19期(2022年 8月17日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	369,340,237	—	376,182,967	△6,842,730	184,960,935	—	182,101,255	2,859,680
米ドル	165,992,948	—	168,583,572	△2,590,624	62,563,647	—	61,721,972	841,675
カナダドル	18,875,003	—	19,110,903	△235,900	16,954,656	—	16,709,552	245,104
ユーロ	133,887,488	—	136,703,528	△2,816,040	65,602,026	—	64,172,672	1,429,354
英ポンド	22,983,904	—	23,535,690	△551,786	12,329,490	—	12,187,237	142,253
豪ドル	27,600,894	—	28,249,274	△648,380	27,511,116	—	27,309,822	201,294
合計	369,340,237	—	376,182,967	△6,842,730	184,960,935	—	182,101,255	2,859,680

（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8月17日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2022年8月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	25,589,395	55,073,495	
		国内債券マザーファンド	243,999,671	326,642,359	
		外国債券マザーファンド	111,799,633	292,043,001	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	12,573,129	60,731,985	
		野村マネー マザーファンド	2,282,012	2,327,424	
		J-REITインデックス マザーファンド	14,503,804	40,169,735	
		海外REITインデックス マザーファンド	7,959,226	27,854,107	
		新興国株式マザーファンド	2,441,227	3,904,742	
		新興国債券マザーファンド	3,868,063	7,526,090	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	4,142,066	5,940,551	
	小計	銘柄数：10 組入時価比率：75.2%	429,158,226	822,213,489 100.0%	
合計				822,213,489	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14,082,164,773
株式	457,771,510,580

(2022年 8月17日現在)

派生商品評価勘定	421,626,320
未収配当金	593,916,832
未収利息	290,162
その他未収収益	16,662,768
差入委託証拠金	28,303,900
流動資産合計	472,914,475,335
資産合計	472,914,475,335
負債の部	
流動負債	
未払解約金	736,983,530
未払利息	5,555
有価証券貸借取引受入金	5,482,011,441
流動負債合計	6,219,000,526
負債合計	6,219,000,526
純資産の部	
元本等	
元本	216,844,127,828
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	249,851,346,981
元本等合計	466,695,474,809
純資産合計	466,695,474,809
負債純資産合計	472,914,475,335

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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.1522円
(10,000口当たり純資産額)	(21,522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	
	5,265,708,240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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 8月17日現在	
期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	205,117,643,737円
同期中における追加設定元本額	21,187,005,437円
同期中における一部解約元本額	9,460,521,346円
期末元本額	216,844,127,828円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	134,004,188円
バランスセレクト５０	306,208,812円
バランスセレクト７０	451,713,610円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,232,139,252円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	2,919,577,820円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	8,747,638,897円
野村資産設計ファンド２０１５	35,488,055円
野村資産設計ファンド２０２０	38,173,525円
野村資産設計ファンド２０２５	62,482,365円
野村資産設計ファンド２０３０	96,047,470円
野村資産設計ファンド２０３５	86,549,945円
野村資産設計ファンド２０４０	160,980,568円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	13,147,872,053円
のむラップ・ファンド（保守型）	2,484,775,636円
のむラップ・ファンド（普通型）	14,806,372,321円
のむラップ・ファンド（積極型）	5,432,053,464円
野村資産設計ファンド２０４５	32,956,097円
野村インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	2,084,187,601円
マイ・ロード	3,257,933,307円
ネクストコア	25,589,395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	1,512,062,372円
野村ＴＯＰＩＸインデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	2,834,840,125円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	478,855,283円
野村資産設計ファンド２０５０	40,190,084円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	11,309,617円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	6,701,199円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	5,271,824円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	4,662,435円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	450,405,509円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	799,935,198円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	4,173,886円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,652,183円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	23,581,124円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	7,368,372円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	31,665,812円
野村６資産均等バランス	3,229,980,434円
世界６資産分散ファンド	84,930,828円

野村資産設計ファンド2060	30,145,608円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	2,508,145,072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）	275,764,577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）	138,252,706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）	372,924,312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）	231,499,158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）	2,701,502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）	7,529,653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）	723,246円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,038,823,145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）	4,008,552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）	37,782,768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）	54,356,778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）	12,938,293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）	88,586,590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）	181,538,139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）	4,125,590,542円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	43,949,089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）	183,143,645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）	4,520,667,633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）	8,629,077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）	16,376,550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）	2,427,381円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	5,902,902円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	28,344,950円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	33,795,670円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	117,771,475円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	9,093,930,662円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	25,563,339,557円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	29,759,100,916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）	36,097,462,848円
マイバランスDC30	3,402,903,418円
マイバランスDC50	5,952,834,479円
マイバランスDC70	6,550,346,914円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	11,492,993,308円
野村DC運用戦略ファンド	842,463,718円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	73,435,678円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	1,532,645,698円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	1,323,450,281円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	1,190,913,031円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	13,481,510円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	6,332,710円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	103,098,618円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	32,446,995円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	30,653,744円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	23,790,959円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	684,555,785円

マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	564,677,238円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	370,551,011円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	492,556,326円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	16,714,630円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	141,504,169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）	178,216,508円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	164,953,879円
野村ＤＣバランスファンド（年金運用戦略タイプ）	123,559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8月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	7,900	3,820.00	30,178,000	
		日本水産	224,900	583.00	131,116,700	貸付有価証券 500株
		マルハニチロ	32,100	2,477.00	79,511,700	
		雪国まいたけ	17,700	1,007.00	17,823,900	
		カネコ種苗	6,800	1,639.00	11,145,200	
		サカタのタネ	26,300	4,850.00	127,555,000	貸付有価証券 100株
		ホクト	18,500	1,940.00	35,890,000	貸付有価証券 2,000株
		ホクリヨウ	3,300	620.00	2,046,000	
		住石ホールディングス	42,400	228.00	9,667,200	貸付有価証券 19,900株
		日鉄鉱業	4,600	5,640.00	25,944,000	
		三井松島ホールディングス	10,100	3,440.00	34,744,000	貸付有価証券 4,700株（4,000株）
		I N P E X	767,900	1,469.00	1,128,045,100	貸付有価証券 48,300株
		石油資源開発	28,500	3,520.00	100,320,000	
		K&Oエナジーグループ	9,400	1,532.00	14,400,800	
		ショーボンドホールディングス	28,300	6,380.00	180,554,000	貸付有価証券 6,500株

ミライト・ワン	78,000	1,605.00	125,190,000	
タマホーム	14,700	2,407.00	35,382,900	貸付有価証券 5,800株（100株）
サンヨーホームズ	2,800	708.00	1,982,400	
日本アクア	9,600	610.00	5,856,000	
ファーストコーポレーション	5,900	741.00	4,371,900	貸付有価証券 200株
ベステラ	4,900	1,141.00	5,590,900	貸付有価証券 2,100株
Robot Home	35,300	195.00	6,883,500	貸付有価証券 11,400株（11,400株）
キャンディル	3,600	583.00	2,098,800	貸付有価証券 1,600株
ダイセキ環境ソリューション	4,700	878.00	4,126,600	貸付有価証券 2,200株（2,100株）
第一カッター興業	5,300	1,305.00	6,916,500	
安藤・間	110,300	898.00	99,049,400	貸付有価証券 1,700株
東急建設	65,000	645.00	41,925,000	
コムシスホールディングス	78,100	2,636.00	205,871,600	貸付有価証券 400株
ビーアールホールディングス	30,400	353.00	10,731,200	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	15,400	1,966.00	30,276,400	
東建コーポレーション	6,700	9,340.00	62,578,000	
ソネック	2,500	1,018.00	2,545,000	貸付有価証券 1,100株
ヤマウラ	10,500	979.00	10,279,500	貸付有価証券 4,300株
オリエンタル白石	81,400	252.00	20,512,800	貸付有価証券 100株
大成建設	155,700	4,070.00	633,699,000	貸付有価証券 200株
大林組	519,400	958.00	497,585,200	
清水建設	480,300	758.00	364,067,400	貸付有価証券 400株
飛鳥建設	15,000	1,101.00	16,515,000	
長谷工コーポレーション	149,900	1,580.00	236,842,000	
松井建設	18,600	610.00	11,346,000	
銭高組	2,000	3,320.00	6,640,000	

鹿島建設	380,600	1,481.00	563,668,600	貸付有価証券 1,000株
不動テトラ	11,900	1,598.00	19,016,200	
大末建設	5,900	1,457.00	8,596,300	
鉄建建設	11,300	1,797.00	20,306,100	
西松建設	33,900	3,905.00	132,379,500	貸付有価証券 500株
三井住友建設	126,100	462.00	58,258,200	
大豊建設	8,200	4,280.00	35,096,000	
佐田建設	12,000	443.00	5,316,000	
ナカノフドー建設	13,400	302.00	4,046,800	貸付有価証券 200株
奥村組	27,800	2,944.00	81,843,200	
東鉄工業	22,000	2,331.00	51,282,000	
イチケン	4,000	1,805.00	7,220,000	
富士ピー・エス	7,200	461.00	3,319,200	貸付有価証券 3,300株（500株）
浅沼組	12,500	2,673.00	33,412,500	
戸田建設	214,400	701.00	150,294,400	貸付有価証券 5,700株
熊谷組	27,700	2,710.00	75,067,000	
北野建設	3,400	2,102.00	7,146,800	
植木組	4,600	1,314.00	6,044,400	貸付有価証券 1,400株
矢作建設工業	22,200	799.00	17,737,800	
ピーエス三菱	18,400	646.00	11,886,400	
日本ハウスホールディングス	28,800	421.00	12,124,800	貸付有価証券 200株
大東建託	57,300	13,460.00	771,258,000	
新日本建設	23,800	730.00	17,374,000	
東亜道路工業	2,900	5,880.00	17,052,000	貸付有価証券 100株
日本道路	4,900	6,230.00	30,527,000	貸付有価証券 100株
東亜建設工業	12,500	2,392.00	29,900,000	貸付有価証券 5,800株
日本国土開発	43,500	621.00	27,013,500	
若築建設	8,600	2,345.00	20,167,000	
東洋建設	62,700	859.00	53,859,300	貸付有価証券

				2,100株
五洋建設	205,900	727.00	149,689,300	
世紀東急工業	25,500	763.00	19,456,500	
福田組	5,500	4,980.00	27,390,000	貸付有価証券 2,300株
住友林業	111,400	2,379.00	265,020,600	貸付有価証券 30,600株
日本基礎技術	13,700	552.00	7,562,400	貸付有価証券 800株
巴コーポレーション	20,300	453.00	9,195,900	
大和ハウス工業	442,700	3,194.00	1,413,983,800	
ライト工業	30,700	1,864.00	57,224,800	
積水ハウス	530,800	2,379.00	1,262,773,200	
日特建設	11,500	888.00	10,212,000	
北陸電気工事	10,000	775.00	7,750,000	
ユアテック	32,000	755.00	24,160,000	
日本リーテック	10,600	875.00	9,275,000	
四電工	5,400	1,915.00	10,341,000	
中電工	22,500	2,147.00	48,307,500	貸付有価証券 1,300株
関電工	90,900	843.00	76,628,700	貸付有価証券 200株
きんでん	113,600	1,540.00	174,944,000	貸付有価証券 10,100株
東京エネシス	16,500	1,009.00	16,648,500	
トーエネック	5,600	3,780.00	21,168,000	
住友電設	13,800	2,741.00	37,825,800	
日本電設工業	23,900	1,782.00	42,589,800	
エクシオグループ	77,600	2,155.00	167,228,000	
新日本空調	12,100	1,807.00	21,864,700	
九電工	35,300	2,887.00	101,911,100	
三機工業	36,300	1,613.00	58,551,900	
日揮ホールディングス	158,000	1,741.00	275,078,000	
中外炉工業	5,200	1,670.00	8,684,000	
ヤマト	13,400	767.00	10,277,800	
太平電業	10,100	3,375.00	34,087,500	
高砂熱学工業	42,800	1,633.00	69,892,400	
三晃金属工業	2,200	2,696.00	5,931,200	

朝日工業社	6,800	1,905.00	12,954,000	
明星工業	28,100	721.00	20,260,100	
大気社	23,300	3,280.00	76,424,000	
ダイダン	10,500	2,210.00	23,205,000	
日比谷総合設備	15,200	1,890.00	28,728,000	
フィル・カンパニー	2,600	1,255.00	3,263,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
テスホールディングス	15,600	1,229.00	19,172,400	貸付有価証券 3,700株（2,800株）
インフロニア・ホールディングス	194,800	1,008.00	196,358,400	貸付有価証券 400株
レイズネクスト	24,000	1,249.00	29,976,000	
ニッポン	43,700	1,600.00	69,920,000	
日清製粉グループ本社	168,600	1,631.00	274,986,600	貸付有価証券 700株
日東富士製粉	2,600	4,810.00	12,506,000	
昭和産業	14,100	2,637.00	37,181,700	
鳥越製粉	13,000	678.00	8,814,000	貸付有価証券 400株（400株）
中部飼料	18,500	1,107.00	20,479,500	
フィード・ワン	21,300	732.00	15,591,600	
東洋精糖	3,000	898.00	2,694,000	
日本甜菜製糖	9,300	1,668.00	15,512,400	
DM三井製糖ホールディングス	14,500	1,893.00	27,448,500	
塩水港精糖	21,300	207.00	4,409,100	
日新製糖	8,500	1,798.00	15,283,000	
森永製菓	36,000	4,085.00	147,060,000	
中村屋	3,600	3,160.00	11,376,000	
江崎グリコ	41,700	3,720.00	155,124,000	貸付有価証券 900株
名糖産業	6,500	1,686.00	10,959,000	貸付有価証券 100株
井村屋グループ	8,700	2,279.00	19,827,300	
不二家	10,000	2,405.00	24,050,000	貸付有価証券 3,900株
山崎製パン	97,600	1,647.00	160,747,200	貸付有価証券 200株
第一屋製パン	3,100	482.00	1,494,200	

モロゾフ	5,300	3,685.00	19,530,500	
亀田製菓	9,300	4,605.00	42,826,500	
寿スピリッツ	15,500	8,110.00	125,705,000	
カルビー	81,600	2,826.00	230,601,600	
森永乳業	30,400	4,385.00	133,304,000	
六甲バター	10,700	1,466.00	15,686,200	
ヤクルト本社	113,700	8,370.00	951,669,000	
明治ホールディングス	98,600	6,850.00	675,410,000	貸付有価証券 200株
雪印メグミルク	39,200	1,805.00	70,756,000	
プリマハム	22,400	2,250.00	50,400,000	
日本ハム	62,700	4,085.00	256,129,500	貸付有価証券 100株
林兼産業	5,400	480.00	2,592,000	
丸大食品	16,100	1,590.00	25,599,000	貸付有価証券 100株（100株）
S Foods	16,100	3,090.00	49,749,000	
柿安本店	6,200	2,351.00	14,576,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	113,300	679.00	76,930,700	貸付有価証券 100株
サッポロホールディングス	48,000	3,015.00	144,720,000	貸付有価証券 100株
アサヒグループホールディングス	336,900	4,834.00	1,628,574,600	貸付有価証券 5,900株
キリンホールディングス	658,000	2,266.50	1,491,357,000	
宝ホールディングス	99,500	1,114.00	110,843,000	貸付有価証券 700株
オエノンホールディングス	43,600	298.00	12,992,800	
養命酒製造	4,800	1,825.00	8,760,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	114,200	1,481.00	169,130,200	
サントリー食品インターナショナル	102,700	5,170.00	530,959,000	
ダイドーグループホールディングス	9,200	4,990.00	45,908,000	貸付有価証券 1,300株
伊藤園	54,300	6,340.00	344,262,000	
キーコーヒー	16,300	2,187.00	35,648,100	
ユニカフェ	5,400	929.00	5,016,600	貸付有価証券 2,500株（100株）

ジャパンフーズ	2,500	1,122.00	2,805,000	
日清オイリオグループ	20,500	3,315.00	67,957,500	
不二製油グループ本社	38,800	2,405.00	93,314,000	貸付有価証券 200株
かどや製油	1,600	3,605.00	5,768,000	
J-オイルミルズ	16,700	1,634.00	27,287,800	
キッコーマン	107,400	9,100.00	977,340,000	
味の素	356,900	3,817.00	1,362,287,300	
ブルドックソース	6,400	1,918.00	12,275,200	貸付有価証券 3,000株（200株）
キューピー	78,400	2,319.00	181,809,600	
ハウス食品グループ本社	55,800	3,045.00	169,911,000	
カゴメ	67,900	3,205.00	217,619,500	貸付有価証券 800株
焼津水産化学工業	7,200	876.00	6,307,200	
アリアケジャパン	16,400	4,990.00	81,836,000	
ピエトロ	2,300	1,792.00	4,121,600	貸付有価証券 1,000株
エバラ食品工業	3,900	3,180.00	12,402,000	貸付有価証券 100株（100株）
やまみ	1,500	1,434.00	2,151,000	
ニチレイ	66,800	2,538.00	169,538,400	
東洋水産	79,800	5,700.00	454,860,000	
イトアンドホールディングス	6,800	2,395.00	16,286,000	貸付有価証券 3,100株
大冷	2,000	1,897.00	3,794,000	貸付有価証券 400株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,200	512.00	4,710,400	貸付有価証券 1,900株（200株）
日清食品ホールディングス	57,700	9,930.00	572,961,000	
永谷園ホールディングス	7,900	2,050.00	16,195,000	
一正蒲鉾	6,900	803.00	5,540,700	
フジッコ	16,600	1,955.00	32,453,000	
ロック・フィールド	17,800	1,601.00	28,497,800	貸付有価証券 6,700株（800株）
日本たばこ産業	959,900	2,358.50	2,263,924,150	
ケンコーマヨネーズ	9,100	1,515.00	13,786,500	
わらべや日洋ホールディ	10,700	2,263.00	24,214,100	

ングス				
なとり	10,000	2,099.00	20,990,000	
イフジ産業	3,100	924.00	2,864,400	
ピックルスコーポレーション	8,500	1,176.00	9,996,000	
ファーマフーズ	22,500	1,513.00	34,042,500	貸付有価証券 10,000株（4,900株）
ユウグレナ	93,900	974.00	91,458,600	貸付有価証券 3,900株
紀文食品	13,900	982.00	13,649,800	貸付有価証券 800株（200株）
ミヨシ油脂	5,700	1,008.00	5,745,600	貸付有価証券 2,700株
理研ビタミン	12,600	1,726.00	21,747,600	
片倉工業	13,700	2,118.00	29,016,600	
グンゼ	10,100	3,990.00	40,299,000	
東洋紡	69,000	1,065.00	73,485,000	
ユニチカ	48,000	233.00	11,184,000	貸付有価証券 7,800株
富士紡ホールディングス	7,100	3,635.00	25,808,500	
倉敷紡績	12,200	2,072.00	25,278,400	
シキボウ	9,200	911.00	8,381,200	
日本毛織	43,100	1,050.00	45,255,000	
ダイトウボウ	28,400	91.00	2,584,400	貸付有価証券 4,000株
トーア紡コーポレーション	6,400	366.00	2,342,400	
ダイドーリミテッド	25,100	155.00	3,890,500	貸付有価証券 9,200株
帝国繊維	16,700	1,624.00	27,120,800	
帝人	153,500	1,480.00	227,180,000	貸付有価証券 200株
東レ	1,084,200	786.90	853,156,980	
住江織物	3,000	1,760.00	5,280,000	
日本フェルト	9,900	422.00	4,177,800	貸付有価証券 200株
イチカワ	2,100	1,394.00	2,927,400	
日東製網	1,900	1,364.00	2,591,600	
アツギ	12,500	428.00	5,350,000	
ダイニック	5,700	630.00	3,591,000	

セーレン	32,200	2,138.00	68,843,600	貸付有価証券 9,500株（5,600株）
ソトー	6,400	800.00	5,120,000	
東海染工	2,000	1,130.00	2,260,000	
小松マテーレ	26,300	991.00	26,063,300	
ワコールホールディングス	35,700	2,240.00	79,968,000	
ホギメディカル	21,700	3,660.00	79,422,000	貸付有価証券 200株
クラウドシアホールディングス	3,800	289.00	1,098,200	貸付有価証券 1,700株
T S I ホールディングス	53,000	381.00	20,193,000	貸付有価証券 500株
マツオカコーポレーション	5,000	935.00	4,675,000	
ワールド	22,900	1,343.00	30,754,700	
三陽商会	7,700	908.00	6,991,600	
ナイガイ	5,900	266.00	1,569,400	貸付有価証券 200株
オンワードホールディングス	96,200	269.00	25,877,800	貸付有価証券 200株
ルックホールディングス	4,700	1,699.00	7,985,300	貸付有価証券 1,100株
ゴールドウイン	28,900	8,630.00	249,407,000	
デサント	29,800	3,535.00	105,343,000	
キング	8,200	466.00	3,821,200	
ヤマトインターナショナル	13,000	280.00	3,640,000	貸付有価証券 3,400株（600株）
特種東海製紙	9,100	3,225.00	29,347,500	
王子ホールディングス	674,100	558.00	376,147,800	貸付有価証券 400株
日本製紙	70,800	931.00	65,914,800	貸付有価証券 4,900株
三菱製紙	22,300	300.00	6,690,000	
北越コーポレーション	104,100	756.00	78,699,600	貸付有価証券 11,800株
中越パルプ工業	6,700	928.00	6,217,600	貸付有価証券 500株
巴川製紙所	5,200	741.00	3,853,200	
大王製紙	74,900	1,360.00	101,864,000	貸付有価証券

				400株
阿波製紙	3,900	304.00	1,185,600	
レンゴー	135,100	816.00	110,241,600	貸付有価証券 200株
トーモク	8,600	1,544.00	13,278,400	
ザ・パックス	11,000	2,410.00	26,510,000	
北の達人コーポレーション	62,500	223.00	13,937,500	貸付有価証券 29,300株（14,900株）
クラレ	235,800	1,084.00	255,607,200	
旭化成	1,080,700	1,046.00	1,130,412,200	貸付有価証券 3,500株
共和レザー	9,500	561.00	5,329,500	
昭和電工	143,400	2,284.00	327,525,600	
住友化学	1,191,700	568.00	676,885,600	貸付有価証券 400株
住友精化	7,000	3,150.00	22,050,000	
日産化学	78,600	7,400.00	581,640,000	
ラサ工業	6,200	2,378.00	14,743,600	
クレハ	12,700	10,550.00	133,985,000	
多木化学	5,800	4,895.00	28,391,000	貸付有価証券 1,100株
テイカ	10,000	1,277.00	12,770,000	
石原産業	31,300	1,039.00	32,520,700	
片倉コープアグリ	3,900	1,228.00	4,789,200	
日本曹達	19,100	4,545.00	86,809,500	
東ソー	216,000	1,818.00	392,688,000	
トクヤマ	51,900	1,861.00	96,585,900	
セントラル硝子	26,200	3,500.00	91,700,000	
東亜合成	76,300	1,119.00	85,379,700	
大阪ソーダ	13,300	3,810.00	50,673,000	貸付有価証券 6,200株
関東電化工業	31,900	979.00	31,230,100	
デンカ	58,800	3,330.00	195,804,000	
信越化学工業	276,900	17,645.00	4,885,900,500	
日本カーバイド工業	6,200	1,331.00	8,252,200	
堺化学工業	11,300	1,952.00	22,057,600	貸付有価証券 3,500株
第一稀元素化学工業	14,900	1,371.00	20,427,900	

エア・ウォーター	140,000	1,757.00	245,980,000	貸付有価証券 200株
日本酸素ホールディングス	143,900	2,615.00	376,298,500	
日本化学工業	4,900	2,147.00	10,520,300	
東邦アセチレン	3,500	1,154.00	4,039,000	
日本パーカライジング	73,400	1,007.00	73,913,800	
高圧ガス工業	24,600	678.00	16,678,800	
チタン工業	2,000	1,672.00	3,344,000	
四国化成工業	20,200	1,273.00	25,714,600	
戸田工業	3,700	2,541.00	9,401,700	
ステラ ケミファ	8,800	2,721.00	23,944,800	
保土谷化学工業	4,700	3,295.00	15,486,500	
日本触媒	24,900	5,570.00	138,693,000	貸付有価証券 2,900株
大日精化工業	12,400	1,800.00	22,320,000	
カネカ	37,700	3,720.00	140,244,000	
三菱瓦斯化学	137,500	2,065.00	283,937,500	貸付有価証券 1,800株
三井化学	136,000	3,030.00	412,080,000	
J S R	162,800	3,280.00	533,984,000	貸付有価証券 300株
東京応化工業	26,000	7,070.00	183,820,000	
大阪有機化学工業	11,200	2,592.00	29,030,400	
三菱ケミカルグループ	1,084,400	758.30	822,300,520	貸付有価証券 3,200株
KHネオケム	24,700	2,574.00	63,577,800	貸付有価証券 800株
ダイセル	234,900	876.00	205,772,400	貸付有価証券 100株
住友ベークライト	24,700	4,475.00	110,532,500	
積水化学工業	333,700	1,966.00	656,054,200	
日本ゼオン	131,300	1,365.00	179,224,500	
アイカ工業	41,200	3,195.00	131,634,000	貸付有価証券 3,000株（3,000株）
UBE	82,300	2,084.00	171,513,200	
積水樹脂	24,000	1,713.00	41,112,000	
タキロンシーアイ	37,800	540.00	20,412,000	
旭有機材	9,900	2,316.00	22,928,400	貸付有価証券

				200株
ニチバン	9,200	1,635.00	15,042,000	貸付有価証券 600株
リケンテクノス	35,500	514.00	18,247,000	
大倉工業	6,900	1,863.00	12,854,700	
積水化成品工業	20,800	417.00	8,673,600	
群栄化学工業	3,500	2,500.00	8,750,000	
タイガースポリマー	8,400	431.00	3,620,400	
ミライアル	5,600	1,906.00	10,673,600	貸付有価証券 400株
ダイキアクシス	6,100	699.00	4,263,900	貸付有価証券 2,600株
ダイキョーニシカワ	36,800	592.00	21,785,600	
竹本容器	5,600	749.00	4,194,400	
森六ホールディングス	8,500	1,730.00	14,705,000	
恵和	4,800	3,915.00	18,792,000	
日本化薬	122,800	1,257.00	154,359,600	
カーリットホールディングス	14,700	654.00	9,613,800	
日本精化	11,200	2,010.00	22,512,000	貸付有価証券 100株
扶桑化学工業	13,800	3,560.00	49,128,000	
トリケミカル研究所	18,000	2,475.00	44,550,000	
ADEKA	69,000	2,440.00	168,360,000	
日油	50,500	5,350.00	270,175,000	
新日本理化	24,800	247.00	6,125,600	貸付有価証券 100株
ハリマ化成グループ	11,600	891.00	10,335,600	
花王	368,300	6,175.00	2,274,252,500	貸付有価証券 1,700株
第一工業製薬	5,900	2,259.00	13,328,100	
石原ケミカル	8,100	1,307.00	10,586,700	
日華化学	6,600	841.00	5,550,600	貸付有価証券 600株
ニイタカ	3,300	2,442.00	8,058,600	
三洋化成工業	10,400	4,820.00	50,128,000	
有機合成薬品工業	12,200	308.00	3,757,600	貸付有価証券 300株
大日本塗料	19,700	746.00	14,696,200	

日本ペイントホールディングス	656,400	1,136.00	745,670,400	
関西ペイント	151,000	2,266.00	342,166,000	貸付有価証券 300株
神東塗料	13,700	147.00	2,013,900	貸付有価証券 600株
中国塗料	37,800	918.00	34,700,400	貸付有価証券 17,700株
日本特殊塗料	10,500	958.00	10,059,000	
藤倉化成	21,700	477.00	10,350,900	
太陽ホールディングス	25,700	2,844.00	73,090,800	
D I C	58,000	2,516.00	145,928,000	
サカタインクス	33,000	938.00	30,954,000	
東洋インキ S C ホールディングス	29,100	1,945.00	56,599,500	貸付有価証券 500株
T & K T O K A	14,100	924.00	13,028,400	
富士フイルムホールディングス	313,500	7,624.00	2,390,124,000	
資生堂	310,100	5,542.00	1,718,574,200	
ライオン	178,200	1,594.00	284,050,800	貸付有価証券 100株
高砂香料工業	10,000	2,902.00	29,020,000	
マンダム	34,800	1,606.00	55,888,800	
ミルボン	22,000	6,000.00	132,000,000	
ファンケル	72,200	2,764.00	199,560,800	
コーセー	30,200	13,710.00	414,042,000	貸付有価証券 400株
コタ	12,400	1,608.00	19,939,200	
シーボン	2,300	1,684.00	3,873,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	76,100	1,594.00	121,303,400	貸付有価証券 700株
ノエビアホールディングス	13,200	5,970.00	78,804,000	
アジュバンホールディングス	4,000	970.00	3,880,000	
新日本製薬	8,500	1,712.00	14,552,000	貸付有価証券 300株
エスケー	11,500	1,597.00	18,365,500	
アグロ カネショウ	5,900	1,440.00	8,496,000	貸付有価証券 2,300株

コニシ	27,100	1,593.00	43,170,300	
長谷川香料	30,700	3,255.00	99,928,500	貸付有価証券 100株
星光PMC	8,400	613.00	5,149,200	貸付有価証券 200株
小林製薬	45,400	8,560.00	388,624,000	
荒川化学工業	12,600	1,055.00	13,293,000	
メック	12,200	2,669.00	32,561,800	
日本高純度化学	4,200	2,424.00	10,180,800	
タカラバイオ	46,700	2,042.00	95,361,400	貸付有価証券 100株
J C U	18,300	3,480.00	63,684,000	
新田ゼラチン	10,200	678.00	6,915,600	
O A T アグリオ	6,700	1,521.00	10,190,700	
デクセリアルズ	46,400	4,295.00	199,288,000	
アース製薬	13,400	5,500.00	73,700,000	貸付有価証券 300株
北興化学工業	14,900	1,024.00	15,257,600	
大成ラミック	4,700	2,852.00	13,404,400	
クミアイ化学工業	59,000	1,040.00	61,360,000	
日本農薬	31,800	765.00	24,327,000	
アキレス	11,400	1,391.00	15,857,400	
有沢製作所	24,200	1,255.00	30,371,000	
日東電工	107,800	9,040.00	974,512,000	
レック	21,100	778.00	16,415,800	
三光合成	20,400	405.00	8,262,000	
きもと	27,300	252.00	6,879,600	
藤森工業	13,900	3,660.00	50,874,000	
前澤化成工業	10,500	1,322.00	13,881,000	貸付有価証券 3,200株
未来工業	6,400	1,558.00	9,971,200	
ウェーブロックホール ディングス	6,800	639.00	4,345,200	貸付有価証券 400株（400株）
J S P	10,400	1,486.00	15,454,400	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	32,800	3,595.00	117,916,000	
天馬	14,000	2,353.00	32,942,000	貸付有価証券 5,800株

信越ポリマー	32,000	1,397.00	44,704,000	
東リ	40,700	203.00	8,262,100	貸付有価証券 100株
ニフコ	59,500	3,330.00	198,135,000	
バルカー	14,500	2,731.00	39,599,500	
ユニ・チャーム	309,400	4,963.00	1,535,552,200	
ショーエイコーポレーション	4,800	590.00	2,832,000	貸付有価証券 200株（200株）
協和キリン	179,400	3,200.00	574,080,000	
武田薬品工業	1,402,000	3,844.00	5,389,288,000	
アステラス製薬	1,525,000	2,050.00	3,126,250,000	貸付有価証券 1,200株
住友ファーマ	110,200	1,106.00	121,881,200	
塩野義製薬	207,100	6,997.00	1,449,078,700	
わかもと製薬	17,400	244.00	4,245,600	貸付有価証券 200株（100株）
日本新薬	38,900	7,820.00	304,198,000	
中外製薬	464,900	3,879.00	1,803,347,100	貸付有価証券 8,500株
科研製薬	25,400	3,900.00	99,060,000	
エーザイ	197,100	6,187.00	1,219,457,700	
ロート製薬	85,000	4,275.00	363,375,000	
小野薬品工業	343,900	3,399.00	1,168,916,100	貸付有価証券 5,000株
久光製薬	37,700	3,455.00	130,253,500	
持田製薬	20,000	3,485.00	69,700,000	
参天製薬	310,700	1,052.00	326,856,400	
扶桑薬品工業	5,800	2,134.00	12,377,200	
日本ケミファ	1,900	1,883.00	3,577,700	
ツムラ	51,000	3,260.00	166,260,000	
キッセイ薬品工業	25,800	2,452.00	63,261,600	
生化学工業	31,500	910.00	28,665,000	
栄研化学	26,500	1,893.00	50,164,500	
日水製薬	6,600	1,709.00	11,279,400	貸付有価証券 1,200株
鳥居薬品	8,000	3,115.00	24,920,000	
J C Rファーマ	50,300	2,456.00	123,536,800	貸付有価証券 200株

東和薬品	25,700	2,333.00	59,958,100	
富士製薬工業	9,600	1,005.00	9,648,000	
ゼリア新薬工業	26,500	2,180.00	57,770,000	貸付有価証券 1,200株
第一三共	1,293,900	4,135.00	5,350,276,500	貸付有価証券 1,400株
キョーリン製薬ホールディングス	32,200	1,799.00	57,927,800	
大幸薬品	26,900	665.00	17,888,500	貸付有価証券 5,100株
ダイト	11,100	2,692.00	29,881,200	
大塚ホールディングス	339,800	4,719.00	1,603,516,200	貸付有価証券 4,800株
大正製薬ホールディングス	33,000	5,250.00	173,250,000	
ペプチドリーム	72,000	1,745.00	125,640,000	貸付有価証券 1,300株
あすか製薬ホールディングス	16,900	1,229.00	20,770,100	
サワイグループホールディングス	34,200	4,190.00	143,298,000	貸付有価証券 3,300株
日本コークス工業	150,700	103.00	15,522,100	貸付有価証券 300株
ニチレキ	19,300	1,393.00	26,884,900	
ユシロ化学工業	8,500	898.00	7,633,000	
ビーピー・カストロール	6,400	1,118.00	7,155,200	
富士石油	39,000	371.00	14,469,000	
MORESCO	5,900	1,175.00	6,932,500	貸付有価証券 200株（100株）
出光興産	181,500	3,495.00	634,342,500	
ENEOSホールディングス	2,683,400	504.30	1,353,238,620	貸付有価証券 100株
コスモエネルギーホールディングス	70,400	4,100.00	288,640,000	貸付有価証券 600株
横浜ゴム	84,500	2,270.00	191,815,000	貸付有価証券 3,300株
TOYO TIRE	85,300	1,734.00	147,910,200	
ブリヂストン	474,300	5,470.00	2,594,421,000	貸付有価証券 50,100株
住友ゴム工業	145,700	1,190.00	173,383,000	貸付有価証券 19,700株

藤倉コンポジット	14,300	976.00	13,956,800	
オカモト	8,200	3,940.00	32,308,000	
フコク	7,800	1,019.00	7,948,200	
ニッタ	16,800	2,935.00	49,308,000	
住友理工	34,600	581.00	20,102,600	貸付有価証券 200株
三ツ星ベルト	21,700	3,245.00	70,416,500	
バンドー化学	28,800	1,010.00	29,088,000	
日東紡績	22,100	2,651.00	58,587,100	
A G C	151,100	5,030.00	760,033,000	
日本板硝子	80,700	530.00	42,771,000	
石塚硝子	2,800	1,681.00	4,706,800	
日本山村硝子	6,200	688.00	4,265,600	
日本電気硝子	60,600	2,613.00	158,347,800	貸付有価証券 100株
オハラ	7,000	1,321.00	9,247,000	
住友大阪セメント	26,600	3,660.00	97,356,000	貸付有価証券 2,300株
太平洋セメント	101,300	2,141.00	216,883,300	
日本ヒューム	14,600	689.00	10,059,400	
日本コンクリート工業	32,000	277.00	8,864,000	
三谷セキサン	7,300	3,650.00	26,645,000	貸付有価証券 3,200株
アジアパイルホールディングス	25,300	504.00	12,751,200	
東海カーボン	124,600	1,051.00	130,954,600	貸付有価証券 1,800株
日本カーボン	8,500	4,145.00	35,232,500	
東洋炭素	9,300	3,125.00	29,062,500	貸付有価証券 1,600株
ノリタケカンパニーリミテド	9,000	4,220.00	37,980,000	
T O T O	107,800	4,850.00	522,830,000	貸付有価証券 100株
日本碍子	175,700	2,003.00	351,927,100	
日本特殊陶業	124,400	2,813.00	349,937,200	
ダントーホールディングス	11,600	298.00	3,456,800	貸付有価証券 6,200株
M A R U W A	6,200	17,730.00	109,926,000	

品川リフラクトリーズ	4,200	3,760.00	15,792,000	
黒崎播磨	3,000	4,760.00	14,280,000	
ヨータイ	11,300	1,474.00	16,656,200	
東京窯業	17,600	279.00	4,910,400	
ニッカトー	7,400	456.00	3,374,400	
フジミインコーポレー テッド	14,300	6,740.00	96,382,000	
クニミネ工業	5,600	845.00	4,732,000	
エーアンドエーマテリア ル	3,000	864.00	2,592,000	
ニチアス	37,600	2,410.00	90,616,000	
ニチハ	22,700	2,822.00	64,059,400	
日本製鉄	736,800	2,167.00	1,596,645,600	貸付有価証券 6,700株
神戸製鋼所	307,300	609.00	187,145,700	
中山製鋼所	24,500	574.00	14,063,000	
合同製鐵	8,500	1,808.00	15,368,000	
J F Eホールディングス	408,300	1,482.00	605,100,600	貸付有価証券 8,000株
東京製鐵	51,500	1,392.00	71,688,000	
共英製鋼	17,400	1,442.00	25,090,800	
大和工業	28,800	4,835.00	139,248,000	
東京鐵鋼	7,300	1,334.00	9,738,200	
大阪製鐵	9,400	1,346.00	12,652,400	貸付有価証券 100株
淀川製鋼所	19,300	2,459.00	47,458,700	
丸一鋼管	51,200	2,876.00	147,251,200	貸付有価証券 5,500株
モリ工業	4,300	2,721.00	11,700,300	
大同特殊鋼	24,100	3,925.00	94,592,500	貸付有価証券 700株
日本高周波鋼業	6,500	327.00	2,125,500	
日本冶金工業	12,000	2,766.00	33,192,000	貸付有価証券 100株
山陽特殊製鋼	15,100	2,031.00	30,668,100	
愛知製鋼	9,900	2,137.00	21,156,300	
日立金属	190,000	1,996.00	379,240,000	貸付有価証券 28,100株（9,000株）
日本金属	4,500	1,111.00	4,999,500	

大太平洋金属	10,800	2,494.00	26,935,200	
新日本電工	97,600	359.00	35,038,400	貸付有価証券 1,000株
栗本鐵工所	7,300	1,662.00	12,132,600	
虹技	2,200	951.00	2,092,200	
日本鑄鉄管	1,800	985.00	1,773,000	
三菱製鋼	11,300	979.00	11,062,700	
日亜鋼業	20,100	249.00	5,004,900	貸付有価証券 500株
日本精線	2,800	4,470.00	12,516,000	
エンビプロ・ホールディ ングス	11,700	813.00	9,512,100	貸付有価証券 5,400株（3,200株）
シンニッタン	21,300	218.00	4,643,400	貸付有価証券 3,300株
新家工業	3,700	1,770.00	6,549,000	
大紀アルミニウム工業所	21,700	1,302.00	28,253,400	貸付有価証券 500株
日本軽金属ホールディ ングス	44,600	1,636.00	72,965,600	
三井金属鉱業	47,600	3,230.00	153,748,000	貸付有価証券 700株
東邦亜鉛	9,000	2,385.00	21,465,000	
三菱マテリアル	101,900	2,134.00	217,454,600	
住友金属鉱山	193,300	4,426.00	855,545,800	
DOWAホールディン グス	41,200	5,330.00	219,596,000	貸付有価証券 100株
古河機械金属	26,900	1,262.00	33,947,800	
大阪チタニウムテクノ ロジーズ	20,400	3,165.00	64,566,000	貸付有価証券 9,500株（1,100株）
東邦チタニウム	31,600	2,228.00	70,404,800	貸付有価証券 14,800株（14,000株）
U A C J	24,100	2,580.00	62,178,000	貸付有価証券 8,700株
C K サンエツ	3,300	4,230.00	13,959,000	
古河電気工業	50,900	2,471.00	125,773,900	貸付有価証券 1,200株
住友電気工業	615,600	1,625.00	1,000,350,000	貸付有価証券 700株
フジクラ	196,600	926.00	182,051,600	
昭和電線ホールディン グ	15,400	1,860.00	28,644,000	

ス				
東京特殊電線	2,300	2,238.00	5,147,400	
タツタ電線	31,100	470.00	14,617,000	
カナレ電気	2,600	1,544.00	4,014,400	貸付有価証券 300株（300株）
平河ヒューテック	9,800	1,177.00	11,534,600	
リョービ	16,300	1,289.00	21,010,700	
アーレスティ	18,800	400.00	7,520,000	
アサヒホールディングス	70,600	2,059.00	145,365,400	貸付有価証券 1,200株
稲葉製作所	8,900	1,342.00	11,943,800	貸付有価証券 3,800株
宮地エンジニアリンググループ	5,000	3,290.00	16,450,000	
トーカロ	45,500	1,319.00	60,014,500	
アルファC o	6,200	969.00	6,007,800	
SUMCO	290,900	1,948.00	566,673,200	貸付有価証券 54,600株
川田テクノロジーズ	3,300	3,730.00	12,309,000	
RS Technologies	5,000	6,900.00	34,500,000	
ジェイテックコーポレーション	2,300	1,997.00	4,593,100	
信和	10,900	801.00	8,730,900	
東洋製罐グループホールディングス	89,900	1,646.00	147,975,400	貸付有価証券 300株
ホッカンホールディングス	8,200	1,304.00	10,692,800	
コロナ	8,500	844.00	7,174,000	貸付有価証券 100株
横河ブリッジホールディングス	25,200	1,948.00	49,089,600	
駒井ハルテック	2,800	1,649.00	4,617,200	
高田機工	1,500	2,409.00	3,613,500	
三和ホールディングス	166,300	1,410.00	234,483,000	貸付有価証券 300株
文化シャッター	52,000	1,065.00	55,380,000	貸付有価証券 6,600株（3,500株）
三協立山	21,000	647.00	13,587,000	
アルインコ	11,700	913.00	10,682,100	

東洋シャッター	3,900	552.00	2,152,800	
L I X I L	277,600	2,646.00	734,529,600	
日本フィルコン	11,000	485.00	5,335,000	
ノーリツ	22,500	1,562.00	35,145,000	貸付有価証券 2,000株
長府製作所	15,900	1,988.00	31,609,200	
リンナイ	30,500	11,070.00	337,635,000	
ダイニチ工業	8,400	652.00	5,476,800	
日東精工	22,100	547.00	12,088,700	
三洋工業	2,100	1,647.00	3,458,700	
岡部	24,600	650.00	15,990,000	
ジーテクト	19,500	1,405.00	27,397,500	
東ブレ	26,900	1,175.00	31,607,500	
高周波熱錬	27,200	664.00	18,060,800	
東京製綱	10,800	995.00	10,746,000	
サンコール	15,100	684.00	10,328,400	
モリテック スチール	13,700	293.00	4,014,100	
パイオラックス	23,200	2,042.00	47,374,400	
エイチワン	15,700	612.00	9,608,400	
日本発條	148,700	956.00	142,157,200	
中央発條	8,500	727.00	6,179,500	
アドバネクス	2,300	1,234.00	2,838,200	
立川ブラインド工業	6,900	1,111.00	7,665,900	
三益半導体工業	13,800	2,255.00	31,119,000	
日本ドライケミカル	4,000	1,612.00	6,448,000	
日本製鋼所	45,300	2,918.00	132,185,400	
三浦工業	69,400	3,235.00	224,509,000	
タクマ	50,600	1,426.00	72,155,600	貸付有価証券 200株
ツガミ	36,000	1,282.00	46,152,000	
オークマ	16,800	5,470.00	91,896,000	
芝浦機械	19,900	3,100.00	61,690,000	
アマダ	278,400	1,079.00	300,393,600	
アイダエンジニアリング	38,500	883.00	33,995,500	貸付有価証券 100株
滝澤鉄工所	5,100	1,153.00	5,880,300	
F U J I	70,400	2,108.00	148,403,200	

牧野フライス製作所	17,900	4,585.00	82,071,500	
オーエスジー	71,400	1,939.00	138,444,600	貸付有価証券 100株
ダイジェット工業	1,800	908.00	1,634,400	貸付有価証券 800株（800株）
旭ダイヤモンド工業	43,200	819.00	35,380,800	
DMG森精機	90,700	1,859.00	168,611,300	貸付有価証券 1,900株（300株）
ソディック	41,600	820.00	34,112,000	
ディスコ	26,000	34,850.00	906,100,000	
日東工器	8,500	1,638.00	13,923,000	
日進工具	13,900	1,222.00	16,985,800	
パンチ工業	15,000	447.00	6,705,000	貸付有価証券 100株
富士ダイス	8,900	640.00	5,696,000	
豊和工業	9,000	842.00	7,578,000	
ニデックオーケーケー	6,600	1,368.00	9,028,800	貸付有価証券 2,700株
東洋機械金属	11,500	565.00	6,497,500	
津田駒工業	3,000	509.00	1,527,000	
エンシュウ	3,900	795.00	3,100,500	
島精機製作所	25,800	2,371.00	61,171,800	
オプトラン	22,100	2,350.00	51,935,000	
NCホールディングス	4,900	1,825.00	8,942,500	
イワキポンプ	11,200	1,081.00	12,107,200	
フリーー	15,700	1,074.00	16,861,800	
ヤマシンフィルタ	27,700	344.00	9,528,800	貸付有価証券 100株
日阪製作所	18,100	837.00	15,149,700	
やまびこ	24,400	1,160.00	28,304,000	
野村マイクロ・サイエンス	5,600	3,665.00	20,524,000	貸付有価証券 1,000株
平田機工	7,700	4,765.00	36,690,500	
ペガサスミシン製造	17,900	860.00	15,394,000	
マルマエ	7,200	2,157.00	15,530,400	貸付有価証券 3,400株
タツモ	8,200	1,344.00	11,020,800	貸付有価証券 100株
ナブテスコ	93,900	3,495.00	328,180,500	

三井海洋開発	18,700	1,401.00	26,198,700	
レオン自動機	18,900	1,298.00	24,532,200	
SMC	52,200	68,560.00	3,578,832,000	
ホソカワミクロン	11,500	2,642.00	30,383,000	
ユニオンツール	6,600	3,690.00	24,354,000	貸付有価証券 300株（100株）
オイレス工業	22,800	1,555.00	35,454,000	
日精エー・エス・ビー機 械	6,800	4,040.00	27,472,000	
サトーホールディングス	23,200	1,934.00	44,868,800	
技研製作所	15,600	3,450.00	53,820,000	
日本エアーテック	7,500	1,065.00	7,987,500	
カワタ	5,200	925.00	4,810,000	
日精樹脂工業	11,100	983.00	10,911,300	
オカダアイヨン	5,600	1,447.00	8,103,200	
ワイエイシイホールディ ングス	7,000	1,473.00	10,311,000	
小松製作所	808,400	2,915.50	2,356,890,200	
住友重機械工業	95,300	2,930.00	279,229,000	貸付有価証券 100株
日立建機	71,500	2,995.00	214,142,500	
日工	22,200	638.00	14,163,600	
巴工業	6,400	2,468.00	15,795,200	貸付有価証券 1,500株
井関農機	14,000	1,278.00	17,892,000	
TOWA	15,200	1,963.00	29,837,600	貸付有価証券 3,000株
丸山製作所	2,800	1,600.00	4,480,000	
北川鉄工所	6,900	1,341.00	9,252,900	
ローツェ	8,800	8,750.00	77,000,000	貸付有価証券 1,800株
タカキタ	5,400	541.00	2,921,400	貸付有価証券 2,500株（200株）
クボタ	797,600	2,262.50	1,804,570,000	貸付有価証券 80,600株
荏原実業	7,400	2,234.00	16,531,600	
三菱化工機	5,300	2,230.00	11,819,000	
月島機械	27,800	925.00	25,715,000	
帝国電機製作所	11,300	1,978.00	22,351,400	

東京機械製作所	7,300	727.00	5,307,100	貸付有価証券 1,100株
新東工業	33,200	738.00	24,501,600	貸付有価証券 100株
澁谷工業	14,000	2,580.00	36,120,000	
アイチ コーポレーショ ン	25,400	860.00	21,844,000	
小森コーポレーション	41,000	787.00	32,267,000	
鶴見製作所	12,600	2,144.00	27,014,400	
住友精密工業	2,600	2,548.00	6,624,800	
日本ギア工業	6,300	300.00	1,890,000	
酒井重工業	2,900	2,943.00	8,534,700	
荏原製作所	61,200	5,440.00	332,928,000	貸付有価証券 100株
石井鐵工所	2,100	2,910.00	6,111,000	貸付有価証券 300株（300株）
西島製作所	14,500	1,337.00	19,386,500	
北越工業	15,000	988.00	14,820,000	
ダイキン工業	194,800	25,795.00	5,024,866,000	貸付有価証券 100株
オルガノ	5,100	9,650.00	49,215,000	
トーヨーカネツ	6,200	2,640.00	16,368,000	
栗田工業	90,100	5,730.00	516,273,000	貸付有価証券 1,900株
椿本チエイン	23,300	3,135.00	73,045,500	
大同工業	7,300	761.00	5,555,300	貸付有価証券 100株
木村化工機	13,700	720.00	9,864,000	貸付有価証券 4,500株
アネスト岩田	27,700	960.00	26,592,000	
ダイフク	84,100	8,620.00	724,942,000	
サムコ	4,900	2,983.00	14,616,700	貸付有価証券 1,000株
加藤製作所	8,500	794.00	6,749,000	
油研工業	2,700	1,807.00	4,878,900	
タダノ	86,100	975.00	83,947,500	貸付有価証券 600株
フジテック	54,800	2,956.00	161,988,800	
C K D	45,100	1,867.00	84,201,700	貸付有価証券

				500株
キトー	14,000	2,652.00	37,128,000	貸付有価証券 100株
平和	49,700	2,083.00	103,525,100	
理想科学工業	15,000	2,492.00	37,380,000	
SANKYO	36,700	4,010.00	147,167,000	
日本金銭機械	18,100	673.00	12,181,300	
マースグループホールディングス	11,300	1,597.00	18,046,100	
フクシマガリレイ	11,000	3,860.00	42,460,000	
オーイズミ	6,200	398.00	2,467,600	
ダイコク電機	8,200	1,287.00	10,553,400	貸付有価証券 2,600株
竹内製作所	27,100	2,579.00	69,890,900	
アマノ	46,700	2,650.00	123,755,000	
JUKI	23,200	722.00	16,750,400	
ジャノメ	15,100	717.00	10,826,700	貸付有価証券 2,400株
マックス	21,100	2,011.00	42,432,100	
グローリー	42,300	2,223.00	94,032,900	
新晃工業	16,600	1,631.00	27,074,600	貸付有価証券 100株
大和冷機工業	22,900	1,183.00	27,090,700	
セガサミーホールディングス	160,300	2,093.00	335,507,900	貸付有価証券 300株
日本ピストンリング	6,500	1,251.00	8,131,500	
リケン	6,500	2,413.00	15,684,500	
T P R	19,400	1,275.00	24,735,000	
ツバキ・ナカシマ	36,800	1,076.00	39,596,800	
ホシザキ	96,300	4,250.00	409,275,000	
大豊工業	14,500	725.00	10,512,500	
日本精工	305,300	781.00	238,439,300	
NTN	324,400	267.00	86,614,800	貸付有価証券 11,300株
ジェイテクト	152,100	1,025.00	155,902,500	貸付有価証券 400株
不二越	11,000	3,830.00	42,130,000	
日本トムソン	40,700	558.00	22,710,600	
THK	86,300	2,866.00	247,335,800	

ユーシン精機	13,800	721.00	9,949,800	
前澤給装工業	11,500	929.00	10,683,500	
イーグル工業	19,300	1,102.00	21,268,600	
前澤工業	10,700	630.00	6,741,000	
日本ピラー工業	15,300	2,680.00	41,004,000	
キット	55,100	780.00	42,978,000	
マキタ	201,600	3,476.00	700,761,600	貸付有価証券 2,200株
三井E&Sホールディングス	66,600	433.00	28,837,800	貸付有価証券 10,500株
日立造船	141,400	847.00	119,765,800	
三菱重工	261,600	4,838.00	1,265,620,800	
I H I	111,400	3,425.00	381,545,000	貸付有価証券 2,300株
サノヤスホールディングス	20,200	124.00	2,504,800	貸付有価証券 4,200株
スター精密	28,900	1,814.00	52,424,600	貸付有価証券 4,000株
日清紡ホールディングス	121,800	1,073.00	130,691,400	
イビデン	85,800	4,690.00	402,402,000	
コニカミノルタ	361,900	485.00	175,521,500	
ブラザー工業	203,300	2,680.00	544,844,000	
ミネベアミツミ	283,800	2,541.00	721,135,800	貸付有価証券 400株
日立製作所	857,900	6,990.00	5,996,721,000	
東芝	311,800	5,295.00	1,650,981,000	
三菱電機	1,664,700	1,457.00	2,425,467,900	貸付有価証券 1,800株
富士電機	99,200	6,080.00	603,136,000	
東洋電機製造	5,900	935.00	5,516,500	
安川電機	177,200	4,830.00	855,876,000	
シンフォニアテクノロジー	18,100	1,563.00	28,290,300	
明電舎	25,200	2,030.00	51,156,000	
オリジン	4,100	1,328.00	5,444,800	
山洋電気	6,500	5,500.00	35,750,000	
デンヨー	12,700	1,617.00	20,535,900	
PHCホールディングス	27,600	1,638.00	45,208,800	

東芝テック	19,100	4,475.00	85,472,500	
芝浦メカトロニクス	3,200	10,960.00	35,072,000	
マブチモーター	37,100	4,000.00	148,400,000	
日本電産	396,300	9,903.00	3,924,558,900	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,300	475.00	2,992,500	貸付有価証券 600株（600株）
トレックス・セミコンダクター	7,700	2,915.00	22,445,500	
東光高岳	9,900	1,914.00	18,948,600	貸付有価証券 900株
ダブル・スコープ	48,900	2,304.00	112,665,600	貸付有価証券 23,800株（23,200株）
ダイヘン	16,500	3,895.00	64,267,500	
ヤーマン	29,100	1,534.00	44,639,400	貸付有価証券 3,100株（2,000株）
JVCケンウッド	145,300	205.00	29,786,500	
ミマキエンジニアリング	16,000	672.00	10,752,000	
IPEX	8,300	1,372.00	11,387,600	
日新電機	41,800	1,576.00	65,876,800	
大崎電気工業	30,000	572.00	17,160,000	
オムロン	148,500	7,857.00	1,166,764,500	貸付有価証券 400株
日東工業	22,400	2,505.00	56,112,000	
IDEC	22,100	2,901.00	64,112,100	
正興電機製作所	6,300	1,113.00	7,011,900	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
不二電機工業	3,300	1,111.00	3,666,300	
ジーエス・ユアサコーポレーション	53,600	2,538.00	136,036,800	
サクサホールディングス	4,200	1,296.00	5,443,200	
メルコホールディングス	5,000	3,390.00	16,950,000	貸付有価証券 1,600株
テクノメディカ	4,000	1,632.00	6,528,000	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	5,000	1,502.00	7,510,000	貸付有価証券 2,200株（1,700株）
日本電気	211,500	4,985.00	1,054,327,500	
富士通	160,500	16,990.00	2,726,895,000	貸付有価証券 100株
沖電気工業	67,600	760.00	51,376,000	

岩崎通信機	7,300	776.00	5,664,800	
電気興業	8,600	2,420.00	20,812,000	
サンケン電気	15,300	5,020.00	76,806,000	貸付有価証券 3,400株
ナカヨ	2,900	1,101.00	3,192,900	
アイホン	8,100	2,038.00	16,507,800	
ルネサスエレクトロニクス	973,400	1,346.00	1,310,196,400	貸付有価証券 2,100株
セイコーエプソン	199,200	2,224.00	443,020,800	
ワコム	136,700	866.00	118,382,200	貸付有価証券 43,300株
アルバック	35,500	5,400.00	191,700,000	貸付有価証券 13,900株
アクセル	6,800	1,005.00	6,834,000	貸付有価証券 600株（600株）
E I Z O	12,200	3,860.00	47,092,000	
日本信号	37,800	955.00	36,099,000	
京三製作所	34,800	439.00	15,277,200	
能美防災	20,200	1,695.00	34,239,000	
ホーチキ	11,200	1,302.00	14,582,400	
星和電機	6,600	459.00	3,029,400	貸付有価証券 100株
エレコム	40,900	1,742.00	71,247,800	
パナソニック ホールディングス	1,902,400	1,156.00	2,199,174,400	
シャープ	169,400	1,051.00	178,039,400	貸付有価証券 44,900株
アンリツ	112,800	1,650.00	186,120,000	
富士通ゼネラル	48,400	2,877.00	139,246,800	貸付有価証券 600株
ソニーグループ	1,117,400	11,960.00	13,364,104,000	
T D K	258,400	5,060.00	1,307,504,000	
帝国通信工業	7,900	1,497.00	11,826,300	
タムラ製作所	64,200	670.00	43,014,000	貸付有価証券 400株
アルプスアルパイン	145,700	1,285.00	187,224,500	貸付有価証券 2,200株
池上通信機	5,200	604.00	3,140,800	
日本電波工業	17,900	1,376.00	24,630,400	

鈴木	8,800	844.00	7,427,200	
メイコー	19,300	3,340.00	64,462,000	
日本トリム	3,400	2,473.00	8,408,200	
ローランド ディー. ジー.	8,400	3,520.00	29,568,000	
フォスター電機	16,600	866.00	14,375,600	
SMK	4,000	2,326.00	9,304,000	
ヨコオ	11,900	2,187.00	26,025,300	
ティアック	27,200	122.00	3,318,400	貸付有価証券 800株（700株）
ホシデン	39,400	1,535.00	60,479,000	
ヒロセ電機	24,700	20,200.00	498,940,000	
日本航空電子工業	35,800	2,406.00	86,134,800	
TOA	19,100	816.00	15,585,600	貸付有価証券 100株
マクセル	32,500	1,458.00	47,385,000	
古野電気	21,200	1,120.00	23,744,000	
ユニデンホールディング ス	3,900	4,100.00	15,990,000	
スミダコーポレーション	13,700	975.00	13,357,500	
アイコム	5,800	2,665.00	15,457,000	
リオン	6,100	2,152.00	13,127,200	
本多通信工業	13,800	704.00	9,715,200	貸付有価証券 1,800株
横河電機	163,600	2,405.00	393,458,000	
新電元工業	6,300	3,540.00	22,302,000	
アズビル	103,500	4,125.00	426,937,500	貸付有価証券 700株
東亜ディーケーケー	8,800	850.00	7,480,000	貸付有価証券 200株（200株）
日本光電工業	68,400	3,105.00	212,382,000	
チノー	5,600	1,696.00	9,497,600	
共和電業	15,500	326.00	5,053,000	貸付有価証券 100株
日本電子材料	8,400	1,649.00	13,851,600	
堀場製作所	33,000	6,410.00	211,530,000	貸付有価証券 500株
アドバンテスト	132,600	8,540.00	1,132,404,000	貸付有価証券 600株

小野測器	6,100	419.00	2,555,900	
エスベック	13,200	1,865.00	24,618,000	
キーエンス	161,600	57,250.00	9,251,600,000	貸付有価証券 100株
日置電機	7,800	6,710.00	52,338,000	
シスメックス	127,700	9,006.00	1,150,066,200	
日本マイクロニクス	24,400	1,443.00	35,209,200	
メガチップス	15,800	2,878.00	45,472,400	貸付有価証券 200株
OBARA GROUP	6,900	3,265.00	22,528,500	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
澤藤電機	2,200	1,359.00	2,989,800	
原田工業	8,400	811.00	6,812,400	貸付有価証券 900株
コーセル	19,800	883.00	17,483,400	
イリソ電子工業	15,000	3,995.00	59,925,000	
オブテックスグループ	27,200	2,071.00	56,331,200	貸付有価証券 400株
千代田インテグレ	6,000	2,240.00	13,440,000	
レーザーテック	73,100	21,085.00	1,541,313,500	貸付有価証券 700株
スタンレー電気	115,000	2,544.00	292,560,000	貸付有価証券 100株
岩崎電気	5,600	2,592.00	14,515,200	
ウシオ電機	84,400	1,828.00	154,283,200	貸付有価証券 2,100株
岡谷電機産業	12,700	251.00	3,187,700	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ヘリオス テクノ ホールディング	15,200	366.00	5,563,200	
エノモト	4,900	1,589.00	7,786,100	
日本セラミック	15,100	2,635.00	39,788,500	
遠藤照明	8,200	749.00	6,141,800	
古河電池	12,700	1,175.00	14,922,500	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
双信電機	8,500	458.00	3,893,000	
山一電機	11,600	2,025.00	23,490,000	
図研	11,600	3,690.00	42,804,000	
日本電子	34,200	5,910.00	202,122,000	貸付有価証券

				100株
カシオ計算機	110,300	1,369.00	151,000,700	
ファナック	156,500	24,530.00	3,838,945,000	
日本シイエムケイ	31,400	460.00	14,444,000	貸付有価証券 100株
エンプラス	4,400	4,120.00	18,128,000	
大真空	22,100	990.00	21,879,000	貸付有価証券 2,400株（1,800株）
ローム	74,200	10,450.00	775,390,000	
浜松ホトニクス	118,800	6,210.00	737,748,000	貸付有価証券 200株
三井ハイテック	15,300	9,010.00	137,853,000	貸付有価証券 700株
新光電気工業	52,400	3,850.00	201,740,000	
京セラ	250,900	7,724.00	1,937,951,600	
太陽誘電	79,300	4,565.00	362,004,500	
村田製作所	486,500	7,895.00	3,840,917,500	
双葉電子工業	30,500	664.00	20,252,000	
北陸電気工業	6,700	1,125.00	7,537,500	
ニチコン	47,500	1,418.00	67,355,000	貸付有価証券 1,800株
日本ケミコン	16,900	1,773.00	29,963,700	
KOA	24,700	2,213.00	54,661,100	
市光工業	21,300	381.00	8,115,300	貸付有価証券 700株
小糸製作所	89,000	4,795.00	426,755,000	
ミツバ	27,800	416.00	11,564,800	
S C R E E Nホールディ ングス	28,100	9,850.00	276,785,000	
キャノン電子	16,400	1,721.00	28,224,400	
キャノン	812,500	3,478.00	2,825,875,000	貸付有価証券 1,600株
リコー	424,400	1,113.00	472,357,200	
象印マホービン	44,200	1,614.00	71,338,800	貸付有価証券 1,900株
M U T O Hホールディ ングス	2,200	1,995.00	4,389,000	貸付有価証券 300株（100株）
東京エレクトロン	113,200	46,290.00	5,240,028,000	
トヨタ紡織	62,400	2,075.00	129,480,000	

芦森工業	3,400	1,038.00	3,529,200	
ユニプレス	29,200	970.00	28,324,000	
豊田自動織機	126,300	8,090.00	1,021,767,000	貸付有価証券 100株
モリタホールディングス	28,600	1,343.00	38,409,800	
三櫻工業	24,700	756.00	18,673,200	
デンソー	349,100	7,930.00	2,768,363,000	貸付有価証券 100株
東海理化電機製作所	47,000	1,558.00	73,226,000	
川崎重工業	120,900	2,627.00	317,604,300	
名村造船所	46,000	670.00	30,820,000	貸付有価証券 21,600株
日本車輛製造	5,700	2,174.00	12,391,800	
三菱ロジスネクスト	23,600	867.00	20,461,200	貸付有価証券 400株
近畿車輛	2,700	1,044.00	2,818,800	
日産自動車	2,103,700	539.00	1,133,894,300	
いすゞ自動車	516,700	1,588.00	820,519,600	
トヨタ自動車	8,131,600	2,183.00	17,751,282,800	
日野自動車	222,700	657.00	146,313,900	
三菱自動車工業	660,200	523.00	345,284,600	
エフテック	11,400	520.00	5,928,000	
レシップホールディングス	7,100	534.00	3,791,400	
GMB	3,200	716.00	2,291,200	
ファルテック	3,100	591.00	1,832,100	
武蔵精密工業	39,800	1,627.00	64,754,600	
日産車体	26,100	755.00	19,705,500	貸付有価証券 10,900株
新明和工業	46,500	1,072.00	49,848,000	
極東開発工業	28,400	1,420.00	40,328,000	
トピー工業	13,300	1,386.00	18,433,800	
ティラド	4,800	2,763.00	13,262,400	
タチエス	29,300	1,190.00	34,867,000	
NOK	67,100	1,238.00	83,069,800	
フタバ産業	39,700	376.00	14,927,200	
KYB	15,700	3,235.00	50,789,500	
大同メタル工業	34,200	535.00	18,297,000	

プレス工業	79,900	425.00	33,957,500	
ミクニ	20,700	326.00	6,748,200	
太平洋工業	34,000	1,123.00	38,182,000	貸付有価証券 100株
河西工業	21,900	245.00	5,365,500	貸付有価証券 100株
アイシン	130,600	4,295.00	560,927,000	貸付有価証券 200株
マツダ	524,800	1,254.00	658,099,200	貸付有価証券 4,400株
今仙電機製作所	11,700	583.00	6,821,100	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,304,100	3,699.00	4,823,865,900	
スズキ	353,600	4,896.00	1,731,225,600	貸付有価証券 400株
S U B A R U	468,600	2,484.50	1,164,236,700	
安永	7,200	687.00	4,946,400	
ヤマハ発動機	232,700	2,879.00	669,943,300	貸付有価証券 1,500株
T B K	17,900	325.00	5,817,500	
エクセディ	26,900	1,820.00	48,958,000	
豊田合成	50,400	2,367.00	119,296,800	
愛三工業	27,900	719.00	20,060,100	
盟和産業	2,500	982.00	2,455,000	
日本プラスト	12,900	469.00	6,050,100	
ヨロズ	13,900	884.00	12,287,600	
エフ・シー・シー	29,200	1,482.00	43,274,400	
シマノ	60,600	25,535.00	1,547,421,000	貸付有価証券 200株
テイ・エス テック	75,300	1,615.00	121,609,500	貸付有価証券 600株
ジャムコ	10,400	1,292.00	13,436,800	貸付有価証券 300株
テルモ	504,700	4,724.00	2,384,202,800	貸付有価証券 800株
クリエートメディック	5,400	950.00	5,130,000	
日機装	37,000	1,023.00	37,851,000	貸付有価証券 200株
日本エム・ディ・エム	10,300	1,453.00	14,965,900	
島津製作所	213,200	4,375.00	932,750,000	貸付有価証券

				200株
JMS	13,700	580.00	7,946,000	
クボテック	3,800	250.00	950,000	貸付有価証券 100株（100株）
長野計器	11,800	1,136.00	13,404,800	
ブイ・テクノロジー	7,800	3,010.00	23,478,000	
東京計器	11,300	1,279.00	14,452,700	貸付有価証券 2,000株（800株）
愛知時計電機	6,400	1,471.00	9,414,400	
インターアクション	8,900	1,793.00	15,957,700	
オーバル	15,900	518.00	8,236,200	貸付有価証券 3,400株
東京精密	27,800	4,670.00	129,826,000	
マニー	65,100	1,772.00	115,357,200	
ニコン	251,400	1,602.00	402,742,800	
トプコン	83,900	1,889.00	158,487,100	
オリンパス	854,500	3,087.00	2,637,841,500	
理研計器	11,800	4,500.00	53,100,000	
タムロン	11,100	3,130.00	34,743,000	
HOYA	344,400	15,150.00	5,217,660,000	
シード	8,300	560.00	4,648,000	
ノーリツ銅機	14,000	2,525.00	35,350,000	
A&Dホロンホールディングス	20,000	933.00	18,660,000	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
朝日インテック	195,600	2,692.00	526,555,200	貸付有価証券 3,000株
シチズン時計	174,100	597.00	103,937,700	貸付有価証券 300株
リズム	5,600	1,500.00	8,400,000	貸付有価証券 100株
大研医器	14,100	474.00	6,683,400	貸付有価証券 200株
メニコン	55,000	3,555.00	195,525,000	貸付有価証券 4,400株
シンシア	1,500	495.00	742,500	
松風	5,900	2,189.00	12,915,100	
セイコーホールディングス	25,200	2,812.00	70,862,400	貸付有価証券 300株
ニプロ	123,400	1,129.00	139,318,600	貸付有価証券

				300株
中本パックス	5,000	1,610.00	8,050,000	貸付有価証券 200株（200株）
スノーピーク	25,300	2,350.00	59,455,000	貸付有価証券 11,800株（1,300株）
パラマウントベッドホールディングス	34,200	2,679.00	91,621,800	
トランザクション	11,400	1,118.00	12,745,200	貸付有価証券 700株（100株）
粧美堂	4,500	405.00	1,822,500	貸付有価証券 2,000株
ニホンフラッシュ	13,900	974.00	13,538,600	
前田工織	16,100	3,215.00	51,761,500	貸付有価証券 100株
永大産業	19,400	258.00	5,005,200	
アートネイチャー	15,200	761.00	11,567,200	
バンダイナムコホールディングス	147,500	11,035.00	1,627,662,500	貸付有価証券 400株
アイフィスジャパン	4,500	605.00	2,722,500	貸付有価証券 1,700株
共立印刷	24,400	151.00	3,684,400	
SHOEI	15,600	5,770.00	90,012,000	
フランスベッドホールディングス	22,900	925.00	21,182,500	
パイロットコーポレーション	23,200	5,300.00	122,960,000	
萩原工業	9,900	1,142.00	11,305,800	貸付有価証券 2,200株
フジシールインターナショナル	36,600	1,593.00	58,303,800	
タカラトミー	73,600	1,337.00	98,403,200	
広済堂ホールディングス	11,100	1,121.00	12,443,100	
エステールホールディングス	3,800	624.00	2,371,200	貸付有価証券 1,800株
タカノ	6,100	764.00	4,660,400	貸付有価証券 2,400株
プロネクサス	13,800	1,094.00	15,097,200	
ホクシン	12,600	158.00	1,990,800	貸付有価証券 1,100株（200株）
ウッドワン	5,500	1,108.00	6,094,000	
大建工業	9,000	1,971.00	17,739,000	

凸版印刷	232,400	2,285.00	531,034,000	貸付有価証券 100株
大日本印刷	193,300	3,010.00	581,833,000	貸付有価証券 100株
共同印刷	4,600	2,456.00	11,297,600	
N I S S H A	28,200	1,819.00	51,295,800	貸付有価証券 2,200株
光村印刷	1,400	1,223.00	1,712,200	
TAKARA & CO MPANY	10,200	2,030.00	20,706,000	貸付有価証券 1,400株
アシックス	136,700	2,672.00	365,262,400	貸付有価証券 1,600株
ツツミ	4,400	1,990.00	8,756,000	
ローランド	10,900	4,360.00	47,524,000	
小松ウオール工業	5,400	1,918.00	10,357,200	
ヤマハ	103,700	5,820.00	603,534,000	貸付有価証券 1,200株
河合楽器製作所	4,500	2,810.00	12,645,000	
クリナップ	16,600	632.00	10,491,200	貸付有価証券 200株
ピジョン	94,300	2,114.00	199,350,200	貸付有価証券 2,400株
兼松サステック	1,100	1,623.00	1,785,300	
キングジム	13,100	922.00	12,078,200	貸付有価証券 800株（200株）
リンテック	34,000	2,373.00	80,682,000	
イトーキ	30,300	403.00	12,210,900	
任天堂	100,700	60,140.00	6,056,098,000	
三菱鉛筆	21,400	1,435.00	30,709,000	貸付有価証券 300株
タカラスタANDARD	28,700	1,346.00	38,630,200	
コクヨ	71,300	1,815.00	129,409,500	
ナカバヤシ	14,400	522.00	7,516,800	
グローブライド	13,300	2,637.00	35,072,100	
オカムラ	50,200	1,307.00	65,611,400	
美津濃	14,700	2,644.00	38,866,800	
東京電力ホールディング ス	1,334,900	510.00	680,799,000	
中部電力	503,700	1,417.00	713,742,900	

関西電力	623,800	1,280.00	798,464,000	貸付有価証券 800株
中国電力	257,300	862.00	221,792,600	
北陸電力	151,400	532.00	80,544,800	貸付有価証券 400株
東北電力	389,900	663.00	258,503,700	
四国電力	148,300	823.00	122,050,900	
九州電力	341,400	845.00	288,483,000	
北海道電力	155,000	520.00	80,600,000	
沖縄電力	37,800	1,171.00	44,263,800	貸付有価証券 2,200株
電源開発	131,800	2,048.00	269,926,400	
エフオン	10,800	656.00	7,084,800	貸付有価証券 100株
イーレックス	23,000	2,765.00	63,595,000	
レノバ	35,000	2,919.00	102,165,000	貸付有価証券 16,200株（14,300株）
東京瓦斯	317,500	2,655.00	842,962,500	貸付有価証券 300株
大阪瓦斯	300,000	2,407.00	722,100,000	
東邦瓦斯	69,900	3,090.00	215,991,000	
北海道瓦斯	8,800	1,625.00	14,300,000	
広島ガス	31,200	326.00	10,171,200	
西部ガスホールディングス	17,000	1,768.00	30,056,000	
静岡ガス	33,800	1,087.00	36,740,600	
メタウォーター	18,500	2,055.00	38,017,500	
S B Sホールディングス	13,200	2,902.00	38,306,400	
東武鉄道	162,700	3,300.00	536,910,000	貸付有価証券 200株
相鉄ホールディングス	53,000	2,443.00	129,479,000	
東急	415,300	1,667.00	692,305,100	貸付有価証券 8,000株
京浜急行電鉄	198,500	1,442.00	286,237,000	貸付有価証券 17,300株
小田急電鉄	224,500	1,962.00	440,469,000	貸付有価証券 1,700株
京王電鉄	78,300	5,430.00	425,169,000	
京成電鉄	105,000	3,875.00	406,875,000	

富士急行	18,200	4,210.00	76,622,000	
新京成電鉄	4,100	3,155.00	12,935,500	
東日本旅客鉄道	272,100	7,016.00	1,909,053,600	貸付有価証券 2,700株
西日本旅客鉄道	189,200	5,212.00	986,110,400	貸付有価証券 600株
東海旅客鉄道	125,500	16,100.00	2,020,550,000	貸付有価証券 1,100株
西武ホールディングス	215,000	1,410.00	303,150,000	
鴻池運輸	25,200	1,292.00	32,558,400	
西日本鉄道	42,900	2,895.00	124,195,500	
ハマキョウレックス	11,600	3,230.00	37,468,000	
サカイ引越センター	8,200	5,500.00	45,100,000	
近鉄グループホールディングス	158,400	4,765.00	754,776,000	貸付有価証券 2,400株
阪急阪神ホールディングス	197,100	4,140.00	815,994,000	貸付有価証券 300株
南海電気鉄道	70,700	2,733.00	193,223,100	貸付有価証券 2,000株
京阪ホールディングス	65,800	3,530.00	232,274,000	
神戸電鉄	4,000	3,395.00	13,580,000	貸付有価証券 1,500株
名古屋鉄道	163,400	2,162.00	353,270,800	貸付有価証券 600株
山陽電気鉄道	12,100	2,357.00	28,519,700	
アルプス物流	11,800	1,184.00	13,971,200	貸付有価証券 300株（300株）
ヤマトホールディングス	231,400	2,286.00	528,980,400	
山九	41,000	4,360.00	178,760,000	
丸運	8,000	232.00	1,856,000	
丸全昭和運輸	11,400	3,235.00	36,879,000	
センコーグループホールディングス	78,300	938.00	73,445,400	
トナミホールディングス	3,200	3,795.00	12,144,000	
ニッコンホールディングス	51,000	2,406.00	122,706,000	貸付有価証券 300株
日本石油輸送	1,800	2,426.00	4,366,800	
福山通運	21,600	3,350.00	72,360,000	貸付有価証券 200株
セイノーホールディング	92,000	1,161.00	106,812,000	

ス				
エスライン	4,600	828.00	3,808,800	
神奈川中央交通	4,200	3,730.00	15,666,000	貸付有価証券 1,500株
日立物流	32,600	8,760.00	285,576,000	貸付有価証券 400株（400株）
丸和運輸機関	28,500	1,686.00	48,051,000	貸付有価証券 1,900株
C & F ロジホールディングス	14,200	1,237.00	17,565,400	
九州旅客鉄道	113,200	2,861.00	323,865,200	
S G ホールディングス	283,700	2,392.00	678,610,400	
N I P P O N E X P R E S S ホールディング	55,200	8,100.00	447,120,000	
日本郵船	141,300	10,650.00	1,504,845,000	
商船三井	260,500	3,745.00	975,572,500	貸付有価証券 600株
川崎汽船	52,000	9,400.00	488,800,000	貸付有価証券 5,900株
N S ユナイテッド海運	8,000	4,795.00	38,360,000	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
明治海運	15,900	910.00	14,469,000	貸付有価証券 7,300株
飯野海運	66,300	826.00	54,763,800	
共栄タンカー	3,000	935.00	2,805,000	貸付有価証券 300株（300株）
乾汽船	10,100	2,059.00	20,795,900	貸付有価証券 1,400株（200株）
日本航空	363,100	2,414.00	876,523,400	貸付有価証券 35,500株
A N A ホールディングス	402,300	2,598.00	1,045,175,400	貸付有価証券 86,400株
パスコ	3,200	1,318.00	4,217,600	
トランコム	4,700	7,690.00	36,143,000	貸付有価証券 1,900株
日新	12,300	1,850.00	22,755,000	
三菱倉庫	40,900	3,715.00	151,943,500	
三井倉庫ホールディングス	16,500	3,385.00	55,852,500	
住友倉庫	49,600	2,207.00	109,467,200	
澁澤倉庫	8,400	2,151.00	18,068,400	

東陽倉庫	24,000	286.00	6,864,000	
日本トランスシティ	29,700	517.00	15,354,900	
ケイヒン	2,900	1,449.00	4,202,100	
中央倉庫	8,700	977.00	8,499,900	
川西倉庫	3,100	1,069.00	3,313,900	貸付有価証券 1,400株（100株）
安田倉庫	11,300	943.00	10,655,900	
ファイズホールディングス	3,600	911.00	3,279,600	
東洋埠頭	4,700	1,236.00	5,809,200	
上組	80,200	2,714.00	217,662,800	
サンリツ	4,300	695.00	2,988,500	
キムラユニティー	8,800	769.00	6,767,200	貸付有価証券 100株
キューソー流通システム	9,800	1,257.00	12,318,600	貸付有価証券 3,600株
東海運	9,600	284.00	2,726,400	
エーアイテイー	10,600	1,717.00	18,200,200	貸付有価証券 300株（300株）
内外トランスライン	5,300	2,146.00	11,373,800	貸付有価証券 2,500株
日本コンセプト	4,600	1,809.00	8,321,400	貸付有価証券 100株（100株）
NEC ネットエスアイ	57,900	1,789.00	103,583,100	
クロスキャット	9,400	1,228.00	11,543,200	貸付有価証券 800株
システナ	249,700	449.00	112,115,300	
デジタルアーツ	9,400	6,950.00	65,330,000	
日鉄ソリューションズ	30,400	3,755.00	114,152,000	
キューブシステム	8,800	1,026.00	9,028,800	貸付有価証券 3,500株
WOW WORLD	2,400	852.00	2,044,800	
コア	7,400	1,520.00	11,248,000	
手間いらず	2,500	4,925.00	12,312,500	
ラクーンホールディングス	14,900	1,409.00	20,994,100	貸付有価証券 200株
ソリトンシステムズ	7,700	1,213.00	9,340,100	貸付有価証券 300株（200株）
ソフトクリエイトホール	7,600	3,880.00	29,488,000	

ディングス				
T I S	153,000	3,980.00	608,940,000	
J N Sホールディングス	8,100	398.00	3,223,800	貸付有価証券 300株
グリー	79,600	905.00	72,038,000	貸付有価証券 13,400株（3,300株）
GMOペパボ	2,100	1,994.00	4,187,400	貸付有価証券 100株
コーエーテクモホール ディングス	55,800	4,900.00	273,420,000	貸付有価証券 300株
三菱総合研究所	7,300	4,265.00	31,134,500	
ボルテージ	4,700	329.00	1,546,300	貸付有価証券 100株（100株）
電算	1,900	2,110.00	4,009,000	
A G S	6,900	723.00	4,988,700	貸付有価証券 400株
ファインデックス	11,800	681.00	8,035,800	
ブレインパッド	14,800	1,204.00	17,819,200	
K L a b	27,800	432.00	12,009,600	貸付有価証券 500株
ポールトゥウィンホール ディングス	25,400	1,133.00	28,778,200	
ネクソン	399,600	2,901.00	1,159,239,600	
アイスタイル	45,200	453.00	20,475,600	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
エムアップホールディン グス	20,200	1,506.00	30,421,200	
エイチーム	11,000	794.00	8,734,000	
エニグモ	18,900	589.00	11,132,100	貸付有価証券 7,800株（7,800株）
テクノスジャパン	13,600	471.00	6,405,600	
e n i s h	12,400	488.00	6,051,200	貸付有価証券 1,300株
コロプラ	57,600	724.00	41,702,400	貸付有価証券 900株
オルトプラス	12,500	343.00	4,287,500	貸付有価証券 1,400株（300株）
ブロードリーフ	86,700	499.00	43,263,300	貸付有価証券 43,600株
クロス・マーケティング グループ	6,600	939.00	6,197,400	貸付有価証券 3,100株（1,500株）

デジタルハーツホールディングス	7,900	1,922.00	15,183,800	
システム情報	13,100	1,036.00	13,571,600	
メディアドゥ	6,000	2,238.00	13,428,000	
じげん	49,500	343.00	16,978,500	貸付有価証券 200株
ブイキューブ	17,800	1,365.00	24,297,000	貸付有価証券 8,300株（5,400株）
エンカレッジ・テクノロジー	3,800	525.00	1,995,000	
サイバーリンクス	5,300	1,250.00	6,625,000	
ディー・エル・イー	11,700	395.00	4,621,500	貸付有価証券 3,100株（800株）
フィックスターズ	16,800	1,170.00	19,656,000	
CARTA HOLDINGS	7,100	1,785.00	12,673,500	貸付有価証券 1,100株（200株）
オブティム	12,200	934.00	11,394,800	
セレス	5,900	1,321.00	7,793,900	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
SHIFT	10,900	21,740.00	236,966,000	貸付有価証券 100株
ティーガイア	15,500	1,641.00	25,435,500	
セック	2,600	2,309.00	6,003,400	
テクマトリックス	29,600	1,956.00	57,897,600	
プロシップ	5,800	1,449.00	8,404,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,500	2,430.00	110,565,000	貸付有価証券 800株
GMOペイメントゲートウェイ	33,900	11,600.00	393,240,000	
ザッパラス	6,000	314.00	1,884,000	貸付有価証券 100株
システムリサーチ	5,100	2,073.00	10,572,300	貸付有価証券 100株
インターネットイニシアティブ	46,600	5,140.00	239,524,000	
さくらインターネット	18,800	591.00	11,110,800	
ヴィンクス	4,900	1,544.00	7,565,600	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,500	5,870.00	26,415,000	
SRAホールディングス	8,400	3,020.00	25,368,000	

システムインテグレータ	5,500	480.00	2,640,000	貸付有価証券 2,500株
朝日ネット	15,900	642.00	10,207,800	
e B A S E	20,900	627.00	13,104,300	貸付有価証券 100株
アバント	18,800	1,428.00	26,846,400	
アドソル日進	6,200	1,685.00	10,447,000	貸付有価証券 100株（100株）
ODKソリューションズ	3,600	588.00	2,116,800	
フリービット	9,100	937.00	8,526,700	
コムチュア	19,600	2,433.00	47,686,800	
サイバーコム	2,700	1,228.00	3,315,600	
アステリア	12,600	871.00	10,974,600	貸付有価証券 5,900株（4,600株）
アイル	8,300	1,780.00	14,774,000	貸付有価証券 600株（600株）
マークラインズ	8,000	2,284.00	18,272,000	
メディカル・データ・ビ ジョン	22,200	1,302.00	28,904,400	
g u m i	24,200	777.00	18,803,400	貸付有価証券 7,500株（7,500株）
ショーケース	3,800	420.00	1,596,000	
モバイルファクトリー	3,500	1,030.00	3,605,000	
テラスカイ	6,400	1,920.00	12,288,000	貸付有価証券 3,000株（1,000株）
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	7,700	1,426.00	10,980,200	
P C I ホールディングス	6,900	997.00	6,879,300	
パイプドHD	3,200	2,794.00	8,940,800	
アイビーシー	2,500	405.00	1,012,500	
ネオジャパン	5,000	1,167.00	5,835,000	貸付有価証券 700株（700株）
P R T I M E S	3,700	2,474.00	9,153,800	貸付有価証券 1,700株（1,300株）
ラクス	80,300	2,007.00	161,162,100	
ランドコンピュータ	4,000	887.00	3,548,000	貸付有価証券 100株（100株）
ダブルスタンダード	5,300	2,700.00	14,310,000	
オープンドア	10,400	2,023.00	21,039,200	貸付有価証券 4,300株（3,300株）

マイネット	5,300	516.00	2,734,800	
アカツキ	7,800	2,462.00	19,203,600	
ベネフィットジャパン	1,300	1,579.00	2,052,700	
Ubicomホールディングス	4,600	2,580.00	11,868,000	貸付有価証券 1,300株
カナミックネットワーク	21,300	583.00	12,417,900	
ノムラシステムコーポレーション	15,400	125.00	1,925,000	
チェンジ	36,400	2,069.00	75,311,600	貸付有価証券 8,800株
シンクロ・フード	8,900	468.00	4,165,200	
オークネット	7,700	2,327.00	17,917,900	貸付有価証券 3,500株
キャピタル・アセット・プランニング	3,200	667.00	2,134,400	
セグエグループ	4,500	621.00	2,794,500	
エイトレッド	2,500	1,867.00	4,667,500	貸付有価証券 1,300株
マクロミル	33,600	1,100.00	36,960,000	
ビーグリー	2,700	1,328.00	3,585,600	貸付有価証券 800株
オロ	4,500	1,567.00	7,051,500	貸付有価証券 400株（300株）
ユーザーローカル	5,300	1,697.00	8,994,100	
テモナ	3,200	332.00	1,062,400	
ニーズウェル	5,100	646.00	3,294,600	
マネーフォワード	35,700	4,065.00	145,120,500	貸付有価証券 2,100株
サインポスト	5,700	873.00	4,976,100	貸付有価証券 2,000株（1,100株）
電算システムホールディングス	7,200	2,498.00	17,985,600	
ソルクシーズ	13,400	373.00	4,998,200	
フェイス	4,600	578.00	2,658,800	
プロトコーポレーション	18,600	1,200.00	22,320,000	
ハイマックス	4,600	1,384.00	6,366,400	
野村総合研究所	304,400	4,145.00	1,261,738,000	貸付有価証券 800株
サイバネットシステム	12,400	1,013.00	12,561,200	貸付有価証券 300株

C Eホールディングス	8,500	506.00	4,301,000	貸付有価証券 900株（200株）
日本システム技術	3,100	2,505.00	7,765,500	貸付有価証券 100株
インテージホールディングス	20,100	1,610.00	32,361,000	
東邦システムサイエンス	4,600	999.00	4,595,400	貸付有価証券 2,100株（100株）
ソースネクスト	75,500	261.00	19,705,500	貸付有価証券 13,900株（10,400株）
インフォコム	19,100	2,127.00	40,625,700	
シンプレクス・ホールディングス	27,700	2,202.00	60,995,400	貸付有価証券 100株
HEROZ	5,000	960.00	4,800,000	貸付有価証券 1,500株（600株）
ラクスル	20,900	2,426.00	50,703,400	貸付有価証券 9,800株（3,900株）
メルカリ	66,800	2,408.00	160,854,400	
I P S	4,800	2,839.00	13,627,200	
F I G	19,100	353.00	6,742,300	貸付有価証券 8,100株
システムサポート	6,300	1,391.00	8,763,300	
イーソル	9,500	673.00	6,393,500	貸付有価証券 2,400株（500株）
アルテリア・ネットワークス	16,600	1,270.00	21,082,000	貸付有価証券 100株
東海ソフト	2,700	931.00	2,513,700	
ウイングアーク1st	13,300	1,928.00	25,642,400	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	4,000	1,789.00	7,156,000	貸付有価証券 1,800株
サーバーワークス	3,000	2,990.00	8,970,000	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
東名	1,200	1,020.00	1,224,000	
ヴィッツ	1,600	1,048.00	1,676,800	
トビラシステムズ	4,100	909.00	3,726,900	
S a n s a n	55,400	1,548.00	85,759,200	貸付有価証券 6,200株
L i n k - U	3,100	729.00	2,259,900	貸付有価証券 500株（500株）
ギフトィ	16,000	1,942.00	31,072,000	貸付有価証券 7,500株（6,500株）

ベース	2,500	6,280.00	15,700,000	
JMDC	22,000	7,440.00	163,680,000	貸付有価証券 400株
フォーカスシステムズ	10,800	988.00	10,670,400	
クレスコ	12,700	1,858.00	23,596,600	
フジ・メディア・ホールディングス	155,600	1,119.00	174,116,400	
オービック	55,200	21,800.00	1,203,360,000	貸付有価証券 200株
ジャストシステム	24,900	3,615.00	90,013,500	
TDCソフト	13,900	1,238.00	17,208,200	
Zホールディングス	2,524,000	448.70	1,132,518,800	
トレンドマイクロ	85,800	8,940.00	767,052,000	貸付有価証券 400株（400株）
IDホールディングス	11,000	900.00	9,900,000	
日本オラクル	28,400	8,690.00	246,796,000	
アルファシステムズ	4,700	4,690.00	22,043,000	
フューチャー	37,000	1,807.00	66,859,000	
CAC Holdings	9,100	1,400.00	12,740,000	
SBテクノロジー	7,600	2,547.00	19,357,200	
トーセ	4,300	781.00	3,358,300	貸付有価証券 100株
オービックビジネスコンサルティング	16,700	5,050.00	84,335,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	79,700	3,575.00	284,927,500	
アイティフォー	21,200	787.00	16,684,400	貸付有価証券 300株
東計電算	2,100	6,570.00	13,797,000	
エックスネット	2,700	1,005.00	2,713,500	
大塚商会	84,200	4,720.00	397,424,000	貸付有価証券 100株
サイボウズ	20,500	1,320.00	27,060,000	
電通国際情報サービス	18,000	4,535.00	81,630,000	
ACCESS	19,800	810.00	16,038,000	
デジタルガレージ	29,000	4,010.00	116,290,000	
EMシステムズ	24,800	1,042.00	25,841,600	
ウェザーニューズ	5,200	8,220.00	42,744,000	

C I J	13,600	796.00	10,825,600	
ビジネスエンジニアリング	4,000	2,487.00	9,948,000	貸付有価証券 600株（300株）
日本エンタープライズ	17,100	168.00	2,872,800	貸付有価証券 400株（400株）
WOWOW	7,200	1,398.00	10,065,600	貸付有価証券 3,200株
スカラ	14,700	747.00	10,980,900	
インテリジェント ウェイブ	8,800	785.00	6,908,000	
I M A G I C A G R O U P	12,400	863.00	10,701,200	
ネットワンシステムズ	64,600	2,895.00	187,017,000	
システムソフト	51,700	109.00	5,635,300	貸付有価証券 4,700株
アルゴグラフィックス	13,600	3,750.00	51,000,000	
マーベラス	27,600	684.00	18,878,400	
エイベックス	30,200	1,608.00	48,561,600	
B I P R O G Y	54,700	3,120.00	170,664,000	
兼松エレクトロニクス	9,500	4,305.00	40,897,500	
都築電気	7,800	1,352.00	10,545,600	
T B S ホールディングス	85,500	1,651.00	141,160,500	貸付有価証券 4,500株
日本テレビホールディングス	146,100	1,214.00	177,365,400	
朝日放送グループホールディングス	13,900	658.00	9,146,200	
テレビ朝日ホールディングス	42,100	1,460.00	61,466,000	貸付有価証券 1,400株
スカパー J S A T ホールディングス	148,200	572.00	84,770,400	
テレビ東京ホールディングス	10,800	1,995.00	21,546,000	
日本BS放送	5,900	992.00	5,852,800	貸付有価証券 2,700株
ビジョン	19,500	1,285.00	25,057,500	貸付有価証券 4,200株
スマートバリュー	4,000	480.00	1,920,000	
USEN-NEXT HOLDINGS	13,300	2,163.00	28,767,900	貸付有価証券 6,200株（400株）
ワイヤレスゲート	7,200	288.00	2,073,600	

コネクション	12,400	1,310.00	16,244,000	
日本通信	145,500	235.00	34,192,500	貸付有価証券 22,100株（22,100株）
クロップス	3,200	979.00	3,132,800	
日本電信電話	1,961,900	3,731.00	7,319,848,900	
KDDI	1,276,000	4,217.00	5,380,892,000	
ソフトバンク	2,651,100	1,531.50	4,060,159,650	
光通信	20,200	16,620.00	335,724,000	
エムティーアイ	13,600	525.00	7,140,000	
GMOインターネット	55,200	2,812.00	155,222,400	
ファイバーゲート	8,000	1,056.00	8,448,000	貸付有価証券 3,700株（2,200株）
アйдママーケティング コミュニケーション	3,700	291.00	1,076,700	
KADOKAWA	94,200	3,085.00	290,607,000	
学研ホールディングス	24,700	960.00	23,712,000	
ゼンリン	28,600	946.00	27,055,600	
昭文社ホールディングス	7,000	326.00	2,282,000	貸付有価証券 700株（300株）
インプレスホールディン グス	14,500	203.00	2,943,500	貸付有価証券 100株
アイネット	8,100	1,342.00	10,870,200	
松竹	10,000	12,870.00	128,700,000	貸付有価証券 200株（100株）
東宝	103,300	5,450.00	562,985,000	
東映	4,900	19,240.00	94,276,000	
エス・ティ・ティ・デー タ	466,000	2,103.00	979,998,000	貸付有価証券 1,800株（1,800株）
ピー・シー・エー	10,200	1,171.00	11,944,200	貸付有価証券 500株
ビジネスブレイン太田昭 和	5,800	1,488.00	8,630,400	
D T S	32,600	3,545.00	115,567,000	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	81,400	6,260.00	509,564,000	
シーイーシー	18,700	1,310.00	24,497,000	
カプコン	165,000	3,710.00	612,150,000	
アイ・エス・ビー	7,600	1,270.00	9,652,000	
ジャステック	9,100	1,210.00	11,011,000	

SCSK	121,200	2,324.00	281,668,800	
NSW	6,600	2,360.00	15,576,000	
アイネス	15,000	1,680.00	25,200,000	
TKC	26,600	3,535.00	94,031,000	
富士ソフト	16,800	7,950.00	133,560,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
NSD	54,800	2,530.00	138,644,000	
コナミグループ	63,600	7,530.00	478,908,000	
福井コンピュータホールディングス	8,000	3,680.00	29,440,000	
JBCホールディングス	11,800	1,803.00	21,275,400	
ミロク情報サービス	15,400	1,538.00	23,685,200	
ソフトバンクグループ	1,049,600	5,802.00	6,089,779,200	貸付有価証券 100株
高千穂交易	6,200	2,297.00	14,241,400	貸付有価証券 2,100株
オルバヘルスケアホールディングス	2,900	1,557.00	4,515,300	
伊藤忠食品	3,500	5,180.00	18,130,000	
エレマテック	14,100	1,366.00	19,260,600	
あらた	13,000	4,175.00	54,275,000	
トーメンデバイス	2,600	5,320.00	13,832,000	
東京エレクトロン デバイス	5,200	5,510.00	28,652,000	貸付有価証券 600株
フィールズ	15,400	1,328.00	20,451,200	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
双日	180,200	2,268.00	408,693,600	貸付有価証券 6,200株
アルフレッサ ホールディングス	182,200	1,668.00	303,909,600	
横浜冷凍	42,700	934.00	39,881,800	
神栄	2,500	850.00	2,125,000	
ラサ商事	8,000	958.00	7,664,000	
アルコニックス	22,300	1,388.00	30,952,400	
神戸物産	121,200	4,025.00	487,830,000	貸付有価証券 17,900株
ハイパー	3,300	442.00	1,458,600	貸付有価証券 100株（100株）
あい ホールディングス	25,100	1,828.00	45,882,800	

ディービーエックス	6,000	968.00	5,808,000	貸付有価証券 100株
ダイワボウホールディングス	74,700	1,929.00	144,096,300	
マクニカホールディングス	41,900	2,840.00	118,996,000	
ラクト・ジャパン	6,000	2,374.00	14,244,000	貸付有価証券 100株（100株）
グリムス	7,800	1,805.00	14,079,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	28,000	677.00	18,956,000	
八洲電機	12,700	1,042.00	13,233,400	貸付有価証券 5,900株
メディアスホールディングス	10,000	831.00	8,310,000	貸付有価証券 200株
レスターホールディングス	16,700	2,109.00	35,220,300	貸付有価証券 4,000株
ジューテックホールディングス	3,400	1,107.00	3,763,800	貸付有価証券 1,600株
大光	7,400	707.00	5,231,800	貸付有価証券 3,000株（400株）
OCH I ホールディングス	4,000	1,230.00	4,920,000	
TOKA I ホールディングス	85,100	892.00	75,909,200	貸付有価証券 2,500株
黒谷	4,800	624.00	2,995,200	貸付有価証券 2,200株（800株）
C o m i n i x	3,000	726.00	2,178,000	
三洋貿易	16,100	1,020.00	16,422,000	
ビューティガレージ	2,800	3,145.00	8,806,000	貸付有価証券 300株
ウイン・パートナーズ	12,700	1,007.00	12,788,900	
ミタチ産業	4,400	774.00	3,405,600	
シップヘルスケアホールディングス	50,700	2,600.00	131,820,000	貸付有価証券 4,200株
明治電機工業	5,300	1,082.00	5,734,600	
デリカフーズホールディングス	6,800	512.00	3,481,600	貸付有価証券 2,700株
スターティアホールディングス	4,000	990.00	3,960,000	
コメダホールディングス	38,300	2,324.00	89,009,200	

ピーバンドットコム	2,500	525.00	1,312,500	
アセンテック	6,000	677.00	4,062,000	貸付有価証券 1,600株
富士興産	4,400	1,141.00	5,020,400	
協栄産業	1,800	1,429.00	2,572,200	
フルサト・マルカホールディングス	15,600	3,310.00	51,636,000	貸付有価証券 2,200株
ヤマエグループホールディングス	9,800	1,627.00	15,944,600	
小野建	15,700	1,456.00	22,859,200	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
南陽	3,300	1,904.00	6,283,200	貸付有価証券 100株
佐島電機	10,900	1,162.00	12,665,800	
エコートレーディング	3,700	569.00	2,105,300	
伯東	10,300	3,155.00	32,496,500	
コンドーテック	13,100	1,043.00	13,663,300	
中山福	9,200	307.00	2,824,400	貸付有価証券 1,000株（100株）
ナガイレーベン	21,200	2,106.00	44,647,200	
三菱食品	16,900	3,470.00	58,643,000	
松田産業	12,800	2,174.00	27,827,200	
第一興商	33,300	4,135.00	137,695,500	
メディopalホールディングス	162,500	1,985.00	322,562,500	貸付有価証券 300株
S P K	6,900	1,416.00	9,770,400	
萩原電気ホールディングス	6,000	2,316.00	13,896,000	
アズワン	25,200	6,580.00	165,816,000	
スズデン	5,500	2,116.00	11,638,000	
尾家産業	4,100	900.00	3,690,000	貸付有価証券 400株（400株）
シモジマ	10,700	1,086.00	11,620,200	
ドウシシャ	16,600	1,554.00	25,796,400	貸付有価証券 6,800株
小津産業	3,900	1,828.00	7,129,200	貸付有価証券 300株
高速	9,300	1,542.00	14,340,600	
たけびし	6,000	1,529.00	9,174,000	

リックス	3,600	1,907.00	6,865,200	貸付有価証券 100株
丸文	14,000	777.00	10,878,000	
ハピネット	13,300	1,660.00	22,078,000	
橋本総業ホールディングス	3,100	2,111.00	6,544,100	
日本ライフライン	52,000	1,056.00	54,912,000	
タカショー	13,600	773.00	10,512,800	貸付有価証券 5,200株（1,100株）
I DOM	53,300	847.00	45,145,100	
進和	10,400	2,336.00	24,294,400	貸付有価証券 300株（300株）
エスケイジャパン	4,200	595.00	2,499,000	
ダイトロン	6,200	2,104.00	13,044,800	
シークス	22,300	1,068.00	23,816,400	
田中商事	5,400	577.00	3,115,800	
オーハシテクニカ	8,600	1,399.00	12,031,400	
白銅	5,700	2,682.00	15,287,400	
ダイコー通産	2,100	1,102.00	2,314,200	
伊藤忠商事	1,053,200	3,883.00	4,089,575,600	
丸紅	1,521,900	1,376.50	2,094,895,350	
高島	2,500	2,547.00	6,367,500	
長瀬産業	80,300	2,006.00	161,081,800	
蝶理	9,800	2,049.00	20,080,200	
豊田通商	156,900	4,835.00	758,611,500	
三共生興	22,500	501.00	11,272,500	
兼松	60,800	1,482.00	90,105,600	
ツカモトコーポレーション	2,900	1,054.00	3,056,600	
三井物産	1,273,400	3,121.00	3,974,281,400	
日本紙パルプ商事	8,300	4,445.00	36,893,500	
カメイ	18,700	1,117.00	20,887,900	
東都水産	900	4,980.00	4,482,000	貸付有価証券 400株
OUGホールディングス	2,500	2,978.00	7,445,000	
スターゼン	11,900	2,167.00	25,787,300	
山善	63,300	957.00	60,578,100	貸付有価証券 1,500株

椿本興業	2,900	3,725.00	10,802,500	
住友商事	1,039,500	1,923.50	1,999,478,250	
内田洋行	6,900	4,990.00	34,431,000	
三菱商事	1,151,900	4,350.00	5,010,765,000	
第一実業	6,800	3,650.00	24,820,000	
キャノンマーケティング ジャパン	36,300	3,230.00	117,249,000	貸付有価証券 100株
西華産業	7,500	1,655.00	12,412,500	
佐藤商事	12,100	1,146.00	13,866,600	
菱洋エレクトロ	10,400	2,327.00	24,200,800	貸付有価証券 4,000株
東京産業	14,300	780.00	11,154,000	
ユアサ商事	14,100	3,560.00	50,196,000	
神鋼商事	3,900	4,205.00	16,399,500	
トルク	9,300	198.00	1,841,400	
阪和興業	30,500	3,280.00	100,040,000	
正栄食品工業	10,400	4,165.00	43,316,000	貸付有価証券 4,400株
カナデン	14,300	1,079.00	15,429,700	
菱電商事	13,900	1,649.00	22,921,100	
岩谷産業	38,900	5,560.00	216,284,000	
ナイス	5,400	1,680.00	9,072,000	
ニチモウ	2,100	2,566.00	5,388,600	
極東貿易	5,000	2,652.00	13,260,000	貸付有価証券 100株（100株）
アステナホールディング ス	27,100	456.00	12,357,600	
三愛オブリ	39,300	1,148.00	45,116,400	
稲畑産業	35,200	2,390.00	84,128,000	貸付有価証券 100株
G S I クレオス	8,400	1,466.00	12,314,400	貸付有価証券 3,300株
明和産業	16,200	819.00	13,267,800	貸付有価証券 7,100株（300株）
クワザワホールディング ス	6,200	435.00	2,697,000	貸付有価証券 600株
ワキタ	31,700	1,161.00	36,803,700	
東邦ホールディングス	47,700	1,870.00	89,199,000	
サンゲツ	42,600	1,625.00	69,225,000	

ミツウロコグループホールディングス	20,100	1,030.00	20,703,000	
シナネンホールディングス	5,800	3,785.00	21,953,000	
伊藤忠エネクス	38,800	1,072.00	41,593,600	
サンリオ	49,300	3,465.00	170,824,500	
サンワテクノス	8,900	1,436.00	12,780,400	
リョーサン	18,000	2,275.00	40,950,000	
新光商事	23,200	958.00	22,225,600	
トーホー	6,700	1,299.00	8,703,300	貸付有価証券 100株（100株）
三信電気	7,200	1,713.00	12,333,600	
東陽テクニカ	17,300	1,340.00	23,182,000	
モスフードサービス	23,000	3,235.00	74,405,000	
加賀電子	14,300	4,000.00	57,200,000	
ソーダニッカ	14,000	605.00	8,470,000	
立花エレテック	11,400	1,639.00	18,684,600	
フォーバル	6,100	1,010.00	6,161,000	
PAL TAC	24,600	4,295.00	105,657,000	
三谷産業	27,400	315.00	8,631,000	
太平洋興発	6,500	668.00	4,342,000	
西本Wismettac ホールディングス	4,000	3,830.00	15,320,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,600	1,661.00	2,657,600	
コア商事ホールディングス	11,000	758.00	8,338,000	貸付有価証券 400株（400株）
国際紙パルプ商事	32,400	742.00	24,040,800	
ヤマタネ	7,500	1,636.00	12,270,000	
丸紅建材リース	1,500	1,931.00	2,896,500	
日鉄物産	10,700	5,280.00	56,496,000	
泉州電業	3,900	5,630.00	21,957,000	貸付有価証券 1,200株
トラスコ中山	32,900	1,973.00	64,911,700	
オートバックスセブン	54,500	1,443.00	78,643,500	
モリト	11,500	716.00	8,234,000	貸付有価証券 100株
加藤産業	19,000	3,505.00	66,595,000	
北恵	3,900	774.00	3,018,600	貸付有価証券

				1,800株
イノテック	10,600	1,324.00	14,034,400	
イエローハット	27,600	1,853.00	51,142,800	
J Kホールディングス	12,300	1,044.00	12,841,200	
日伝	11,900	1,922.00	22,871,800	
北沢産業	9,200	199.00	1,830,800	貸付有価証券 200株
杉本商事	8,200	2,088.00	17,121,600	
因幡電機産業	43,700	2,822.00	123,321,400	
東テク	5,200	3,410.00	17,732,000	
ミスミグループ本社	220,600	3,770.00	831,662,000	
アルテック	9,600	298.00	2,860,800	
タキヒヨー	4,700	801.00	3,764,700	貸付有価証券 2,200株
蔵王産業	3,400	1,817.00	6,177,800	
スズケン	63,000	3,425.00	215,775,000	
ジェコス	12,100	838.00	10,139,800	
グローセル	19,000	409.00	7,771,000	貸付有価証券 1,200株
ローソン	38,900	4,795.00	186,525,500	
サンエー	12,000	4,245.00	50,940,000	
カワチ薬品	13,600	2,157.00	29,335,200	
エービーシー・マート	27,400	5,880.00	161,112,000	
ハードオフコーポレー ション	7,700	1,121.00	8,631,700	
アスクル	37,800	1,822.00	68,871,600	
ゲオホールディングス	21,100	1,596.00	33,675,600	
アダストリア	18,900	1,989.00	37,592,100	貸付有価証券 100株
ジーフット	10,600	334.00	3,540,400	貸付有価証券 4,900株
シー・ヴィ・エス・バイ エリア	2,500	410.00	1,025,000	貸付有価証券 100株
くら寿司	18,300	3,300.00	60,390,000	貸付有価証券 7,100株（1,400株）
キャンドウ	5,600	2,190.00	12,264,000	貸付有価証券 2,700株（1,400株）
アイケイ	5,500	446.00	2,453,000	貸付有価証券 400株（300株）

パルグループホールディングス	15,400	2,397.00	36,913,800	
エディオン	80,600	1,220.00	98,332,000	貸付有価証券 33,600株（15,000株）
サーラコーポレーション	32,900	721.00	23,720,900	貸付有価証券 2,700株（2,700株）
ワッツ	8,500	740.00	6,290,000	貸付有価証券 3,900株
ハローズ	8,000	3,155.00	25,240,000	
フジオフードグループ本社	13,000	1,334.00	17,342,000	貸付有価証券 100株
あみやき亭	4,200	2,935.00	12,327,000	
ひらまつ	37,300	188.00	7,012,400	貸付有価証券 1,900株
大黒天物産	5,600	5,440.00	30,464,000	貸付有価証券 1,500株（900株）
ハニーズホールディングス	13,900	1,281.00	17,805,900	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ファーマライズホールディングス	3,800	687.00	2,610,600	貸付有価証券 1,600株
アルペン	12,900	2,146.00	27,683,400	貸付有価証券 5,600株（100株）
ハブ	5,700	560.00	3,192,000	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
クオールホールディングス	21,500	1,253.00	26,939,500	
ジンズホールディングス	9,300	4,320.00	40,176,000	貸付有価証券 4,300株
ビックカメラ	104,200	1,174.00	122,330,800	貸付有価証券 48,400株（1,800株）
DCMホールディングス	104,300	1,057.00	110,245,100	
Monotaro	222,100	2,685.00	596,338,500	貸付有価証券 600株
東京一番フーズ	4,000	589.00	2,356,000	貸付有価証券 1,800株
DDホールディングス	9,200	588.00	5,409,600	貸付有価証券 100株（100株）
きちりホールディングス	4,700	360.00	1,692,000	貸付有価証券 2,200株
アークランドサービスホールディングス	12,800	2,094.00	26,803,200	貸付有価証券 3,700株
J. フロント リテイリ	194,800	1,086.00	211,552,800	

銘柄				
ドトール・日レスホールディングス	27,800	1,653.00	45,953,400	
マツキヨココカラ&カンパニー	102,900	5,440.00	559,776,000	
ブロンコビリー	8,400	2,421.00	20,336,400	
Z O Z O	120,800	3,215.00	388,372,000	
トレジャー・ファクトリー	5,100	1,696.00	8,649,600	
物語コーポレーション	8,700	6,720.00	58,464,000	貸付有価証券 3,600株
三越伊勢丹ホールディングス	263,700	1,029.00	271,347,300	
Hame e	6,300	1,205.00	7,591,500	貸付有価証券 2,200株（100株）
マーケットエンタープライズ	1,800	910.00	1,638,000	貸付有価証券 500株（400株）
ウエルシアホールディングス	92,900	3,115.00	289,383,500	
クリエイトSDホールディングス	25,900	3,280.00	84,952,000	貸付有価証券 500株
丸善CH I ホールディングス	20,500	374.00	7,667,000	貸付有価証券 8,400株
ミサワ	3,500	606.00	2,121,000	貸付有価証券 1,400株
ティーライフ	2,400	1,325.00	3,180,000	
エー・ピーホールディングス	3,400	442.00	1,502,800	
チムニー	5,400	1,209.00	6,528,600	貸付有価証券 2,500株
シュッピン	14,400	1,282.00	18,460,800	貸付有価証券 2,600株（2,100株）
オイシックス・ラ・大地	25,300	2,174.00	55,002,200	貸付有価証券 5,800株（3,500株）
ネクステージ	35,700	3,140.00	112,098,000	貸付有価証券 1,400株
ジョイフル本田	50,400	1,780.00	89,712,000	貸付有価証券 19,200株
鳥貴族ホールディングス	5,800	2,289.00	13,276,200	
ホットランド	11,900	1,310.00	15,589,000	貸付有価証券 900株（900株）
すかいらくホールディ	214,200	1,527.00	327,083,400	貸付有価証券

ングス				68,400株
S F Pホールディングス	8,600	1,832.00	15,755,200	貸付有価証券 4,000株（600株）
綿半ホールディングス	12,100	1,449.00	17,532,900	
ヨシックスホールディングス	3,400	2,271.00	7,721,400	貸付有価証券 1,500株
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	51,000	1,110.00	56,610,000	貸付有価証券 23,900株
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	7,100	1,856.00	13,177,600	
B E E N O S	8,900	2,667.00	23,736,300	貸付有価証券 2,600株（300株）
あさひ	14,500	1,320.00	19,140,000	貸付有価証券 6,000株
日本調剤	10,600	1,409.00	14,935,400	
コスモス薬品	17,700	15,400.00	272,580,000	
トーエル	7,700	917.00	7,060,900	貸付有価証券 3,600株（200株）
セブン&アイ・ホール ディングス	589,100	5,661.00	3,334,895,100	
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	117,900	963.00	113,537,700	貸付有価証券 35,500株（5,900株）
ツルハホールディングス	38,300	8,010.00	306,783,000	
サンマルクホールディ ングス	13,900	1,633.00	22,698,700	
フェリシモ	3,900	1,100.00	4,290,000	貸付有価証券 1,300株（400株）
トリドールホールディ ングス	43,700	2,956.00	129,177,200	貸付有価証券 20,500株
T O K Y O B A S E	16,100	341.00	5,490,100	貸付有価証券 1,900株（900株）
ウイルプラスホールディ ングス	3,300	1,010.00	3,333,000	
J Mホールディングス	13,300	1,613.00	21,452,900	
サツドラホールディ ングス	7,900	656.00	5,182,400	
アレンザホールディ ングス	11,700	1,048.00	12,261,600	
串カツ田中ホールディ ングス	4,200	1,945.00	8,169,000	貸付有価証券 100株
パロックジャパンリミ テッド	12,200	815.00	9,943,000	貸付有価証券 5,700株

クスリのアオキホールディングス	15,700	6,390.00	100,323,000	
力の源ホールディングス	9,300	673.00	6,258,900	貸付有価証券 4,300株（200株）
FOOD & LIFE COMPANIE	90,000	2,460.00	221,400,000	
メディカルシステムネット ワーク	15,300	429.00	6,563,700	
一家ホールディングス	3,700	590.00	2,183,000	
藤久ホールディングス	5,400	652.00	3,520,800	
はるやまホールディング ス	8,200	439.00	3,599,800	貸付有価証券 600株（600株）
ノジマ	28,400	2,825.00	80,230,000	
カップ・クリエイト	24,600	1,436.00	35,325,600	貸付有価証券 7,600株（200株）
ライトオン	13,100	740.00	9,694,000	貸付有価証券 5,000株（2,800株）
良品計画	202,100	1,319.00	266,569,900	
パリミキホールディング ス	21,700	267.00	5,793,900	貸付有価証券 100株
アドヴァングループ	14,900	825.00	12,292,500	
アルビス	5,100	2,307.00	11,765,700	
コナカ	19,000	348.00	6,612,000	貸付有価証券 100株
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,648.00	3,460,800	
G-7ホールディングス	19,500	1,510.00	29,445,000	
イオン北海道	23,200	1,122.00	26,030,400	貸付有価証券 300株
コジマ	30,200	686.00	20,717,200	貸付有価証券 14,400株
ヒマラヤ	5,500	994.00	5,467,000	貸付有価証券 2,500株
コーナン商事	25,000	3,705.00	92,625,000	
エコス	5,800	1,935.00	11,223,000	貸付有価証券 2,700株（100株）
ワタミ	21,300	938.00	19,979,400	貸付有価証券 100株
マルシェ	5,700	455.00	2,593,500	貸付有価証券 2,600株（100株）
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	351,300	2,537.00	891,248,100	

西松屋チェーン	34,700	1,731.00	60,065,700	貸付有価証券 16,300株
ゼンショーホールディングス	85,800	3,565.00	305,877,000	貸付有価証券 3,300株
幸楽苑ホールディングス	10,200	1,214.00	12,382,800	貸付有価証券 100株
ハークスレイ	7,300	502.00	3,664,600	貸付有価証券 100株
サイゼリヤ	26,100	2,647.00	69,086,700	
VTホールディングス	66,100	492.00	32,521,200	貸付有価証券 400株
魚力	4,900	2,492.00	12,210,800	貸付有価証券 2,100株
ポプラ	3,900	156.00	608,400	
フジ・コーポレーション	9,300	1,248.00	11,606,400	
ユナイテッドアローズ	18,400	1,861.00	34,242,400	
ハイディ日高	25,400	2,140.00	54,356,000	貸付有価証券 11,900株
YU-WA Creat ion Holdi	10,300	204.00	2,101,200	貸付有価証券 200株（100株）
コロワイド	72,200	1,827.00	131,909,400	貸付有価証券 33,900株（9,100株）
ピーシーデポコーポレー ション	20,400	299.00	6,099,600	貸付有価証券 600株
壱番屋	12,400	4,750.00	58,900,000	貸付有価証券 5,800株
トップカルチャー	5,600	213.00	1,192,800	
P L A N T	4,000	675.00	2,700,000	
スギホールディングス	35,100	6,260.00	219,726,000	
薬王堂ホールディングス	8,700	2,357.00	20,505,900	貸付有価証券 600株（600株）
スクロール	27,000	799.00	21,573,000	
ヨンドシーホールディン グス	14,800	1,859.00	27,513,200	
木曽路	23,700	2,208.00	52,329,600	貸付有価証券 8,600株
S R Sホールディングス	25,500	882.00	22,491,000	貸付有価証券 6,000株（900株）
千趣会	28,800	395.00	11,376,000	貸付有価証券 500株
タカキュー	12,200	79.00	963,800	貸付有価証券

				5,300株
リテールパートナーズ	23,200	1,222.00	28,350,400	貸付有価証券 7,500株
ケーヨー	32,500	1,007.00	32,727,500	貸付有価証券 2,900株（2,500株）
上新電機	17,100	1,984.00	33,926,400	
日本瓦斯	83,900	2,227.00	186,845,300	
ロイヤルホールディングス	29,900	2,225.00	66,527,500	貸付有価証券 11,700株
東天紅	1,300	884.00	1,149,200	
いなげや	17,400	1,279.00	22,254,600	
チヨダ	15,000	819.00	12,285,000	貸付有価証券 6,700株（100株）
ライフコーポレーション	13,700	2,731.00	37,414,700	
リンガーハット	20,200	2,300.00	46,460,000	貸付有価証券 9,600株
MrMaxHD	21,900	645.00	14,125,500	
テナライド	17,400	305.00	5,307,000	貸付有価証券 8,100株（1,600株）
AOKIホールディングス	34,000	680.00	23,120,000	
オークワ	25,100	920.00	23,092,000	
コメリ	27,100	2,655.00	71,950,500	
青山商事	33,500	892.00	29,882,000	貸付有価証券 3,500株
しまむら	20,400	12,860.00	262,344,000	
はせがわ	9,300	319.00	2,966,700	
高島屋	118,100	1,453.00	171,599,300	
松屋	29,500	894.00	26,373,000	
エイチ・ツー・オー リ テイリング	76,300	947.00	72,256,100	貸付有価証券 200株
近鉄百貨店	5,000	2,342.00	11,710,000	貸付有価証券 2,300株
丸井グループ	127,100	2,447.00	311,013,700	
アクシアル リテイリン グ	11,700	3,550.00	41,535,000	
井筒屋	8,300	324.00	2,689,200	貸付有価証券 3,900株（2,700株）
イオン	579,400	2,826.00	1,637,384,400	
イズミ	27,800	3,075.00	85,485,000	

平和堂	26,200	2,014.00	52,766,800	貸付有価証券 12,700株
フジ	38,500	2,031.00	78,193,500	貸付有価証券 2,600株
ヤオコー	19,900	6,620.00	131,738,000	貸付有価証券 400株
ゼビオホールディングス	23,900	960.00	22,944,000	
ケースホールディングス	149,500	1,332.00	199,134,000	貸付有価証券 800株
O l y m p i c グループ	7,800	605.00	4,719,000	
日産東京販売ホールディングス	25,800	264.00	6,811,200	
シルバーライフ	3,600	1,287.00	4,633,200	貸付有価証券 1,000株
Genky Drug Stores	7,700	3,780.00	29,106,000	貸付有価証券 2,800株（900株）
ナルミヤ・インターナショナル	3,900	869.00	3,389,100	貸付有価証券 1,800株（1,500株）
ブックオフグループホールディングス	10,200	1,024.00	10,444,800	貸付有価証券 600株（500株）
ギフトホールディングス	3,300	2,785.00	9,190,500	貸付有価証券 400株
アインホールディングス	21,600	7,830.00	169,128,000	貸付有価証券 100株
元気寿司	4,900	2,561.00	12,548,900	貸付有価証券 300株
ヤマダホールディングス	621,500	481.00	298,941,500	貸付有価証券 3,600株
アークランドサカモト	27,500	1,600.00	44,000,000	
ニトリホールディングス	69,700	14,650.00	1,021,105,000	
グルメ杵屋	14,000	1,037.00	14,518,000	貸付有価証券 6,500株
愛眼	12,800	180.00	2,304,000	
ケーユーホールディングス	9,200	1,268.00	11,665,600	
吉野家ホールディングス	61,300	2,542.00	155,824,600	貸付有価証券 25,800株
松屋フーズホールディングス	8,400	3,930.00	33,012,000	
サガミホールディングス	25,200	1,206.00	30,391,200	貸付有価証券 10,800株

関西フードマーケット	14,100	1,289.00	18,174,900	貸付有価証券 1,700株（1,600株）
王将フードサービス	11,600	6,780.00	78,648,000	
プレナス	19,700	1,995.00	39,301,500	貸付有価証券 600株（600株）
ミニストップ	13,000	1,463.00	19,019,000	貸付有価証券 4,000株（200株）
アークス	31,100	2,098.00	65,247,800	
バローホールディングス	35,900	1,886.00	67,707,400	
ベルク	7,800	5,660.00	44,148,000	
大庄	9,400	1,184.00	11,129,600	貸付有価証券 2,100株
ファーストリテイリング	23,500	88,130.00	2,071,055,000	貸付有価証券 400株
サンドラッグ	66,100	3,545.00	234,324,500	
サックスパー ホール ディングス	16,500	606.00	9,999,000	貸付有価証券 1,400株（700株）
ヤマザワ	3,600	1,412.00	5,083,200	貸付有価証券 200株
やまや	3,600	2,606.00	9,381,600	貸付有価証券 1,300株
ベルーナ	37,700	743.00	28,011,100	
島根銀行	5,600	479.00	2,682,400	
じもとホールディングス	11,600	564.00	6,542,400	
めぶきフィナンシャルグ ループ	723,700	267.00	193,227,900	
東京きらぼしフィナン シャルグループ	20,400	2,135.00	43,554,000	
九州フィナンシャルグ ループ	307,900	400.00	123,160,000	貸付有価証券 10,000株
ゆうちょ銀行	415,300	1,020.00	423,606,000	貸付有価証券 22,800株
富山第一銀行	39,100	433.00	16,930,300	
コンコルディア・フィナ ンシャルグループ	870,800	446.00	388,376,800	貸付有価証券 8,000株
西日本フィナンシャル ホールディングス	92,300	745.00	68,763,500	
三十三フィナンシャルグ ループ	14,100	1,464.00	20,642,400	
第四北越フィナンシャル グループ	24,800	2,589.00	64,207,200	

ひろぎんホールディングス	224,900	620.00	139,438,000	貸付有価証券 400株
おきなわフィナンシャルグループ	14,900	2,281.00	33,986,900	貸付有価証券 4,000株
十六フィナンシャルグループ	20,500	2,470.00	50,635,000	
北國フィナンシャルホールディングス	14,500	4,790.00	69,455,000	貸付有価証券 400株
プロクレアホールディングス	17,900	2,159.00	38,646,100	
新生銀行	114,800	1,978.00	227,074,400	
あおぞら銀行	98,300	2,724.00	267,769,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,297,700	734.30	7,561,601,110	
りそなホールディングス	1,861,500	518.40	965,001,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	291,000	4,344.00	1,264,104,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,141,600	4,187.00	4,779,879,200	
千葉銀行	496,800	755.00	375,084,000	貸付有価証券 1,000株
群馬銀行	283,000	377.00	106,691,000	
武蔵野銀行	22,500	1,738.00	39,105,000	貸付有価証券 100株
千葉興業銀行	37,900	261.00	9,891,900	貸付有価証券 100株
筑波銀行	68,600	194.00	13,308,400	
七十七銀行	46,700	1,755.00	81,958,500	貸付有価証券 200株
秋田銀行	10,500	1,692.00	17,766,000	
山形銀行	16,200	949.00	15,373,800	
岩手銀行	10,800	1,940.00	20,952,000	
東邦銀行	125,800	212.00	26,669,600	貸付有価証券 500株
東北銀行	7,900	972.00	7,678,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	127,000	2,450.00	311,150,000	
静岡銀行	362,500	832.00	301,600,000	
スルガ銀行	154,300	381.00	58,788,300	貸付有価証券 200株
八十二銀行	326,400	490.00	159,936,000	貸付有価証券

				1,600株
山梨中央銀行	17,700	1,164.00	20,602,800	
大垣共立銀行	30,100	1,775.00	53,427,500	
福井銀行	14,000	1,403.00	19,642,000	
清水銀行	6,300	1,490.00	9,387,000	
富山銀行	2,700	1,802.00	4,865,400	
滋賀銀行	28,700	2,666.00	76,514,200	
南都銀行	23,800	1,990.00	47,362,000	
百五銀行	147,800	326.00	48,182,800	貸付有価証券 100株
京都銀行	54,600	5,640.00	307,944,000	
紀陽銀行	52,200	1,576.00	82,267,200	
ほくほくフィナンシャル グループ	99,800	844.00	84,231,200	
山陰合同銀行	97,800	685.00	66,993,000	
中国銀行	123,800	966.00	119,590,800	
鳥取銀行	5,600	1,125.00	6,300,000	
伊予銀行	197,200	690.00	136,068,000	
百十四銀行	16,200	1,704.00	27,604,800	
四国銀行	23,200	853.00	19,789,600	
阿波銀行	23,300	2,001.00	46,623,300	
大分銀行	9,400	1,969.00	18,508,600	
宮崎銀行	9,500	2,181.00	20,719,500	
佐賀銀行	9,300	1,500.00	13,950,000	
琉球銀行	38,200	791.00	30,216,200	
セブン銀行	522,500	260.00	135,850,000	貸付有価証券 14,600株
みずほフィナンシャルグ ループ	2,109,300	1,594.00	3,362,224,200	
高知銀行	5,500	676.00	3,718,000	
山口フィナンシャルグ ループ	175,700	770.00	135,289,000	貸付有価証券 100株
長野銀行	5,400	1,316.00	7,106,400	
名古屋銀行	10,800	3,020.00	32,616,000	
北洋銀行	221,000	236.00	52,156,000	貸付有価証券 100株
愛知銀行	5,500	5,510.00	30,305,000	
中京銀行	5,400	1,775.00	9,585,000	貸付有価証券

				200株
大光銀行	5,200	1,408.00	7,321,600	
愛媛銀行	22,900	873.00	19,991,700	貸付有価証券 100株
トマト銀行	5,300	1,023.00	5,421,900	
京葉銀行	73,400	479.00	35,158,600	
栃木銀行	78,900	296.00	23,354,400	貸付有価証券 900株
北日本銀行	5,100	1,710.00	8,721,000	
東和銀行	28,800	532.00	15,321,600	
福島銀行	18,600	227.00	4,222,200	
大東銀行	7,700	642.00	4,943,400	
トモニホールディングス	126,900	323.00	40,988,700	
フィデアホールディングス	16,100	1,335.00	21,493,500	
池田泉州ホールディングス	186,700	213.00	39,767,100	貸付有価証券 1,300株
F P G	59,200	1,204.00	71,276,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	11,900	1,400.00	16,660,000	貸付有価証券 2,500株
マーキュリアホールディングス	9,500	647.00	6,146,500	
S B I ホールディングス	217,300	2,784.00	604,963,200	貸付有価証券 4,700株
日本アジア投資	13,900	256.00	3,558,400	
ジャフコ グループ	60,900	2,336.00	142,262,400	
大和証券グループ本社	1,129,800	615.90	695,843,820	貸付有価証券 2,100株
野村ホールディングス	2,686,100	516.20	1,386,564,820	貸付有価証券 300株
岡三証券グループ	126,800	348.00	44,126,400	貸付有価証券 200株
丸三証券	52,300	488.00	25,522,400	貸付有価証券 2,000株
東洋証券	53,200	250.00	13,300,000	貸付有価証券 1,000株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	173,200	380.00	65,816,000	貸付有価証券 1,100株
光世証券	3,700	451.00	1,668,700	
水戸証券	43,100	271.00	11,680,100	

いちよし証券	29,100	640.00	18,624,000	
松井証券	86,100	806.00	69,396,600	
マネックスグループ	148,100	505.00	74,790,500	
極東証券	20,000	705.00	14,100,000	
岩井コスモホールディングス	16,600	1,274.00	21,148,400	
アイザワ証券グループ	23,700	670.00	15,879,000	
マネーパートナーズグループ	18,700	248.00	4,637,600	
スパークス・グループ	81,200	317.00	25,740,400	貸付有価証券 700株
小林洋行	6,300	218.00	1,373,400	
かんぽ生命保険	177,100	2,151.00	380,942,100	貸付有価証券 100株
SOMPOホールディングス	250,300	5,874.00	1,470,262,200	貸付有価証券 400株
アニコム ホールディングス	54,000	690.00	37,260,000	
MS&ADインシュアランスグループホール	361,600	4,128.00	1,492,684,800	
第一生命ホールディングス	856,700	2,369.00	2,029,522,300	
東京海上ホールディングス	489,600	7,728.00	3,783,628,800	
T&Dホールディングス	391,400	1,478.00	578,489,200	貸付有価証券 1,300株
アドバンスクリエイト	8,400	1,047.00	8,794,800	貸付有価証券 3,200株
全国保証	42,000	4,430.00	186,060,000	
あんしん保証	7,000	266.00	1,862,000	
ジェイリース	5,900	2,555.00	15,074,500	
イントラスト	7,400	640.00	4,736,000	
日本モーゲージサービス	9,800	952.00	9,329,600	貸付有価証券 300株
C a s a	6,200	857.00	5,313,400	貸付有価証券 2,100株
アルヒ	26,000	1,071.00	27,846,000	貸付有価証券 12,200株（9,300株）
プレミアグループ	8,900	5,030.00	44,767,000	貸付有価証券 400株（400株）
ネットプロテクションズ	53,400	642.00	34,282,800	貸付有価証券

ホールディングス				16,500株（13,600株）
クレディセゾン	102,700	1,783.00	183,114,100	貸付有価証券 2,000株
芙蓉総合リース	15,100	8,180.00	123,518,000	
みずほリース	21,700	3,435.00	74,539,500	
東京センチュリー	27,300	5,210.00	142,233,000	
日本証券金融	69,100	852.00	58,873,200	
アイフル	295,200	387.00	114,242,400	貸付有価証券 600株
リコーリース	15,600	3,735.00	58,266,000	
イオンフィナンシャル サービス	95,700	1,427.00	136,563,900	
アコム	347,000	345.00	119,715,000	
ジャックス	17,500	3,805.00	66,587,500	
オリエントコーポレー ション	475,900	127.00	60,439,300	
オリックス	1,045,200	2,288.50	2,391,940,200	
三菱HCキャピタル	568,700	665.00	378,185,500	
九州リースサービス	7,500	589.00	4,417,500	貸付有価証券 1,800株
日本取引所グループ	409,800	2,223.50	911,190,300	貸付有価証券 100株
イー・ギャランティ	26,100	2,359.00	61,569,900	
アサックス	9,100	601.00	5,469,100	貸付有価証券 4,500株
NEC キャピタルソ リューション	7,200	2,138.00	15,393,600	
いちご	195,900	304.00	59,553,600	貸付有価証券 44,400株
日本駐車場開発	173,600	164.00	28,470,400	
スター・マイカ・ホール ディングス	7,500	1,574.00	11,805,000	
SREホールディングス	4,500	3,170.00	14,265,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
ADワークスグループ	39,200	155.00	6,076,000	貸付有価証券 17,000株（700株）
ヒューリック	340,200	1,080.00	367,416,000	貸付有価証券 57,300株
三栄建築設計	7,100	1,692.00	12,013,200	貸付有価証券 400株（400株）

野村不動産ホールディングス	91,100	3,430.00	312,473,000	
三重交通グループホールディングス	35,700	485.00	17,314,500	貸付有価証券 16,200株
サムティ	23,200	2,144.00	49,740,800	貸付有価証券 9,600株
ディア・ライフ	21,700	641.00	13,909,700	貸付有価証券 100株
コーセーアールイー	5,200	635.00	3,302,000	貸付有価証券 2,000株
地主	11,100	2,025.00	22,477,500	貸付有価証券 3,700株
プレサンスコーポレーション	19,200	1,574.00	30,220,800	
ハウスコム	3,000	943.00	2,829,000	
JPMC	7,400	1,010.00	7,474,000	
サンセイランディック	4,700	831.00	3,905,700	貸付有価証券 700株（700株）
エストラスト	2,000	561.00	1,122,000	
フージャースホールディングス	22,500	796.00	17,910,000	
オープンハウスグループ	55,900	5,710.00	319,189,000	
東急不動産ホールディングス	478,400	755.00	361,192,000	
飯田グループホールディングス	143,700	2,262.00	325,049,400	
イーグランド	2,500	1,532.00	3,830,000	
ムゲンエステート	10,800	485.00	5,238,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
ビーロット	11,100	545.00	6,049,500	
ファーストブラザーズ	3,200	839.00	2,684,800	貸付有価証券 1,600株
And Doホールディングス	8,700	860.00	7,482,000	
シーアールイー	6,600	1,695.00	11,187,000	貸付有価証券 2,200株（700株）
プロパティエージェント	2,000	1,493.00	2,986,000	貸付有価証券 1,100株
ケイアイスター不動産	7,900	5,000.00	39,500,000	
アグレ都市デザイン	2,900	1,510.00	4,379,000	
グッドコムアセット	6,800	1,325.00	9,010,000	

ジェイ・エス・ビー	3,600	3,405.00	12,258,000	
ロードスターキャピタル	6,200	1,920.00	11,904,000	
テンポイノベーション	4,900	924.00	4,527,600	貸付有価証券 100株
グローバル・リンク・マ ネジメント	3,100	909.00	2,817,900	
フェイスネットワーク	2,200	1,388.00	3,053,600	
パーク２４	113,700	2,010.00	228,537,000	
パラカ	5,100	1,984.00	10,118,400	貸付有価証券 1,700株
三井不動産	686,500	2,911.50	1,998,744,750	貸付有価証券 2,300株
三菱地所	1,001,800	1,939.50	1,942,991,100	貸付有価証券 7,000株
平和不動産	28,000	3,900.00	109,200,000	
東京建物	139,000	2,161.00	300,379,000	
京阪神ビルディング	23,000	1,319.00	30,337,000	
住友不動産	316,400	3,609.00	1,141,887,600	貸付有価証券 6,600株
テーオーシー	26,400	778.00	20,539,200	
東京楽天地	2,500	4,060.00	10,150,000	
レオパレス２１	182,400	353.00	64,387,200	貸付有価証券 1,100株
スターツコーポレーショ ン	23,900	2,750.00	65,725,000	
フジ住宅	20,400	660.00	13,464,000	
空港施設	17,600	551.00	9,697,600	
明和地所	8,300	615.00	5,104,500	
ゴールドクレスト	13,900	1,796.00	24,964,400	
エスリード	6,900	1,739.00	11,999,100	
日神グループホールディ ングス	28,600	432.00	12,355,200	
日本エスコン	32,800	818.00	26,830,400	
タカラレーベン	73,700	373.00	27,490,100	
A V A N T I A	8,200	831.00	6,814,200	貸付有価証券 3,100株
イオンモール	88,200	1,718.00	151,527,600	
毎日コムネット	6,000	612.00	3,672,000	
ファースト住建	6,600	1,146.00	7,563,600	貸付有価証券

				300株
カチタス	43,600	3,470.00	151,292,000	
トーセイ	24,300	1,350.00	32,805,000	
穴吹興産	3,800	2,109.00	8,014,200	貸付有価証券 200株
サンフロンティア不動産	24,300	1,207.00	29,330,100	
F J ネクストホールディ ングス	17,300	1,063.00	18,389,900	
インテリックス	4,000	550.00	2,200,000	
ランドビジネス	5,900	233.00	1,374,700	
サンネクスタグループ	5,300	997.00	5,284,100	
グランディハウス	11,900	554.00	6,592,600	貸付有価証券 300株
日本空港ビルデング	56,700	5,460.00	309,582,000	貸付有価証券 2,700株
明豊ファシリティワーク ス	7,800	685.00	5,343,000	
日本工営	10,800	3,660.00	39,528,000	
L I F U L L	52,000	178.00	9,256,000	
ミクシィ	39,000	2,405.00	93,795,000	
ジェイエイシーリクルー トメント	13,800	1,919.00	26,482,200	
日本M&Aセンターホー ルディングス	279,600	1,919.00	536,552,400	貸付有価証券 300株
メンバーズ	4,400	2,878.00	12,663,200	
中広	2,700	408.00	1,101,600	
UTグループ	24,600	2,776.00	68,289,600	
アイティメディア	8,100	1,772.00	14,353,200	
E・Jホールディングス	9,800	1,378.00	13,504,400	貸付有価証券 3,400株
夢真ビーネックスグルー プ	55,600	1,737.00	96,577,200	貸付有価証券 400株
コシダカホールディング ス	45,600	822.00	37,483,200	貸付有価証券 14,400株
アルトナー	4,100	896.00	3,673,600	
パソナグループ	18,500	2,205.00	40,792,500	
C D S	4,200	1,808.00	7,593,600	
リンクアンドモチベー ション	43,800	642.00	28,119,600	貸付有価証券 16,200株（300株）
エス・エム・エス	57,900	3,455.00	200,044,500	

サニーサイドアップグループ	5,900	664.00	3,917,600	貸付有価証券 300株（300株）
パーソルホールディングス	170,400	2,925.00	498,420,000	貸付有価証券 500株
リニカル	9,600	722.00	6,931,200	
クックパッド	41,600	224.00	9,318,400	貸付有価証券 400株
エスクリ	7,600	378.00	2,872,800	貸付有価証券 3,400株
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,300	605.00	5,021,500	
学情	6,900	1,152.00	7,948,800	貸付有価証券 2,600株
スタジオアリス	7,600	2,334.00	17,738,400	貸付有価証券 4,100株
シミックホールディングス	8,400	1,645.00	13,818,000	
エプコ	3,600	690.00	2,484,000	貸付有価証券 900株
N J S	3,300	2,031.00	6,702,300	
総合警備保障	62,200	3,680.00	228,896,000	
カカクコム	125,100	2,624.00	328,262,400	
セントケア・ホールディング	11,100	869.00	9,645,900	
サイネックス	2,900	598.00	1,734,200	
ルネサンス	11,800	978.00	11,540,400	貸付有価証券 3,000株（600株）
ディップ	30,000	3,675.00	110,250,000	
デジタルホールディングス	11,900	1,344.00	15,993,600	
新日本科学	20,800	2,423.00	50,398,400	貸付有価証券 300株
キャリアデザインセンター	3,500	1,541.00	5,393,500	
ベネフィット・ワン	61,700	2,295.00	141,601,500	貸付有価証券 4,300株
エムスリー	300,800	5,039.00	1,515,731,200	
ツカダ・グローバルホールディング	10,800	338.00	3,650,400	貸付有価証券 400株
プラス	2,200	968.00	2,129,600	貸付有価証券 400株

アウトソーシング	90,700	1,170.00	106,119,000	貸付有価証券 29,700株（29,700株）
ウェルネット	15,000	480.00	7,200,000	貸付有価証券 500株
ワールドホールディングス	6,800	2,701.00	18,366,800	
ディー・エヌ・エー	64,900	1,970.00	127,853,000	貸付有価証券 500株
博報堂D Yホールディングス	215,700	1,374.00	296,371,800	
ぐるなび	24,900	464.00	11,553,600	貸付有価証券 100株
タカミヤ	20,600	452.00	9,311,200	貸付有価証券 100株
ジャパンベストレスキューシステム	9,600	724.00	6,950,400	
ファンコミュニケーションズ	29,800	416.00	12,396,800	貸付有価証券 100株
ライク	5,700	2,141.00	12,203,700	
ビジネス・ブレークスルー	6,300	412.00	2,595,600	貸付有価証券 1,500株
エスプール	43,800	1,125.00	49,275,000	
WDBホールディングス	7,800	2,549.00	19,882,200	
ティア	9,900	443.00	4,385,700	
C D G	1,800	1,278.00	2,300,400	貸付有価証券 800株
アドウェイズ	20,900	738.00	15,424,200	貸付有価証券 3,300株（3,100株）
バリューコマース	11,500	2,639.00	30,348,500	
インフォマート	158,000	475.00	75,050,000	貸付有価証券 900株
J Pホールディングス	43,800	265.00	11,607,000	貸付有価証券 300株
C Lホールディングス	4,200	868.00	3,645,600	貸付有価証券 100株
プレステージ・インターナショナル	63,900	681.00	43,515,900	
アミューズ	9,300	2,005.00	18,646,500	
ドリームインキュベータ	5,200	1,945.00	10,114,000	貸付有価証券 1,300株
クイック	10,600	1,705.00	18,073,000	

T A C	9,200	214.00	1,968,800	
電通グループ	159,700	4,840.00	772,948,000	貸付有価証券 1,800株
テイクアンドギヴ・ニーズ	8,000	1,665.00	13,320,000	
ぴあ	5,100	3,410.00	17,391,000	
イオンファンタジー	6,600	3,410.00	22,506,000	貸付有価証券 3,100株（400株）
シーティーエス	19,200	770.00	14,784,000	
ネクシィーズグループ	5,200	581.00	3,021,200	貸付有価証券 200株（200株）
H. U. グループホールディングス	44,500	3,185.00	141,732,500	
アルプス技研	13,200	1,923.00	25,383,600	
ダイオーズ	3,300	1,236.00	4,078,800	貸付有価証券 1,400株
日本空調サービス	17,800	766.00	13,634,800	
オリエンタルランド	181,300	21,045.00	3,815,458,500	貸付有価証券 100株
ダスキン	36,700	2,919.00	107,127,300	
明光ネットワークジャパン	20,000	620.00	12,400,000	貸付有価証券 6,000株（300株）
ファルコホールディングス	7,500	1,845.00	13,837,500	
秀英予備校	3,700	438.00	1,620,600	貸付有価証券 1,400株
ラウンドワン	47,600	1,992.00	94,819,200	
リゾートトラスト	72,100	2,233.00	160,999,300	貸付有価証券 300株
ビー・エム・エル	21,700	3,815.00	82,785,500	
りらいあコミュニケーションズ	25,100	1,045.00	26,229,500	
リソー教育	77,900	315.00	24,538,500	
早稲田アカデミー	9,500	1,099.00	10,440,500	貸付有価証券 2,300株
ユー・エス・エス	190,800	2,480.00	473,184,000	
東京個別指導学院	15,000	581.00	8,715,000	貸付有価証券 700株（700株）
サイバーエージェント	364,100	1,482.00	539,596,200	貸付有価証券 100株
楽天グループ	703,300	723.00	508,485,900	貸付有価証券

				330,500株（43,300株）
クリーク・アンド・リバー社	8,900	2,417.00	21,511,300	貸付有価証券 900株（900株）
モーニングスター	29,800	494.00	14,721,200	
テー・オー・ダブリュー	32,500	315.00	10,237,500	
山田コンサルティンググループ	8,800	1,341.00	11,800,800	
セントラルスポーツ	6,300	2,546.00	16,039,800	貸付有価証券 2,900株
フルキャストホールディングス	14,500	2,459.00	35,655,500	
エン・ジャパン	30,300	2,441.00	73,962,300	
リソルホールディングス	1,800	4,710.00	8,478,000	貸付有価証券 600株
テクノプロ・ホールディングス	102,100	3,395.00	346,629,500	
アトラグループ	3,800	192.00	729,600	
インターワークス	4,900	368.00	1,803,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,900	2,489.00	19,663,100	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
KeePer 技研	11,000	4,290.00	47,190,000	貸付有価証券 2,200株
ファーストロジック	2,600	804.00	2,090,400	
三機サービス	3,000	996.00	2,988,000	
Gunosy	9,400	818.00	7,689,200	貸付有価証券 3,400株
デザインワン・ジャパン	5,000	181.00	905,000	
イー・ガーディアン	5,800	3,145.00	18,241,000	
リブセンス	7,800	327.00	2,550,600	貸付有価証券 1,400株（1,100株）
ジャパンマテリアル	52,400	2,001.00	104,852,400	
ベクトル	23,900	1,257.00	30,042,300	
ウチヤマホールディングス	8,400	301.00	2,528,400	貸付有価証券 100株
チャーム・ケア・コーポレーション	12,700	1,262.00	16,027,400	
キャリアリンク	6,300	2,296.00	14,464,800	貸付有価証券 500株（400株）
I B J	9,300	908.00	8,444,400	貸付有価証券 900株（900株）

アサンテ	7,500	1,655.00	12,412,500	
バリューHR	13,300	1,437.00	19,112,100	貸付有価証券 5,800株
M&Aキャピタルパート ナーズ	14,100	3,740.00	52,734,000	貸付有価証券 500株
ライドオンエクスプレス ホールディングス	6,600	1,356.00	8,949,600	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
E R I ホールディングス	4,800	1,035.00	4,968,000	貸付有価証券 500株（400株）
アビスト	2,600	2,999.00	7,797,400	
シグマクス・ホール ディングス	20,500	1,275.00	26,137,500	
ウィルグループ	12,700	1,373.00	17,437,100	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	17,700	161.00	2,849,700	
メドピア	12,000	1,886.00	22,632,000	貸付有価証券 4,500株（3,400株）
レアジョブ	3,200	677.00	2,166,400	貸付有価証券 1,500株（1,500株）
リクルートホールディン グス	1,221,000	5,142.00	6,278,382,000	貸付有価証券 2,200株
エラン	20,100	1,108.00	22,270,800	
土木管理総合試験所	7,100	322.00	2,286,200	
ネットマーケティング	8,300	897.00	7,445,100	貸付有価証券 3,900株（1,100株）
日本郵政	1,862,200	966.80	1,800,374,960	
ベルシステム24ホール ディングス	24,500	1,495.00	36,627,500	
鎌倉新書	19,400	683.00	13,250,200	貸付有価証券 300株
SMN	3,900	575.00	2,242,500	
一蔵	2,100	421.00	884,100	
グローバルキッズCOM PANY	2,600	685.00	1,781,000	
エアトリ	9,800	2,702.00	26,479,600	貸付有価証券 4,600株（4,500株）
アトラエ	11,900	1,744.00	20,753,600	
ストライク	7,500	4,125.00	30,937,500	貸付有価証券 100株
ソラスト	41,900	849.00	35,573,100	
セラク	5,400	1,115.00	6,021,000	貸付有価証券

				100株（100株）
インソース	18,900	2,896.00	54,734,400	貸付有価証券 200株
ベイカレント・コンサル ティング	12,000	44,400.00	532,800,000	
Orchestra H oldings	3,300	2,782.00	9,180,600	貸付有価証券 200株（200株）
アイモバイル	8,500	1,353.00	11,500,500	貸付有価証券 1,200株
キャリアインデックス	5,800	484.00	2,807,200	
MS－Japan	6,900	830.00	5,727,000	貸付有価証券 400株
船場	2,900	691.00	2,003,900	貸付有価証券 200株
ジャパンエレベーター サービスホールディン	54,100	1,911.00	103,385,100	貸付有価証券 300株
フルテック	2,400	1,238.00	2,971,200	
グリーンズ	6,400	672.00	4,300,800	貸付有価証券 100株
ツナググループ・ホール ディングス	4,800	334.00	1,603,200	
GameWith	5,100	402.00	2,050,200	貸付有価証券 200株（200株）
MS&Consulti ng	2,500	642.00	1,605,000	
ウェルビー	11,200	743.00	8,321,600	貸付有価証券 100株（100株）
エル・ティー・エス	1,900	3,335.00	6,336,500	貸付有価証券 800株（800株）
ミダックホールディング ス	7,700	3,230.00	24,871,000	貸付有価証券 3,100株
日総工産	13,300	574.00	7,634,200	
キュービーネットホール ディングス	7,900	1,504.00	11,881,600	
RPAホールディングス	24,000	325.00	7,800,000	貸付有価証券 9,500株（9,500株）
スプリックス	5,800	1,072.00	6,217,600	貸付有価証券 700株（700株）
マネジメントソリュー ションズ	8,400	3,205.00	26,922,000	貸付有価証券 3,900株（3,700株）
プロレド・パートナーズ	3,700	526.00	1,946,200	貸付有価証券 400株（100株）

and factory	4,900	427.00	2,092,300	貸付有価証券 2,300株
テノ・ホールディングス	2,100	597.00	1,253,700	
フロンティア・マネジ メント	5,100	1,395.00	7,114,500	
ピアラ	2,800	785.00	2,198,000	
コプロ・ホールディング ス	3,300	926.00	3,055,800	
ギークス	2,900	919.00	2,665,100	貸付有価証券 600株
カーブスホールディング ス	46,800	821.00	38,422,800	貸付有価証券 100株
フォーラムエンジニアリ ング	10,400	986.00	10,254,400	
Fast Fitness Japan	3,100	1,679.00	5,204,900	貸付有価証券 600株（600株）
ダイレクトマーケティング グミックス	17,300	1,769.00	30,603,700	
ポピンズ	2,300	1,970.00	4,531,000	
LITALICO	13,800	3,215.00	44,367,000	
アドバンテッジリスクマ ネジメント	8,600	481.00	4,136,600	貸付有価証券 600株
リログループ	93,200	2,235.00	208,302,000	
東祥	12,700	1,187.00	15,074,900	貸付有価証券 400株（400株）
ビーウィズ	4,600	1,420.00	6,532,000	
TREホールディングス	32,000	1,562.00	49,984,000	
人・夢・技術グループ	6,800	2,667.00	18,135,600	
エイチ・アイ・エス	39,800	2,094.00	83,341,200	貸付有価証券 18,700株（300株）
ラックランド	4,700	2,957.00	13,897,900	
共立メンテナンス	30,400	5,240.00	159,296,000	貸付有価証券 12,600株（7,100株）
イチネンホールディング ス	17,500	1,294.00	22,645,000	
建設技術研究所	7,800	2,615.00	20,397,000	
スペース	11,000	869.00	9,559,000	
燦ホールディングス	7,400	1,834.00	13,571,600	貸付有価証券 100株（100株）
スバル興業	1,000	8,840.00	8,840,000	貸付有価証券

				400株
東京テアトル	6,200	1,221.00	7,570,200	
タナベ経営	6,500	652.00	4,238,000	
ナガワ	4,800	8,500.00	40,800,000	貸付有価証券 700株
東京都競馬	12,700	4,355.00	55,308,500	
常磐興産	5,900	1,325.00	7,817,500	
カナモト	27,900	2,160.00	60,264,000	貸付有価証券 11,800株
西尾レントオール	14,200	2,925.00	41,535,000	
トランス・コスモス	21,600	3,925.00	84,780,000	貸付有価証券 200株（100株）
乃村工藝社	73,000	964.00	70,372,000	
藤田観光	6,800	2,582.00	17,557,600	貸付有価証券 100株
KNT－CTホールディングス	10,600	1,591.00	16,864,600	貸付有価証券 700株（700株）
日本管財	18,200	2,720.00	49,504,000	
トーカイ	13,500	1,873.00	25,285,500	
白洋舎	1,600	1,330.00	2,128,000	貸付有価証券 800株
セコム	168,000	9,232.00	1,550,976,000	貸付有価証券 1,000株
セントラル警備保障	8,200	2,579.00	21,147,800	貸付有価証券 500株（300株）
丹青社	32,200	808.00	26,017,600	
メイテック	60,700	2,531.00	153,631,700	
応用地質	14,800	1,802.00	26,669,600	
船井総研ホールディングス	32,000	2,385.00	76,320,000	
進学会ホールディングス	5,500	330.00	1,815,000	貸付有価証券 2,200株（400株）
オオバ	10,700	730.00	7,811,000	貸付有価証券 5,000株
いであ	3,700	1,734.00	6,415,800	貸付有価証券 100株（100株）
学究社	5,500	1,604.00	8,822,000	貸付有価証券 400株（400株）
ベネッセホールディングス	56,800	2,220.00	126,096,000	貸付有価証券 400株

		イオンディライト	19,600	2,936.00	57,545,600	
		ナック	8,100	948.00	7,678,800	
		ダイセキ	31,100	4,130.00	128,443,000	
		ステップ	6,200	1,838.00	11,395,600	
	小計	銘柄数：2,152			457,771,510,580	
		組入時価比率：98.1%			100.0%	
	合計				457,771,510,580	

(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8月17日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 8月17日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	8,482,573,900	—	8,904,420,000	421,626,320
合計	8,482,573,900	—	8,904,420,000	421,626,320

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,067,592,277
国債証券	23,584,007,840

(2022年 8月17日現在)

未収利息	56,202,989
前払費用	9,315,753
流動資産合計	24,717,118,859
資産合計	24,717,118,859
負債の部	
流動負債	
未払金	825,951,800
未払解約金	2,724,885
未払利息	421
流動負債合計	828,677,106
負債合計	828,677,106
純資産の部	
元本等	
元本	17,843,990,290
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,044,451,463
元本等合計	23,888,441,753
純資産合計	23,888,441,753
負債純資産合計	24,717,118,859

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.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。
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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3387円
(10,000口当たり純資産額)	(13,387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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月17日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法**国債証券**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）**元本の移動及び期末元本額の内訳**

2022年 8月17日現在

期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	16,378,722,981円
同期中における追加設定元本額	3,882,032,031円
同期中における一部解約元本額	2,416,764,722円
期末元本額	17,843,990,290円
期末元本額の内訳※	
バランスセレクト30	575,244,718円
バランスセレクト50	639,589,747円
バランスセレクト70	315,583,785円
ネクストコア	243,999,671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）	467,969,874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）	900,438,333円

バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	25,343,031円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	58,821,349円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	23,341,576円
野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）	4,928,717,184円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	184,548,182円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	8,031,022,979円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	1,449,369,861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8月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年8月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付（２年）第４３４回	300,000,000	300,552,000	
		国庫債券 利付（２年）第４３５回	200,000,000	200,388,000	
		国庫債券 利付（２年）第４３６回	280,000,000	280,548,800	
		国庫債券 利付（２年）第４３８回	400,000,000	400,784,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３９回	420,000,000	421,398,600	
		国庫債券 利付（５年）第１４０回	370,000,000	371,361,600	
		国庫債券 利付（５年）第１４１回	340,000,000	341,387,200	
		国庫債券 利付（５年）第１４２回	150,000,000	150,685,500	
		国庫債券 利付（５年）第１４５回	270,000,000	271,547,100	
		国庫債券 利付（５年）第１４６回	250,000,000	251,505,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４７回	250,000,000	250,717,500	
		国庫債券 利付（５年）第１４８回	160,000,000	160,430,400	
		国庫債券 利付（５年）第１４９回	250,000,000	250,612,500	
		国庫債券 利付（５年）第１５２回	100,000,000	100,573,000	
		国庫債券 利付（５年）第１５３回	470,000,000	470,338,400	
		国庫債券 利付（４０年）第１回	80,000,000	105,836,800	
		国庫債券 利付（４０年）第２回	120,000,000	153,138,000	
		国庫債券 利付（４０年）第３回	70,000,000	89,615,400	
		国庫債券 利付（４０年）第４回	110,000,000	140,911,100	
		国庫債券 利付（４０年）第５回	100,000,000	123,394,000	
		国庫債券 利付（４０年）第６回	130,000,000	157,219,400	
		国庫債券 利付（４０年）第７回	90,000,000	104,370,300	
		国庫債券 利付（４０年）第８回	60,000,000	64,783,800	

国庫債券 利付（４０年）第９回	40,000,000	32,070,800	
国庫債券 利付（４０年）第１０回	70,000,000	65,832,200	
国庫債券 利付（４０年）第１１回	50,000,000	45,466,000	
国庫債券 利付（４０年）第１２回	40,000,000	32,673,200	
国庫債券 利付（４０年）第１３回	40,000,000	32,536,400	
国庫債券 利付（４０年）第１４回	110,000,000	95,872,700	
国庫債券 利付（４０年）第１５回	90,000,000	85,628,700	
国庫債券 利付（１０年）第３３２回	150,000,000	151,449,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３３回	250,000,000	252,820,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３４回	370,000,000	374,769,300	
国庫債券 利付（１０年）第３３５回	200,000,000	202,492,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３６回	120,000,000	121,674,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３７回	100,000,000	100,926,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３８回	60,000,000	60,762,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３９回	100,000,000	101,394,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４１回	200,000,000	202,544,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４２回	230,000,000	231,446,700	
国庫債券 利付（１０年）第３４３回	200,000,000	201,268,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４４回	300,000,000	301,905,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４５回	240,000,000	241,459,200	
国庫債券 利付（１０年）第３４６回	270,000,000	271,547,100	
国庫債券 利付（１０年）第３４７回	220,000,000	221,223,200	
国庫債券 利付（１０年）第３４８回	230,000,000	231,228,200	
国庫債券 利付（１０年）第３４９回	150,000,000	150,799,500	
国庫債券 利付（１０年）第３５０回	320,000,000	321,696,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５１回	180,000,000	180,945,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５２回	220,000,000	221,137,400	
国庫債券 利付（１０年）第３５５回	100,000,000	100,477,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５６回	60,000,000	60,232,800	

国庫債券 利付（１０年）第３５７回	310,000,000	310,678,900	
国庫債券 利付（１０年）第３５８回	150,000,000	150,225,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５９回	200,000,000	200,154,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６０回	200,000,000	200,000,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６１回	150,000,000	149,875,500	
国庫債券 利付（１０年）第３６２回	150,000,000	149,745,000	
国庫債券 利付（１０年）第３６３回	110,000,000	109,710,700	
国庫債券 利付（１０年）第３６４回	40,000,000	39,874,000	
国庫債券 利付（３０年）第１回	70,000,000	83,629,700	
国庫債券 利付（３０年）第３回	40,000,000	46,842,400	
国庫債券 利付（３０年）第６回	20,000,000	24,152,800	
国庫債券 利付（３０年）第７回	55,000,000	66,303,050	
国庫債券 利付（３０年）第８回	50,000,000	58,074,000	
国庫債券 利付（３０年）第９回	20,000,000	22,419,800	
国庫債券 利付（３０年）第１０回	30,000,000	32,714,100	
国庫債券 利付（３０年）第１１回	40,000,000	46,193,200	
国庫債券 利付（３０年）第１２回	30,000,000	35,988,900	
国庫債券 利付（３０年）第１３回	40,000,000	47,640,000	
国庫債券 利付（３０年）第１４回	120,000,000	148,632,000	
国庫債券 利付（３０年）第１５回	100,000,000	125,294,000	
国庫債券 利付（３０年）第１６回	70,000,000	87,915,800	
国庫債券 利付（３０年）第１７回	80,000,000	99,752,800	
国庫債券 利付（３０年）第１８回	60,000,000	74,238,600	
国庫債券 利付（３０年）第１９回	70,000,000	86,717,400	
国庫債券 利付（３０年）第２０回	60,000,000	76,051,200	
国庫債券 利付（３０年）第２１回	50,000,000	62,188,000	
国庫債券 利付（３０年）第２２回	40,000,000	50,889,600	
国庫債券 利付（３０年）第２３回	70,000,000	89,275,200	
国庫債券 利付（３０年）第２４回	50,000,000	63,877,500	
国庫債券 利付（３０年）第２５回	70,000,000	87,679,900	
国庫債券 利付（３０年）第２６回	80,000,000	101,491,200	
国庫債券 利付（３０年）第２７回	70,000,000	90,086,500	
国庫債券 利付（３０年）第２８回	100,000,000	129,012,000	
国庫債券 利付（３０年）第２９回	110,000,000	140,705,400	
国庫債券 利付（３０年）第３０回	130,000,000	164,578,700	
国庫債券 利付（３０年）第３１回	100,000,000	125,286,000	
国庫債券 利付（３０年）第３２回	150,000,000	190,716,000	
国庫債券 利付（３０年）第３３回	100,000,000	122,248,000	

国庫債券 利付（３０年）第３４回	160,000,000	201,124,800	
国庫債券 利付（３０年）第３５回	110,000,000	134,647,700	
国庫債券 利付（３０年）第３６回	70,000,000	85,896,300	
国庫債券 利付（３０年）第３７回	180,000,000	217,661,400	
国庫債券 利付（３０年）第３８回	100,000,000	119,149,000	
国庫債券 利付（３０年）第３９回	100,000,000	121,161,000	
国庫債券 利付（３０年）第４０回	90,000,000	107,306,100	
国庫債券 利付（３０年）第４１回	70,000,000	82,082,000	
国庫債券 利付（３０年）第４２回	70,000,000	82,049,800	
国庫債券 利付（３０年）第４３回	80,000,000	93,733,600	
国庫債券 利付（３０年）第４４回	70,000,000	81,980,500	
国庫債券 利付（３０年）第４５回	60,000,000	67,831,200	
国庫債券 利付（３０年）第４６回	90,000,000	101,662,200	
国庫債券 利付（３０年）第４７回	90,000,000	103,503,600	
国庫債券 利付（３０年）第４８回	60,000,000	66,433,200	
国庫債券 利付（３０年）第４９回	60,000,000	66,362,400	
国庫債券 利付（３０年）第５０回	40,000,000	39,107,600	
国庫債券 利付（３０年）第５３回	30,000,000	27,841,500	
国庫債券 利付（３０年）第５４回	30,000,000	29,103,000	
国庫債券 利付（３０年）第５５回	30,000,000	29,037,300	
国庫債券 利付（３０年）第５６回	100,000,000	96,569,000	
国庫債券 利付（３０年）第５７回	50,000,000	48,173,000	
国庫債券 利付（３０年）第５８回	60,000,000	57,672,600	
国庫債券 利付（３０年）第５９回	50,000,000	46,775,500	
国庫債券 利付（３０年）第６０回	100,000,000	97,930,000	
国庫債券 利付（３０年）第６１回	80,000,000	74,376,000	
国庫債券 利付（３０年）第６２回	30,000,000	26,405,700	
国庫債券 利付（３０年）第６３回	40,000,000	34,162,400	
国庫債券 利付（３０年）第６４回	30,000,000	25,510,500	
国庫債券 利付（３０年）第６５回	20,000,000	17,003,600	
国庫債券 利付（３０年）第６７回	80,000,000	71,322,400	
国庫債券 利付（３０年）第６８回	60,000,000	53,389,800	
国庫債券 利付（３０年）第６９回	60,000,000	54,873,600	
国庫債券 利付（３０年）第７０回	70,000,000	63,771,400	
国庫債券 利付（３０年）第７１回	60,000,000	54,566,400	
国庫債券 利付（３０年）第７２回	50,000,000	45,392,000	
国庫債券 利付（３０年）第７３回	50,000,000	45,362,500	
国庫債券 利付（３０年）第７４回	70,000,000	68,667,200	
国庫債券 利付（３０年）第７５回	60,000,000	63,264,000	
国庫債券 利付（２０年）第６４回	10,000,000	10,222,700	
国庫債券 利付（２０年）第６５回	10,000,000	10,271,000	
国庫債券 利付（２０年）第６６回	20,000,000	20,515,200	

国庫債券 利付（２０年）第６７回	10,000,000	10,319,400
国庫債券 利付（２０年）第６８回	80,000,000	82,936,000
国庫債券 利付（２０年）第６９回	30,000,000	31,053,300
国庫債券 利付（２０年）第７１回	10,000,000	10,423,600
国庫債券 利付（２０年）第７２回	20,000,000	20,917,200
国庫債券 利付（２０年）第７３回	10,000,000	10,491,200
国庫債券 利付（２０年）第７４回	10,000,000	10,514,700
国庫債券 利付（２０年）第７５回	40,000,000	42,270,800
国庫債券 利付（２０年）第７６回	17,000,000	17,876,860
国庫債券 利付（２０年）第７７回	15,000,000	15,812,550
国庫債券 利付（２０年）第７８回	10,000,000	10,566,200
国庫債券 利付（２０年）第７９回	10,000,000	10,594,700
国庫債券 利付（２０年）第８０回	10,000,000	10,623,100
国庫債券 利付（２０年）第８１回	10,000,000	10,646,000
国庫債券 利付（２０年）第８２回	15,000,000	16,015,500
国庫債券 利付（２０年）第８３回	15,000,000	16,095,000
国庫債券 利付（２０年）第８４回	50,000,000	53,482,500
国庫債券 利付（２０年）第８５回	13,000,000	14,014,130
国庫債券 利付（２０年）第８６回	10,000,000	10,852,000
国庫債券 利付（２０年）第８８回	20,000,000	21,820,000
国庫債券 利付（２０年）第９０回	20,000,000	21,844,400
国庫債券 利付（２０年）第９１回	10,000,000	10,963,200
国庫債券 利付（２０年）第９２回	30,000,000	32,790,900
国庫債券 利付（２０年）第９３回	70,000,000	76,507,900
国庫債券 利付（２０年）第９４回	20,000,000	21,951,400
国庫債券 利付（２０年）第９５回	90,000,000	100,063,800
国庫債券 利付（２０年）第９６回	85,000,000	93,681,050
国庫債券 利付（２０年）第９７回	50,000,000	55,613,500
国庫債券 利付（２０年）第９９回	110,000,000	122,334,300
国庫債券 利付（２０年）第１００回	20,000,000	22,451,600
国庫債券 利付（２０年）第１０１回	20,000,000	22,675,000
国庫債券 利付（２０年）第１０２回	100,000,000	113,945,000
国庫債券 利付（２０年）第１０３回	75,000,000	85,021,500
国庫債券 利付（２０年）第１０４回	10,000,000	11,219,500
国庫債券 利付（２０年）第１０５回	70,000,000	78,880,200
国庫債券 利付（２０年）第１０６回	70,000,000	79,306,500
国庫債券 利付（２０年）第１０７回	70,000,000	79,218,300
	80,000,000	89,522,400

国庫債券 利付（２０年）第１０８回			
国庫債券 利付（２０年）第１０９回	60,000,000	67,419,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１０回	80,000,000	90,944,800	
国庫債券 利付（２０年）第１１１回	10,000,000	11,480,800	
国庫債券 利付（２０年）第１１２回	85,000,000	97,007,100	
国庫債券 利付（２０年）第１１３回	160,000,000	183,238,400	
国庫債券 利付（２０年）第１１４回	40,000,000	45,946,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１５回	50,000,000	57,797,500	
国庫債券 利付（２０年）第１１６回	70,000,000	81,220,300	
国庫債券 利付（２０年）第１１７回	60,000,000	69,165,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１８回	40,000,000	45,964,400	
国庫債券 利付（２０年）第１１９回	50,000,000	56,676,500	
国庫債券 利付（２０年）第１２０回	110,000,000	122,975,600	
国庫債券 利付（２０年）第１２１回	70,000,000	80,143,700	
国庫債券 利付（２０年）第１２２回	40,000,000	45,475,200	
国庫債券 利付（２０年）第１２３回	100,000,000	116,493,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２４回	50,000,000	57,833,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２５回	40,000,000	47,110,800	
国庫債券 利付（２０年）第１２８回	80,000,000	92,453,600	
国庫債券 利付（２０年）第１２９回	50,000,000	57,346,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３０回	50,000,000	57,527,500	
国庫債券 利付（２０年）第１３２回	10,000,000	11,443,400	
国庫債券 利付（２０年）第１３３回	30,000,000	34,607,100	
国庫債券 利付（２０年）第１３４回	50,000,000	57,796,500	
国庫債券 利付（２０年）第１３７回	40,000,000	45,922,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３９回	30,000,000	34,151,100	
	70,000,000	80,544,100	

国庫債券 利付（２０年）第１４０回			
国庫債券 利付（２０年）第１４１回	100,000,000	115,195,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４２回	100,000,000	116,208,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４３回	90,000,000	102,848,400	
国庫債券 利付（２０年）第１４４回	80,000,000	90,593,600	
国庫債券 利付（２０年）第１４５回	150,000,000	173,224,500	
国庫債券 利付（２０年）第１４６回	240,000,000	277,401,600	
国庫債券 利付（２０年）第１４７回	230,000,000	263,655,900	
国庫債券 利付（２０年）第１４８回	170,000,000	193,165,900	
国庫債券 利付（２０年）第１４９回	230,000,000	261,401,900	
国庫債券 利付（２０年）第１５０回	170,000,000	191,370,700	
国庫債券 利付（２０年）第１５１回	100,000,000	110,184,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５２回	130,000,000	143,234,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５３回	120,000,000	133,677,600	
国庫債券 利付（２０年）第１５４回	110,000,000	121,171,600	
国庫債券 利付（２０年）第１５５回	80,000,000	86,024,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５６回	10,000,000	9,955,100	
国庫債券 利付（２０年）第１５８回	50,000,000	50,264,500	
国庫債券 利付（２０年）第１５９回	20,000,000	20,349,200	
国庫債券 利付（２０年）第１６０回	10,000,000	10,299,900	
国庫債券 利付（２０年）第１６１回	30,000,000	30,414,300	
国庫債券 利付（２０年）第１６２回	60,000,000	60,714,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６３回	50,000,000	50,460,500	
国庫債券 利付（２０年）第１６４回	60,000,000	59,526,600	
国庫債券 利付（２０年）第１６５回	50,000,000	49,491,500	
国庫債券 利付（２０年）第１６６回	90,000,000	91,656,000	
	40,000,000	39,404,400	

		国庫債券 利付（２０年）第１６７回			
		国庫債券 利付（２０年）第１６８回	50,000,000	48,345,500	
		国庫債券 利付（２０年）第１６９回	30,000,000	28,449,300	
		国庫債券 利付（２０年）第１７０回	50,000,000	47,271,500	
		国庫債券 利付（２０年）第１７１回	60,000,000	56,551,200	
		国庫債券 利付（２０年）第１７２回	50,000,000	47,800,500	
		国庫債券 利付（２０年）第１７３回	50,000,000	47,659,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７４回	70,000,000	66,521,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７５回	80,000,000	77,148,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７６回	110,000,000	105,772,700	
		国庫債券 利付（２０年）第１７７回	80,000,000	75,377,600	
		国庫債券 利付（２０年）第１７８回	60,000,000	57,447,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１７９回	40,000,000	38,246,400	
		国庫債券 利付（２０年）第１８０回	50,000,000	50,426,500	
	小計	銘柄数：235	22,095,000,000	23,584,007,840	
		組入時価比率：98.7%		100.0%	
	合計			23,584,007,840	

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

第２ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	7,271,053,995
コール・ローン	1,575,750,203
株式	1,367,312,750,762
投資証券	35,057,888,614
派生商品評価勘定	1,048,265,222
未収入金	1,793,752
未収配当金	1,504,448,735
差入委託証拠金	5,160,195,380

(2022年 8月17日現在)

流動資産合計	1,418,932,146,663
資産合計	1,418,932,146,663
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	176,800
未払解約金	1,469,578,994
未払利息	621
その他未払費用	2,922,100
流動負債合計	1,472,678,515
負債合計	1,472,678,515
純資産の部	
元本等	
元本	293,454,493,740
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,124,004,974,408
元本等合計	1,417,459,468,148
純資産合計	1,417,459,468,148
負債純資産合計	1,418,932,146,663

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。
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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	4.8303円
(10,000口当たり純資産額)	(48,303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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 8月17日現在	
期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	272,160,916,525円
同期中における追加設定元本額	32,795,284,309円
同期中における一部解約元本額	11,501,707,094円
期末元本額	293,454,493,740円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	30,182,614円
バランスセレクト50	91,134,268円
バランスセレクト70	113,244,685円
野村外国株式インデックスファンド	491,157,310円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,027,698,673円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,960,195,993円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,955,187,427円
野村資産設計ファンド2015	9,306,422円
野村資産設計ファンド2020	10,010,682円
野村資産設計ファンド2025	16,514,216円
野村資産設計ファンド2030	25,332,440円
野村資産設計ファンド2035	22,933,747円
野村資産設計ファンド2040	42,458,667円
野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	46,111,813,851円
のむラップ・ファンド（保守型）	877,217,503円
のむラップ・ファンド（普通型）	10,589,840,008円
のむラップ・ファンド（積極型）	10,699,162,332円
野村資産設計ファンド2045	8,727,676円
野村インデックスファンド・外国株式	7,841,817,464円
マイ・ロード	1,012,401,225円
ネクストコア	12,573,129円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	177,229,374円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	2,687,773,776円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	216,989,641円
野村資産設計ファンド2050	10,614,571円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	2,990,509円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,774,128円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,389,603円

野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,231,995円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	229,155,559円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	916,394,520円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,246,703円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,599,134円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	27,396,932円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	7,933,239円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	35,443,897円
野村6資産均等バランス	1,460,414,306円
野村つみたて外国株投信	12,048,467,047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）	5,021,767,437円
世界6資産分散ファンド	38,400,905円
野村資産設計ファンド2060	7,944,423円
野村スリーゼロ先進国株式投信	1,023,412,529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	6,865,214,024円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	5,771,091,623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）	124,582,064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）	62,494,604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）	511,749,419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）	529,461,718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）	1,221,362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）	4,160,012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）	719,247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）	724,983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）	11,388,802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）	360,911,750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）	4,386,451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）	26,700,461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）	82,071,071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）	2,131,500,460円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	19,866,410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）	721,241,015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）	11,543,615,058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）	1,097,380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）	8,436,161円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	1,333,005円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	8,421,189円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	8,306,118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）	89,736,545,743円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	2,079,239,204円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	7,763,642,330円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	7,578,639,593円
マイバランスDC30	776,134,413円

マイバランスDC50	1,814,404,643円
マイバランスDC70	1,661,578,785円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	37,975,443,281円
野村DC運用戦略ファンド	414,033,563円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	31,422,924円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	405,812,381円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	338,663,080円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	347,188,529円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	18,287,611円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	8,589,887円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	46,617,613円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	8,557,914円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	8,084,943円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	6,283,416円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	199,278,479円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	156,372,039円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	94,318,929円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	123,725,671円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	4,404,892円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	35,544,544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）	100,724,258円
みらいバランス・株式10（富士通企業年金基金DC向け）	49,724,275円
野村DCバランスファンド（年金運用戦略タイプ）	55,853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8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	192,000	25.06	4,811,520.00	
		HALLIBURTON CO	178,000	28.21	5,021,380.00	
		SCHLUMBERGER LTD	286,000	35.58	10,175,880.00	
		APA CORPORATION	67,000	33.22	2,225,740.00	
		CHENIERE ENERGY INC	46,900	161.28	7,564,032.00	
		CHEVRON CORP	394,000	156.41	61,625,540.00	
		CONOCOPHILLIPS	262,900	100.10	26,316,290.00	
		COTERRA ENERGY INC	162,000	29.18	4,727,160.00	
		DEVON ENERGY CORP	128,100	63.58	8,144,598.00	

DIAMONDBACK ENERGY INC	33,600	125.59	4,219,824.00	
EOG RESOURCES INC	119,200	112.41	13,399,272.00	
EQT CORP	66,000	47.19	3,114,540.00	
EXXON MOBIL CORP	856,400	91.46	78,326,344.00	
HESS CORP	56,200	110.88	6,231,456.00	
KINDER MORGAN INC	410,000	18.65	7,646,500.00	
MARATHON OIL CORP	148,000	23.05	3,411,400.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	114,400	96.65	11,056,760.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	188,900	63.51	11,997,039.00	
ONEOK INC	90,900	63.30	5,753,970.00	
PHILLIPS 66	97,300	89.36	8,694,728.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	46,700	229.12	10,699,904.00	
TARGA RESOURCES CORP	45,100	68.23	3,077,173.00	
VALERO ENERGY CORP	82,100	113.31	9,302,751.00	
WILLIAMS COS	244,000	34.32	8,374,080.00	
AIR PRODUCTS	44,800	273.54	12,254,592.00	
ALBEMARLE CORP	23,600	280.81	6,627,116.00	
CELANESE CORP-SERIES A	20,900	117.83	2,462,647.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	41,200	103.23	4,253,076.00	
CORTEVA INC	147,400	62.10	9,153,540.00	
DOW INC	147,800	56.11	8,293,058.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	103,300	62.68	6,474,844.00	
EASTMAN CHEMICAL CO.	25,000	101.91	2,547,750.00	
ECOLAB INC	51,800	177.02	9,169,636.00	
FMC CORP	24,800	113.76	2,821,248.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	51,300	124.55	6,389,415.00	
LINDE PLC	103,700	312.29	32,384,473.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	53,600	91.40	4,899,040.00	
MOSAIC CO/THE	76,000	54.39	4,133,640.00	
PPG INDUSTRIES	47,600	137.21	6,531,196.00	
RPM INTERNATIONAL INC	25,800	95.33	2,459,514.00	
SHERWIN-WILLIAMS	50,400	256.27	12,916,008.00	
WESTLAKE CORPORATION	7,500	106.28	797,100.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	12,800	371.57	4,756,096.00	
VULCAN MATERIALS CO	27,300	178.39	4,870,047.00	

AMCOR PLC	300,000	13.29	3,987,000.00	
AVERY DENNISON CORP	16,900	204.12	3,449,628.00	
BALL CORP	65,000	61.69	4,009,850.00	
CROWN HOLDINGS INC	24,700	101.77	2,513,719.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	73,000	44.98	3,283,540.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	18,800	145.76	2,740,288.00	
SEALED AIR CORP	29,400	59.29	1,743,126.00	
WESTROCK CO	52,000	42.96	2,233,920.00	
ALCOA CORP	35,700	53.12	1,896,384.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	102,000	19.66	2,005,320.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	295,000	31.39	9,260,050.00	
NEWMONT CORP	161,400	46.05	7,432,470.00	
NUCOR CORP	55,100	142.65	7,860,015.00	
STEEL DYNAMICS	39,800	84.65	3,369,070.00	
BOEING CO	112,500	172.08	19,359,000.00	
GENERAL DYNAMICS	47,700	241.48	11,518,596.00	
HEICO CORP	9,300	165.56	1,539,708.00	
HEICO CORP-CLASS A	15,500	134.62	2,086,610.00	
HOWMET AEROSPACE INC	78,000	38.73	3,020,940.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	8,400	233.54	1,961,736.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	38,700	239.33	9,262,071.00	
LOCKHEED MARTIN	49,600	440.16	21,831,936.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	30,200	485.50	14,662,100.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	301,900	95.05	28,695,595.00	
TEXTRON INC	43,500	68.49	2,979,315.00	
TRANSDIGM GROUP INC	10,720	677.36	7,261,299.20	
ALLEGION PLC	17,900	108.46	1,941,434.00	
CARRIER GLOBAL CORP	172,000	44.39	7,635,080.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	25,600	70.05	1,793,280.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	143,600	59.00	8,472,400.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	6,400	266.96	1,708,544.00	
MASCO CORP	49,600	56.04	2,779,584.00	
OWENS CORNING INC	18,900	91.80	1,735,020.00	
SMITH (A.O.) CORP	27,900	64.33	1,794,807.00	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	47,000	167.26	7,861,220.00	
QUANTA SERVICES INC	29,500	142.43	4,201,685.00	
AMETEK INC	47,200	130.31	6,150,632.00	
EATON CORP PLC	81,200	153.10	12,431,720.00	
EMERSON ELEC	119,100	89.95	10,713,045.00	
GENERAC HOLDINGS INC	13,100	267.51	3,504,381.00	
PLUG POWER INC	105,000	29.19	3,064,950.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	23,800	259.44	6,174,672.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	32,000	45.56	1,457,920.00	
3M CORP	116,100	150.26	17,445,186.00	
GENERAL ELECTRIC CO	223,500	81.07	18,119,145.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	138,700	203.67	28,249,029.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	44,400	50.67	2,249,748.00	
CATERPILLAR INC DEL	108,800	197.52	21,490,176.00	
CUMMINS INC	28,700	232.40	6,669,880.00	
DEERE & COMPANY	59,200	369.98	21,902,816.00	
DOVER CORP	29,700	141.33	4,197,501.00	
FORTIVE CORP	68,000	68.66	4,668,880.00	
IDEX CORP	15,200	217.41	3,304,632.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	63,200	217.06	13,718,192.00	
INGERSOLL-RAND INC	81,000	53.97	4,371,570.00	
KORNIT DIGITAL LTD	11,200	34.85	390,320.00	
NORDSON CORP	10,400	245.78	2,556,112.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	85,600	81.32	6,960,992.00	
PACCAR	70,700	94.78	6,700,946.00	
PARKER HANNIFIN CORP	25,900	306.11	7,928,249.00	
PENTAIR PLC	33,700	50.95	1,717,015.00	
SNAP-ON INC	10,600	233.35	2,473,510.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	32,700	103.58	3,387,066.00	
WABTEC CORP	36,300	96.34	3,497,142.00	
XYLEM INC	35,900	103.96	3,732,164.00	
AERCAP HOLDINGS NV	25,100	50.60	1,270,060.00	
FASTENAL CO	117,100	56.05	6,563,455.00	
GRAINGER(W.W.) INC	9,300	584.19	5,432,967.00	
UNITED RENTALS INC	14,900	339.31	5,055,719.00	

CINTAS CORP	18,900	437.81	8,274,609.00	
COPART INC	42,500	131.63	5,594,275.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	44,600	147.12	6,561,552.00	
ROLLINS INC	47,000	37.49	1,762,030.00	
WASTE CONNECTIONS INC	51,800	143.71	7,444,178.00	
WASTE MANAGEMENT INC	84,400	174.81	14,753,964.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	25,900	117.55	3,044,545.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	34,800	108.04	3,759,792.00	
FEDEX CORPORATION	51,300	238.22	12,220,686.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	148,200	206.35	30,581,070.00	
DELTA AIR LINES INC	30,000	35.34	1,060,200.00	
SOUTHWEST AIRLINES	29,000	39.87	1,156,230.00	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	17,000	50.90	865,300.00	
AMERCO	2,130	590.65	1,258,084.50	
CSX CORP	446,000	34.44	15,360,240.00	
GRAB HOLDINGS LTD-CL A	203,000	3.66	742,980.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	16,800	194.65	3,270,120.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30,100	56.97	1,714,797.00	
LYFT INC-A	65,000	19.34	1,257,100.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	48,800	257.61	12,571,368.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	19,700	310.07	6,108,379.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	295,000	32.38	9,552,100.00	
UNION PAC CORP	128,800	241.35	31,085,880.00	
APTIV PLC	54,600	108.07	5,900,622.00	
BORGWARNER INC	50,000	39.75	1,987,500.00	
LEAR CORP	12,300	151.10	1,858,530.00	
FORD MOTOR COMPANY	796,000	16.43	13,078,280.00	
GENERAL MOTORS CO	277,000	38.99	10,800,230.00	
LUCID GROUP INC	80,000	18.93	1,514,400.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	34,600	38.23	1,322,758.00	
TESLA INC	177,700	919.69	163,428,913.00	
DR HORTON INC	68,600	78.61	5,392,646.00	
GARMIN LTD	30,600	99.59	3,047,454.00	
LENNAR CORP-A	52,300	88.07	4,606,061.00	

MOHAWK INDUSTRIES	10,900	126.56	1,379,504.00	
NEWELL BRANDS INC	85,000	21.42	1,820,700.00	
NVR INC	650	4,445.00	2,889,250.00	
PULTEGROUP INC	51,000	44.55	2,272,050.00	
WHIRLPOOL CORP	11,300	175.56	1,983,828.00	
HASBRO INC	25,500	82.42	2,101,710.00	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	52,000	13.69	711,880.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	23,700	331.70	7,861,290.00	
NIKE INC-B	258,200	118.06	30,483,092.00	
V F CORP	65,700	47.92	3,148,344.00	
AIRBNB INC-CLASS A	67,200	124.18	8,344,896.00	
ARAMARK	44,000	37.75	1,661,000.00	
BOOKING HOLDINGS INC	8,310	2,151.34	17,877,635.40	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	44,000	52.05	2,290,200.00	
CARNIVAL CORP	206,000	11.19	2,305,140.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,690	1,714.68	9,756,529.20	
DARDEN RESTAURANTS INC	25,000	134.35	3,358,750.00	
DOMINOS PIZZA INC	7,400	410.93	3,040,882.00	
EXPEDIA GROUP INC	30,100	117.16	3,526,516.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	56,700	139.02	7,882,434.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	69,000	38.28	2,641,320.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	56,200	166.24	9,342,688.00	
MCDONALD'S CORP	150,400	266.29	40,050,016.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	36.17	2,568,070.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	43,700	44.08	1,926,296.00	
STARBUCKS CORP	233,600	89.40	20,883,840.00	
VAIL RESORTS INC	8,200	248.15	2,034,830.00	
WYNN RESORTS LTD	22,800	67.84	1,546,752.00	
YUM BRANDS INC	58,100	119.04	6,916,224.00	
GENUINE PARTS CO	29,300	159.15	4,663,095.00	
LKQ CORP	56,300	56.31	3,170,253.00	
POOL CORP	8,300	392.67	3,259,161.00	
AMAZON.COM INC	1,852,800	144.78	268,248,384.00	
CHEWY INC - CLASS A	20,000	50.01	1,000,200.00	
DOORDASH INC-A	39,500	73.57	2,906,015.00	

EBAY INC	117,000	49.50	5,791,500.00	
ETSY INC	26,400	120.86	3,190,704.00	
MERCADOLIBRE INC	9,130	1,053.75	9,620,737.50	
WAYFAIR INC - CLASS A	14,600	73.54	1,073,684.00	
DOLLAR GENERAL CORP	47,200	256.78	12,120,016.00	
DOLLAR TREE INC	45,600	168.22	7,670,832.00	
TARGET CORP	97,400	180.19	17,550,506.00	
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	209.60	2,515,200.00	
AUTOZONE	4,180	2,329.52	9,737,393.60	
BATH & BODY WORKS INC	50,400	41.02	2,067,408.00	
BEST BUY COMPANY INC	42,400	84.95	3,601,880.00	
BURLINGTON STORES INC	13,100	168.11	2,202,241.00	
CARMAX INC	33,300	104.22	3,470,526.00	
CARVANA CO	19,700	54.59	1,075,423.00	
HOME DEPOT	211,200	327.38	69,142,656.00	
LOWES COS INC	135,500	214.12	29,013,260.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	13,450	742.59	9,987,835.50	
ROSS STORES INC	71,300	92.64	6,605,232.00	
TJX COS INC	242,600	66.65	16,169,290.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	22,500	204.73	4,606,425.00	
ULTA BEAUTY INC	11,100	407.26	4,520,586.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	89,700	553.02	49,605,894.00	
KROGER CO	141,800	49.08	6,959,544.00	
SYSCO CORP	101,800	86.30	8,785,340.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	148,000	42.04	6,221,920.00	
WALMART INC	308,600	139.37	43,009,582.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	61,300	77.45	4,747,685.00	
COCA COLA CO	833,200	65.03	54,182,996.00	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	43,000	55.28	2,377,040.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	33,000	248.17	8,189,610.00	
KEURIG DR PEPPER INC	157,000	40.08	6,292,560.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	37,300	56.48	2,106,704.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	79,800	92.28	7,363,944.00	
PEPSICO INC	279,900	180.32	50,471,568.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	112,800	86.58	9,766,224.00	

BUNGE LIMITED	28,900	99.52	2,876,128.00	
CAMPBELL SOUP CO	43,900	50.69	2,225,291.00	
CONAGRA BRANDS INC	98,000	35.24	3,453,520.00	
GENERAL MILLS	122,100	77.44	9,455,424.00	
HERSHEY CO/THE	29,300	230.72	6,760,096.00	
HORMEL FOODS CORP	58,700	50.64	2,972,568.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	21,300	137.53	2,929,389.00	
KELLOGG CO	52,000	75.90	3,946,800.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	148,000	38.83	5,746,840.00	
MCCORMICK & CO INC.	49,800	92.47	4,605,006.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	282,100	65.96	18,607,316.00	
TYSON FOODS INC-CL A	59,600	82.09	4,892,564.00	
ALTRIA GROUP INC	369,000	45.74	16,878,060.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	313,500	101.72	31,889,220.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	49,500	88.36	4,373,820.00	
CLOROX CO	25,200	149.74	3,773,448.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	162,500	82.18	13,354,250.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	68,200	137.39	9,369,998.00	
PROCTER & GAMBLE CO	484,900	149.93	72,701,057.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	47,300	276.11	13,060,003.00	
ABBOTT LABORATORIES	356,700	112.03	39,961,101.00	
ABIOMED INC	9,400	291.12	2,736,528.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	15,200	289.04	4,393,408.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	103,000	61.84	6,369,520.00	
BECTON,DICKINSON	57,900	267.78	15,504,462.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	286,000	42.35	12,112,100.00	
DENTSPLY SIRONA INC	42,200	36.78	1,552,116.00	
DEXCOM INC	78,200	90.79	7,099,778.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	126,800	102.28	12,969,104.00	
HOLOGIC INC	51,700	72.85	3,766,345.00	
IDEXX LABORATORIES INC	17,100	382.24	6,536,304.00	
INSULET CORP	14,200	268.61	3,814,262.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	72,700	233.71	16,990,717.00	
MASIMO CORP	10,600	169.38	1,795,428.00	
MEDTRONIC PLC	271,600	95.31	25,886,196.00	

NOVOCURE LTD	18,800	83.05	1,561,340.00	
RESMED INC	29,400	236.10	6,941,340.00	
STERIS PLC	20,000	212.47	4,249,400.00	
STRYKER CORP	69,100	224.16	15,489,456.00	
TELEFLEX INC	9,400	253.11	2,379,234.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	9,800	337.27	3,305,246.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	41,600	116.12	4,830,592.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	31,700	152.66	4,839,322.00	
CARDINAL HEALTH INC	55,300	70.14	3,878,742.00	
CENTENE CORP	117,900	96.33	11,357,307.00	
CIGNA CORP	65,200	290.61	18,947,772.00	
CVS HEALTH CORP	265,500	106.43	28,257,165.00	
DAVITA INC	12,500	92.92	1,161,500.00	
ELEVANCE HEALTH INC	48,860	492.28	24,052,800.80	
HCA HEALTHCARE INC	49,200	212.87	10,473,204.00	
HENRY SCHEIN INC	27,800	76.45	2,125,310.00	
HUMANA INC	25,580	495.22	12,667,727.60	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	19,100	259.15	4,949,765.00	
MCKESSON CORP	30,000	373.84	11,215,200.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	11,900	334.43	3,979,717.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	23,700	140.53	3,330,561.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	190,330	546.12	103,943,019.60	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	14,300	108.44	1,550,692.00	
ABBVIE INC	357,800	142.55	51,004,390.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	24,400	228.15	5,566,860.00	
AMGEN INC	112,700	253.15	28,530,005.00	
BIOGEN INC	29,600	219.64	6,501,344.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	38,100	95.03	3,620,643.00	
EXACT SCIENCES CORP	36,600	41.11	1,504,626.00	
GILEAD SCIENCES INC	254,900	66.33	16,907,517.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	43,700	64.08	2,800,296.00	
INCYTE CORP	38,700	74.96	2,900,952.00	
MODERNA INC	69,200	167.96	11,622,832.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19,100	106.11	2,026,701.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	21,720	648.70	14,089,764.00	

SEAGEN INC	28,300	170.52	4,825,716.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	51,800	303.00	15,695,400.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	440,900	74.13	32,683,917.00	
CATALENT INC	34,000	109.22	3,713,480.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	81,000	19.08	1,545,480.00	
ELI LILLY & CO.	163,700	310.31	50,797,747.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12,000	158.72	1,904,640.00	
JOHNSON & JOHNSON	531,900	167.57	89,130,483.00	
MERCK & CO INC	511,300	90.59	46,318,667.00	
PFIZER INC	1,137,300	49.86	56,705,778.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	68,000	44.35	3,015,800.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	215,000	11.03	2,371,450.00	
VIATRIS INC	247,000	11.04	2,726,880.00	
ZOETIS INC	95,900	171.79	16,474,661.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,469,000	36.64	53,824,160.00	
CITIGROUP	400,000	54.18	21,672,000.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	99,000	40.09	3,968,910.00	
FIFTH THIRD BANCORP	138,000	37.62	5,191,560.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,510	857.19	2,151,546.90	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	36,000	170.12	6,124,320.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	286,000	14.47	4,138,420.00	
JPMORGAN CHASE & CO	597,300	123.63	73,844,199.00	
KEYCORP	189,000	19.78	3,738,420.00	
M & T BANK CORP	36,200	191.41	6,929,042.00	
PNC FINANCIAL	85,100	175.04	14,895,904.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	190,000	23.17	4,402,300.00	
SIGNATURE BANK	12,700	207.12	2,630,424.00	
SVB FINANCIAL GROUP	11,900	476.45	5,669,755.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	270,000	52.01	14,042,700.00	
US BANCORP	287,000	49.30	14,149,100.00	
WEBSTER FINANCIAL CORP	37,000	50.18	1,856,660.00	
WELLS FARGO CO	771,300	46.06	35,526,078.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	81,700	60.73	4,961,641.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	261,200	306.65	80,096,980.00	
EQUITABLE HOLDINGS INC	79,000	31.50	2,488,500.00	

AFLAC INC	125,300	63.99	8,017,947.00	
ALLEGHANY CORP	2,810	840.41	2,361,552.10	
ALLSTATE CORP	56,500	129.73	7,329,745.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	13,900	135.05	1,877,195.00	
AMERICAN INTL GROUP	163,500	57.29	9,366,915.00	
AON PLC	43,200	301.00	13,003,200.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	75,000	47.51	3,563,250.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	41,900	190.66	7,988,654.00	
ASSURANT INC	11,300	170.23	1,923,599.00	
BROWN & BROWN INC	49,400	68.14	3,366,116.00	
CHUBB LTD	86,700	199.05	17,257,635.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	30,000	105.33	3,159,900.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	5,400	219.32	1,184,328.00	
EVEREST RE GROUP LTD	7,800	277.30	2,162,940.00	
FNF GROUP	54,000	40.82	2,204,280.00	
GLOBE LIFE INC	19,700	103.52	2,039,344.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	65,300	69.69	4,550,757.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	33,200	51.13	1,697,516.00	
LOEWS CORP	41,800	58.80	2,457,840.00	
MARKEL CORP	2,660	1,263.62	3,361,229.20	
MARSH & MCLENNAN COS	102,200	172.93	17,673,446.00	
METLIFE INC	140,700	67.66	9,519,762.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	53,600	78.98	4,233,328.00	
PROGRESSIVE CO	118,900	122.49	14,564,061.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	75,600	105.18	7,951,608.00	
TRAVELERS COS INC/THE	48,900	173.52	8,485,128.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	23,400	219.46	5,135,364.00	
WR BERKLEY CORP	42,600	66.60	2,837,160.00	
ACCENTURE PLC-CL A	127,800	320.78	40,995,684.00	
AFFIRM HOLDINGS INC	42,000	39.91	1,676,220.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	31,300	98.08	3,069,904.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	85,000	260.04	22,103,400.00	
BLOCK INC	104,200	85.88	8,948,696.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	23,200	177.32	4,113,824.00	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	49,300	77.80	3,835,540.00	

COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	106,500	69.94	7,448,610.00	
EPAM SYSTEMS INC	11,700	447.50	5,235,750.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	124,100	103.51	12,845,591.00	
FISERV INC	125,200	110.72	13,862,144.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	15,800	231.82	3,662,756.00	
GARTNER INC	16,800	315.79	5,305,272.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	57,700	136.15	7,855,855.00	
GODADDY INC - CLASS A	34,900	83.38	2,909,962.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	181,900	136.56	24,840,264.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	15,000	210.84	3,162,600.00	
MASTERCARD INC	176,500	359.25	63,407,625.00	
MONGODB INC	13,500	374.42	5,054,670.00	
OKTA INC	30,300	106.02	3,212,406.00	
PAYCHEX INC	65,800	138.31	9,100,798.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	223,900	102.08	22,855,712.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	43,900	167.35	7,346,665.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	45,600	62.50	2,850,000.00	
TWILIO INC - A	34,500	86.76	2,993,220.00	
VERISIGN INC	19,700	204.00	4,018,800.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	335,500	217.14	72,850,470.00	
WESTERN UNION CO	75,000	16.51	1,238,250.00	
WIX.COM LTD	12,200	74.91	913,902.00	
ADOBE INC	95,450	447.56	42,719,602.00	
ANSYS INC	17,900	283.72	5,078,588.00	
APPROVIN CORP-CLASS A	23,000	32.63	750,490.00	
AUTODESK INC.	44,600	233.64	10,420,344.00	
AVALARA INC	17,200	92.00	1,582,400.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	40,000	41.45	1,658,000.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	18,400	154.64	2,845,376.00	
BLACK KNIGHT INC	29,800	67.70	2,017,460.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	56,200	192.63	10,825,806.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	26,800	69.70	1,867,960.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	20,100	125.80	2,528,580.00	
CITRIX SYSTEMS INC	25,800	103.22	2,663,076.00	

COUPA SOFTWARE INC	14,200	73.93	1,049,806.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	40,400	200.41	8,096,564.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	8,300	152.87	1,268,821.00	
DATADOG INC - CLASS A	45,400	113.54	5,154,716.00	
DOCUSIGN INC	38,800	73.77	2,862,276.00	
DROPBOX INC-CLASS A	57,000	24.57	1,400,490.00	
DYNATRACE INC	38,000	42.19	1,603,220.00	
FAIR ISAAC CORP	5,120	501.49	2,567,628.80	
FORTINET INC	137,200	52.94	7,263,368.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	15,800	81.54	1,288,332.00	
HUBSPOT INC	8,900	379.16	3,374,524.00	
INTUIT INC	54,400	488.18	26,556,992.00	
MICROSOFT CORP	1,440,700	292.71	421,707,297.00	
NORTONLIFELOCK INC	119,000	24.21	2,880,990.00	
ORACLE CORPORATION	324,100	79.52	25,772,432.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	330,000	9.74	3,214,200.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	19,740	524.55	10,354,617.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	10,300	396.99	4,088,997.00	
PTC INC	22,000	123.94	2,726,680.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	14,500	50.17	727,465.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	21,400	436.33	9,337,462.00	
SALESFORCE INC	199,240	189.59	37,773,911.60	
SERVICENOW INC	40,300	496.74	20,018,622.00	
SPLUNK INC	32,400	113.33	3,671,892.00	
SYNOPSYS INC	30,700	385.67	11,840,069.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	90,000	73.74	6,636,600.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,600	410.85	3,533,310.00	
UNITY SOFTWARE INC	37,200	53.64	1,995,408.00	
VMWARE INC - CLASS A	43,100	122.64	5,285,784.00	
WORKDAY INC-CLASS A	40,200	177.79	7,147,158.00	
ZENDESK INC	25,300	76.58	1,937,474.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	44,500	109.19	4,858,955.00	
ZSCALER INC	16,400	178.60	2,929,040.00	
ARISTA NETWORKS INC	49,700	129.91	6,456,527.00	
CISCO SYSTEMS	839,900	46.77	39,282,123.00	

F5 INC	12,400	172.95	2,144,580.00	
JUNIPER NETWORKS INC	66,000	29.10	1,920,600.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33,800	256.59	8,672,742.00	
APPLE INC	3,301,200	173.03	571,206,636.00	
DELL TECHNOLOGIES-C	60,000	48.59	2,915,400.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	259,000	14.95	3,872,050.00	
HP INC	214,000	34.50	7,383,000.00	
NETAPP INC	46,100	74.77	3,446,897.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	41,700	81.85	3,413,145.00	
WESTERN DIGITAL CORP	61,800	49.24	3,043,032.00	
AMPHENOL CORP-CL A	120,300	79.57	9,572,271.00	
ARROW ELECTRS INC	13,700	114.67	1,570,979.00	
CDW CORPORATION	27,600	183.55	5,065,980.00	
COGNEX CORP	33,600	48.64	1,634,304.00	
CORNING INC	162,000	37.38	6,055,560.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	36,300	170.63	6,193,869.00	
TE CONNECTIVITY LTD	65,400	137.45	8,989,230.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9,700	405.25	3,930,925.00	
TRIMBLE INC	49,900	71.91	3,588,309.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	10,900	344.91	3,759,519.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	330,648	100.20	33,130,929.60	
ANALOG DEVICES INC	106,300	179.04	19,031,952.00	
APPLIED MATERIALS	179,400	108.49	19,463,106.00	
BROADCOM INC	82,860	551.65	45,709,719.00	
ENPHASE ENERGY INC	27,000	292.94	7,909,380.00	
ENTEGRIS INC	30,600	105.07	3,215,142.00	
INTEL CORP	823,500	36.19	29,802,465.00	
KLA CORP	30,500	380.73	11,612,265.00	
LAM RESEARCH	28,370	510.36	14,478,913.20	
MARVELL TECHNOLOGY INC	169,400	54.35	9,206,890.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	112,900	74.09	8,364,761.00	
MICRON TECHNOLOGY	227,800	63.86	14,547,308.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,800	531.41	4,676,408.00	
NVIDIA CORP	505,740	188.79	95,478,654.60	
NXP SEMICONDUCTORS NV	52,700	185.85	9,794,295.00	

ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	88,300	70.71	6,243,693.00	
QORVO INC	22,500	107.91	2,427,975.00	
QUALCOMM INC	228,000	150.03	34,206,840.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	33,700	111.27	3,749,799.00	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	10,600	311.27	3,299,462.00	
TERADYNE INC	32,000	101.58	3,250,560.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	186,800	183.36	34,251,648.00	
AT & T INC	1,445,000	18.57	26,833,650.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	22.09	684,790.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	23.36	1,495,040.00	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	182,000	11.26	2,049,320.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	849,000	45.80	38,884,200.00	
T-MOBILE US INC	126,900	146.63	18,607,347.00	
ALLIANT ENERGY CORP	51,600	64.06	3,305,496.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	102,000	104.46	10,654,920.00	
CONSTELLATION ENERGY	66,100	81.40	5,380,540.00	
DUKE ENERGY CORP	156,400	112.11	17,534,004.00	
EDISON INTERNATIONAL	75,800	71.81	5,443,198.00	
ENTERGY CORP	41,100	122.22	5,023,242.00	
EVERGY INC	45,600	71.21	3,247,176.00	
EVERSOURCE ENERGY	69,400	93.58	6,494,452.00	
EXELON CORPORATION	197,000	46.69	9,197,930.00	
FIRSTENERGY CORP	110,000	41.02	4,512,200.00	
NEXTERA ENERGY INC	397,000	90.53	35,940,410.00	
NRG ENERGY INC	49,000	42.60	2,087,400.00	
PG&E CORP	292,000	12.39	3,617,880.00	
PPL CORPORATION	149,000	30.91	4,605,590.00	
SOUTHERN CO.	215,500	79.07	17,039,585.00	
XCEL ENERGY INC	109,300	77.01	8,417,193.00	
ATMOS ENERGY CORP	27,900	117.58	3,280,482.00	
UGI CORP	40,000	41.95	1,678,000.00	
AMEREN CORPORATION	52,100	96.02	5,002,642.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	128,000	32.83	4,202,240.00	
CMS ENERGY CORP	59,800	70.26	4,201,548.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	71,200	100.02	7,121,424.00	

DOMINION ENERGY INC	164,900	85.45	14,090,705.00
DTE ENERGY COMPANY	39,500	136.09	5,375,555.00
NISOURCE INC	79,000	31.58	2,494,820.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	102,000	68.79	7,016,580.00
SEMPRA ENERGY	63,300	169.05	10,700,865.00
WEC ENERGY GROUP INC	64,100	107.01	6,859,341.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	36,100	159.50	5,757,950.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	48,000	51.96	2,494,080.00
ALLY FINANCIAL INC	68,000	36.90	2,509,200.00
AMERICAN EXPRESS CO	130,100	165.35	21,512,035.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	83,800	115.46	9,675,548.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	58,000	110.47	6,407,260.00
SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	36.03	3,739,914.00
UPSTART HOLDINGS INC	15,000	36.28	544,200.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	22,300	289.06	6,446,038.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	155,000	45.03	6,979,650.00
BLACKROCK INC	30,650	757.07	23,204,195.50
BLACKSTONE INC	142,500	107.58	15,330,150.00
CARLYLE GROUP INC/THE	38,000	35.78	1,359,640.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	21,200	119.92	2,542,304.00
CME GROUP INC	73,100	205.46	15,019,126.00
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	23,200	90.39	2,097,048.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	7,400	447.69	3,312,906.00
FRANKLIN RESOURCES INC	57,000	28.79	1,641,030.00
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	13,000	40.93	532,090.00
GOLDMAN SACHS GROUP	68,400	354.97	24,279,948.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	114,400	111.06	12,705,264.00
INVESCO LTD	65,000	18.94	1,231,100.00
KKR & CO INC-A	112,100	57.20	6,412,120.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	16,500	229.13	3,780,645.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	7,900	277.52	2,192,408.00
MOODYS CORP	33,400	322.19	10,761,146.00
MORGAN STANLEY	270,200	91.82	24,809,764.00
MSCI INC	16,300	503.62	8,209,006.00
NASDAQ INC	23,700	191.59	4,540,683.00

NORTHERN TRUST CORP	40,400	103.78	4,192,712.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	38,900	110.83	4,311,287.00
S&P GLOBAL INC	71,695	388.77	27,872,865.15
SCHWAB(CHARLES)CORP	294,300	77.18	22,714,074.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	22,500	58.61	1,318,725.00
STATE STREET CORP	72,800	74.48	5,422,144.00
T ROWE PRICE GROUP INC	46,000	132.14	6,078,440.00
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	21,300	74.37	1,584,081.00
AES CORP	136,000	25.06	3,408,160.00
VISTRA CORP	87,000	25.83	2,247,210.00
TELADOC HEALTH INC	34,000	39.45	1,341,300.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	28,500	229.55	6,542,175.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	60,400	132.77	8,019,308.00
AVANTOR INC	125,000	28.18	3,522,500.00
BIO TECHNE CORP	8,000	370.06	2,960,480.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	4,670	533.97	2,493,639.90
CHARLES RIVER LABORATORIES	10,500	228.12	2,395,260.00
DANAHER CORP	137,500	300.48	41,316,000.00
ILLUMINA INC	31,600	219.83	6,946,628.00
IQVIA HOLDINGS INC	38,700	244.71	9,470,277.00
METTLER-TOLEDO INTL	4,530	1,356.10	6,143,133.00
PERKINELMER INC	25,900	156.30	4,048,170.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	79,130	602.11	47,644,964.30
WATERS CORP	12,500	329.20	4,115,000.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	15,300	333.93	5,109,129.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	26,900	98.06	2,637,814.00
CLARIVATE PLC	65,000	13.47	875,550.00
COSTAR GROUP INC	79,800	75.13	5,995,374.00
EQUIFAX INC	24,300	215.99	5,248,557.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	25,900	134.21	3,476,039.00
LEIDOS HOLDINGS INC	27,500	101.22	2,783,550.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	22,200	81.94	1,819,068.00
TRUNSUMION	37,400	83.79	3,133,746.00
VERISK ANALYTICS INC	32,500	204.49	6,645,925.00
CBRE GROUP INC	67,600	87.29	5,900,804.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	4.97	1,093,400.00

ZILLOW GROUP INC - C	33,200	38.25	1,269,900.00	
CABLE ONE INC	1,120	1,394.89	1,562,276.80	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	24,600	482.83	11,877,618.00	
COMCAST CORP-CL A	915,100	40.36	36,933,436.00	
DISH NETWORK CORP-A	51,000	19.47	992,970.00	
FOX CORP-CLASS A	62,000	36.50	2,263,000.00	
FOX CORP-CLASS B	30,000	33.74	1,012,200.00	
INTERPUBRIC GROUP	79,000	30.70	2,425,300.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	27,100	120.32	3,260,672.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	34,000	44.87	1,525,580.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	17,000	44.85	762,450.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	75,000	18.59	1,394,250.00	
OMNICOM GROUP	43,100	73.68	3,175,608.00	
PARAMOUNT GLOBAL	120,000	27.20	3,264,000.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	171,000	6.60	1,128,600.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	158,600	80.92	12,833,912.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	105,000	24.81	2,605,050.00	
DISNEY (WALT) CO	368,300	124.96	46,022,768.00	
ELECTRONIC ARTS	56,500	135.11	7,633,715.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	40,400	69.69	2,815,476.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	33,100	99.04	3,278,224.00	
NETFLIX INC	90,200	245.69	22,161,238.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	73,000	47.76	3,486,480.00	
ROKU INC	24,200	84.12	2,035,704.00	
SEA LTD-ADR	72,300	77.43	5,598,189.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	32,700	136.59	4,466,493.00	
WARNER BROS DISCOVERY INC	455,000	13.69	6,228,950.00	
ALPHABET INC-CL A	1,216,800	121.70	148,084,560.00	
ALPHABET INC-CL C	1,149,300	122.51	140,800,743.00	
IAC INC	15,000	78.46	1,176,900.00	
MATCH GROUP INC	58,300	67.77	3,950,991.00	
META PLATFORMS INC-CLASS A	467,100	179.47	83,830,437.00	
PINTEREST INC- CLASS A	112,000	22.99	2,574,880.00	
SNAP INC-A	225,000	12.61	2,837,250.00	
	164,000	44.40	7,281,600.00	

小計	TWITTER INC				
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	54,000	51.59	2,785,860.00	
	銘柄数：603			7,586,396,872.55 (1,018,928,963,952)	
	組入時価比率：71.9%			74.5%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	133,000	17.97	2,390,010.00	
	CAMECO CORP	79,000	32.78	2,589,620.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	239,600	69.76	16,714,496.00	
	CENOVUS ENERGY INC	282,000	22.76	6,418,320.00	
	ENBRIDGE INC	412,000	55.47	22,853,640.00	
	IMPERIAL OIL	46,000	57.93	2,664,780.00	
	KEYERA CORP	41,000	32.23	1,321,430.00	
	PARKLAND CORP	28,000	34.50	966,000.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	113,000	47.90	5,412,700.00	
	SUNCOR ENERGY INC	287,000	40.85	11,723,950.00	
	TC ENERGY CORP	198,500	64.96	12,894,560.00	
	TOURMALINE OIL CORP	64,500	75.92	4,896,840.00	
	NUTRIEN LTD	111,700	117.43	13,116,931.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	32,000	65.40	2,092,800.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	90,100	58.42	5,263,642.00	
	BARRICK GOLD	358,000	21.65	7,750,700.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	118,000	24.80	2,926,400.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	39,000	170.84	6,662,760.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	122,000	8.80	1,073,600.00	
	KINROSS GOLD CORP	250,000	4.55	1,137,500.00	
	LUNDIN MINING CORP	137,000	7.48	1,024,760.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	43,000	22.57	970,510.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	99,000	44.42	4,397,580.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	89,000	43.43	3,865,270.00	
	WEST FRASER TIMBER	14,200	121.07	1,719,194.00	
	CAE INC	67,000	26.84	1,798,280.00	
	WSP GLOBAL INC	24,300	159.68	3,880,224.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	17,000	106.95	1,818,150.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	38,000	37.99	1,443,620.00	
	RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	21,100	90.90	1,917,990.00	
	AIR CANADA	32,000	19.72	631,040.00	

CANADIAN NATL RAILWAY CO	121,000	164.98	19,962,580.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	189,100	105.59	19,967,069.00	
TFI INTERNATIONAL INC	17,000	137.71	2,341,070.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	58,700	83.17	4,882,079.00	
BRP INC/CA- SUB VOTING	7,400	104.12	770,488.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	42.72	1,580,640.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	59,100	78.08	4,614,528.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	11,500	171.46	1,971,790.00	
DOLLARAMA INC	55,600	82.23	4,571,988.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	170,000	60.11	10,218,700.00	
EMPIRE CO LTD A	32,000	39.89	1,276,480.00	
LOBLAW COMPANIES	33,400	122.38	4,087,492.00	
METRO INC	49,700	72.03	3,579,891.00	
WESTON(GEORGE)LTD	14,100	159.75	2,252,475.00	
SAPUTO INC	50,000	34.43	1,721,500.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	58,000	8.16	473,280.00	
BANK OF MONTREAL	131,900	135.04	17,811,776.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	247,200	81.62	20,176,464.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	180,900	68.30	12,355,470.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	68,400	94.37	6,454,908.00	
ROYAL BANK OF CANADA	286,400	129.26	37,020,064.00	
TORONTO DOMINION BANK	368,600	88.47	32,610,042.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,940	671.89	3,319,136.60	
GREAT-WEST LIFECO INC	57,000	32.79	1,869,030.00	
IA FINANCIAL CORP INC	21,100	72.81	1,536,291.00	
INTACT FINANCIAL CORP	35,900	195.14	7,005,526.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	391,000	24.44	9,556,040.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	116,000	35.55	4,123,800.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	119,000	62.12	7,392,280.00	
CGI INC	44,400	112.10	4,977,240.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	14,000	46.77	654,780.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	229,000	50.84	11,642,360.00	
BLACKBERRY LTD	94,000	9.00	846,000.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4,050	2,206.23	8,935,231.50	

	LIGHTSPEED COMMERCE INC	29,000	28.92	838,680.00	
	OPEN TEXT CORP	56,000	51.68	2,894,080.00	
	BCE INC	14,400	65.57	944,208.00	
	TELUS CORP	98,600	30.31	2,988,566.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	70,300	59.34	4,171,602.00	
	EMERA INC	51,000	61.95	3,159,450.00	
	FORTIS INC	96,600	61.11	5,903,226.00	
	HYDRO ONE LTD	63,000	35.88	2,260,440.00	
	ALTAGAS LTD	60,000	29.14	1,748,400.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	139,000	18.68	2,596,520.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	27,000	40.96	1,105,920.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	287,000	68.16	19,561,920.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	38.35	575,250.00	
	ONEX CORPORATION	13,200	69.72	920,304.00	
	TMX GROUP LTD	11,300	133.20	1,505,160.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	52.86	1,268,640.00	
	NORTHLAND POWER INC	46,000	45.76	2,104,960.00	
	THOMSON REUTERS CORP	34,600	150.00	5,190,000.00	
	FIRSTSERVICE CORP	8,500	177.98	1,512,830.00	
	QUEBECOR INC-CL B	34,000	29.49	1,002,660.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	97,000	35.36	3,429,920.00	
	小計銘柄数：86			492,578,522.10	
				(51,499,084,485)	
	組入時価比率：3.6%			3.8%	
ユーロ	TENARIS SA	101,000	12.88	1,301,385.00	
	ENI SPA	518,000	11.57	5,997,404.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	109,000	10.45	1,139,595.00	
	NESTE OYJ	87,000	50.94	4,431,780.00	
	OMV AG	28,100	41.10	1,154,910.00	
	REPSOL SA	286,000	12.61	3,607,890.00	
	TOTALENERGIES SE	501,900	51.50	25,847,850.00	
	AIR LIQUIDE SA	106,400	136.22	14,493,808.00	
	AKZO NOBEL	36,600	70.62	2,584,692.00	
	ARKEMA	11,600	91.48	1,061,168.00	
	BASF SE	184,000	44.75	8,234,000.00	

COVESTRO AG	38,000	32.98	1,253,240.00
EVONIK INDUSTRIES AG	39,000	21.00	819,000.00
KONINKLIJKE DSM NV	35,900	145.40	5,219,860.00
OCI	21,000	37.00	777,000.00
SOLVAY SA	14,200	87.28	1,239,376.00
SYMRISE AG	27,100	112.40	3,046,040.00
UMICORE	44,000	36.50	1,606,000.00
CRH PLC	155,000	39.09	6,058,950.00
HEIDELBERGCEMENT AG	30,600	51.58	1,578,348.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	51,000	37.51	1,913,010.00
ARCELORMITTAL	119,000	24.87	2,959,530.00
VOESTALPINE AG	24,000	22.16	531,840.00
STORA ENSO OYJ-R	108,000	15.59	1,683,720.00
UPM-KYMMENE OYJ	109,000	33.94	3,699,460.00
AIRBUS SE	120,000	110.54	13,264,800.00
DASSAULT AVIATION SA	5,000	147.00	735,000.00
MTU AERO ENGINES AG	11,000	198.15	2,179,650.00
RHEINMETALL AG	8,400	176.25	1,480,500.00
SAFRAN SA	68,800	112.46	7,737,248.00
THALES SA	22,000	124.55	2,740,100.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	102,000	46.08	4,700,160.00
KINGSPAN GROUP PLC	29,900	62.62	1,872,338.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	49,245	24.50	1,206,502.50
BOUYGUES	46,000	30.79	1,416,340.00
EIFFAGE SA	15,900	93.78	1,491,102.00
FERROVIAL SA	96,091	26.69	2,564,668.79
VINCI	108,000	95.21	10,282,680.00
LEGRAND SA	54,200	80.98	4,389,116.00
PRYSMIAN SPA	54,000	32.55	1,757,700.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	109,900	136.44	14,994,756.00
SIEMENS ENERGY AG	89,000	16.47	1,465,830.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	45,000	17.99	809,775.00
SIEMENS AG	155,500	112.04	17,422,220.00
ALSTOM	61,000	24.03	1,465,830.00
CNH INDUSTRIAL NV	210,000	12.76	2,679,600.00

DAIMLER TRUCK HOLDING AG	91,000	28.67	2,609,425.00	
GEA GROUP AG	29,000	37.71	1,093,590.00	
KION GROUP AG	13,100	45.25	592,775.00	
KNORR-BREMSE AG	15,200	54.30	825,360.00	
KONE OYJ	67,000	41.98	2,812,660.00	
RATIONAL AG	1,050	624.00	655,200.00	
WARTSILA OYJ	101,000	8.90	899,102.00	
BRENTAG SE	31,300	71.02	2,222,926.00	
IMCD NV	11,500	153.90	1,769,850.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	201,000	40.80	8,201,805.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	112,000	6.74	755,664.00	
ADP	6,100	143.85	877,485.00	
AENA SME SA	15,800	130.85	2,067,430.00	
ATLANTIA SPA	98,000	22.85	2,239,300.00	
GETLINK	93,000	19.90	1,850,700.00	
CONTINENTAL AG	23,200	67.22	1,559,504.00	
MICHELIN (CGDE)	139,000	27.18	3,778,715.00	
VALEO SA	45,000	21.08	948,600.00	
BAYER MOTOREN WERK	66,800	79.25	5,293,900.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	12,500	73.85	923,125.00	
FERRARI NV	25,100	208.10	5,223,310.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	162,500	61.22	9,948,250.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	31,900	71.76	2,289,144.00	
RENAULT SA	40,000	30.74	1,229,800.00	
STELLANTIS NV	442,000	14.90	6,585,800.00	
VOLKSWAGEN AG	6,300	200.30	1,261,890.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	37,400	150.60	5,632,440.00	
SEB SA	5,400	79.70	430,380.00	
ADIDAS AG	35,400	173.36	6,136,944.00	
ESSILORLUXOTTICA	57,700	162.50	9,376,250.00	
HERMES INTERNATIONAL	6,370	1,389.50	8,851,115.00	
KERING SA	15,030	564.10	8,478,423.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	56,160	698.90	39,250,224.00	
MONCLER SPA	42,000	49.23	2,067,660.00	
PUMA SE	21,200	69.24	1,467,888.00	

ACCOR SA	32,000	26.91	861,120.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	34,600	128.00	4,428,800.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	20,000	34.52	690,400.00	
SODEXO	18,200	82.54	1,502,228.00	
D'IETEREN GROUP	4,800	167.60	804,480.00	
DELIVERY HERO SE	34,000	52.68	1,791,120.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	32,900	18.17	597,924.60	
PROSUS NV	167,700	64.80	10,866,960.00	
ZALANDO SE	45,000	30.75	1,383,750.00	
INDITEX SA	220,000	25.87	5,691,400.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	130,000	17.29	2,248,350.00	
HELLOFRESH SE	31,800	30.38	966,084.00	
JERONIMO MARTINS	55,000	22.40	1,232,000.00	
KESKO OYJ-B SHS	58,000	22.84	1,324,720.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	213,000	27.76	5,913,945.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	177,200	53.50	9,480,200.00	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	107,000	10.11	1,082,305.00	
HEINEKEN HOLDING NV	22,000	75.50	1,661,000.00	
HEINEKEN NV	52,400	95.12	4,984,288.00	
PERNOD RICARD SA	42,500	194.05	8,247,125.00	
REMY COINTREAU	4,900	189.40	928,060.00	
DANONE	132,500	54.14	7,173,550.00	
JDE PEET'S BV	21,000	31.98	671,580.00	
KERRY GROUP PLC-A	32,700	106.00	3,466,200.00	
HENKEL AG & CO KGAA	20,300	64.15	1,302,245.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	35,700	65.84	2,350,488.00	
BEIERSDORF AG	19,800	102.95	2,038,410.00	
LOREAL-ORD	49,000	362.75	17,774,750.00	
BIOMERIEUX	8,800	101.80	895,840.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	8,600	136.05	1,170,030.00	
DIASORIN ITALIA SPA	4,800	137.60	660,480.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	174,000	19.89	3,461,556.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,100	443.90	2,263,890.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	57,600	51.14	2,945,664.00	
AMPLIFON SPA	24,000	29.11	698,640.00	

FRESENIUS MEDICAL CARE	39,900	37.30	1,488,270.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	84,000	24.91	2,092,440.00	
ARGENX SE	9,700	372.80	3,616,160.00	
GRIFOLS SA	63,000	13.79	869,085.00	
BAYER AG-REG	200,100	54.30	10,865,430.00	
IPSEN	7,300	97.10	708,830.00	
MERCK KGAA	26,400	184.00	4,857,600.00	
ORION OYJ	21,000	46.59	978,390.00	
RECORDATI SPA	19,900	42.30	841,770.00	
SANOFI	230,000	86.59	19,915,700.00	
UCB SA	26,300	73.20	1,925,160.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	82,000	10.66	874,120.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,340,000	4.85	6,508,380.00	
BANCO SANTANDER SA	3,480,000	2.65	9,255,060.00	
BNP PARIBAS	222,500	50.13	11,153,925.00	
CAIXABANK	890,000	3.06	2,731,410.00	
COMMERZBANK AG	215,000	7.15	1,538,110.00	
CREDIT AGRICOLE SA	245,000	10.04	2,460,290.00	
ERSTE GROUP BANK AG	70,000	24.25	1,697,500.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	129,000	12.20	1,573,800.00	
ING GROEP NV	792,000	9.50	7,524,000.00	
INTESA SANPAOLO	3,390,000	1.85	6,287,772.00	
KBC GROEP NV	49,300	52.48	2,587,264.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	124,000	8.71	1,080,536.00	
SOCIETE GENERALE	159,000	23.63	3,757,170.00	
UNICREDIT SPA	428,000	10.03	4,292,840.00	
EURAZEO SE	7,800	65.55	511,290.00	
EXOR NV	22,000	66.46	1,462,120.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	21,400	81.42	1,742,388.00	
SOFINA SA	2,900	225.40	653,660.00	
WENDEL	6,000	86.85	521,100.00	
AEGON NV	370,000	4.83	1,788,210.00	
AGEAS	32,000	43.50	1,392,000.00	
ALLIANZ SE-REG	83,100	179.94	14,953,014.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	219,000	15.36	3,364,935.00	

AXA SA	392,000	24.58	9,637,320.00
HANNOVER RUECK SE	12,000	151.25	1,815,000.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	28,500	239.70	6,831,450.00
NN GROUP NV	59,000	43.17	2,547,030.00
POSTE ITALIANE SPA	103,000	8.46	871,792.00
SAMPO OYJ-A SHS	99,000	45.09	4,463,910.00
ADYEN NV	4,360	1,788.40	7,797,424.00
AMADEUS IT GROUP SA	92,500	56.62	5,237,350.00
BECHTLE AG	15,700	42.89	673,373.00
CAPGEMINI SA	33,300	188.25	6,268,725.00
EDENRED	50,000	52.20	2,610,000.00
NEXI SPA	104,000	9.19	955,760.00
WORLDLINE SA	49,000	44.02	2,156,980.00
DASSAULT SYSTEMES SE	136,000	42.75	5,814,000.00
NEMETSCHEK SE	11,000	68.94	758,340.00
SAP SE	210,500	92.57	19,485,985.00
NOKIA OYJ	1,110,000	5.06	5,626,590.00
ASM INTERNATIONAL NV	9,700	300.90	2,918,730.00
ASML HOLDING NV	82,220	557.50	45,837,650.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	267,000	27.50	7,342,500.00
STMICROELECTRONICS NV	140,000	37.57	5,259,800.00
CELLNEX TELECOM SA	111,000	42.74	4,744,140.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	660,000	19.11	12,613,920.00
ELISA OYJ	28,400	53.18	1,510,312.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	72,000	10.09	726,480.00
KONINKLIJKE KPN NV	660,000	3.23	2,131,800.00
ORANGE SA	397,000	10.29	4,087,512.00
PROXIMUS	26,000	13.59	353,340.00
TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.23	447,374.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.67	561,750.00
TELEFONICA SA	1,093,000	4.34	4,753,457.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	24.87	417,816.00
ACCIONA S.A.	4,800	207.20	994,560.00
ELECTRICITE DE FRANCE	113,000	11.91	1,345,830.00
ELIA GROUP SA/NV	6,626	156.90	1,039,619.40

ENDESA S.A.	65,000	18.44	1,198,600.00
ENEL SPA	1,631,000	5.10	8,321,362.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	554,000	5.12	2,839,804.00
FORTUM OYJ	89,000	12.08	1,075,120.00
IBERDROLA SA	1,212,000	10.94	13,265,340.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	79,000	19.50	1,540,895.00
TERNA SPA	275,000	7.49	2,060,300.00
VERBUND AG	14,500	110.10	1,596,450.00
ENAGAS SA	48,000	19.63	942,480.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	32,000	28.99	927,680.00
SNAM SPA	420,000	5.12	2,151,240.00
E.ON SE	443,000	9.50	4,212,044.00
ENGIE	370,000	12.97	4,801,120.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	133,000	25.17	3,347,610.00
AMUNDI SA	12,800	56.55	723,840.00
DEUTSCHE BANK AG-REG	427,000	8.96	3,827,628.00
DEUTSCHE BOERSE AG	38,200	168.20	6,425,240.00
EURONEXT NV	18,000	78.04	1,404,720.00
EDP RENOVAVEIS SA	58,000	26.42	1,532,360.00
RWE AG	130,000	43.52	5,657,600.00
UNIPER SE	15,100	7.75	117,025.00
EUROFINS SCIENTIFIC SE	27,700	76.36	2,115,172.00
QIAGEN N.V.	47,900	47.69	2,284,351.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	5,500	390.90	2,149,950.00
BUREAU VERITAS SA	61,000	26.88	1,639,680.00
RANDSTAD NV	25,500	49.57	1,264,035.00
TELEPERFORMANCE	11,900	310.40	3,693,760.00
WOLTERS KLUWER	53,000	104.40	5,533,200.00
AROUNDTOWN SA	206,000	3.36	692,160.00
LEG IMMOBILIE SE	14,000	87.00	1,218,000.00
VONOVIA SE	139,000	31.65	4,399,350.00
PUBLICIS GROUPE	46,900	51.84	2,431,296.00
VIVENDI SE	145,000	9.33	1,352,850.00
BOLLORE SE	168,000	4.85	815,808.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	45.27	783,171.00

小計	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	143,000	21.40	3,060,200.00	
	SCOUT24 SE	15,200	57.26	870,352.00	
小計	銘柄数：223			883,441,130.29	
				(120,633,886,341)	
英ポンド	組入時価比率：8.5%			8.8%	
	BP PLC	3,930,000	4.26	16,761,450.00	
英ポンド	SHELL PLC-NEW	1,539,000	21.68	33,373,215.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	28,700	72.70	2,086,490.00	
英ポンド	JOHNSON MATTHEY PLC	40,000	22.80	912,000.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	255,000	30.02	7,656,375.00	
英ポンド	ANTOFAGASTA PLC	79,000	11.64	919,955.00	
	GLENCORE PLC	2,001,000	4.82	9,662,829.00	
英ポンド	RIO TINTO PLC-REG	228,600	49.18	11,242,548.00	
	MONDI PLC	101,000	16.27	1,643,775.00	
英ポンド	BAE SYSTEMS PLC	639,000	7.99	5,108,166.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,680,000	0.85	1,443,120.00	
英ポンド	DCC PLC	21,200	53.30	1,129,960.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	870,000	1.53	1,333,275.00	
英ポンド	SMITHS GROUP PLC	80,000	15.75	1,260,400.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	15,500	112.70	1,746,850.00	
英ポンド	ASHTED GROUP PLC	91,000	46.10	4,195,100.00	
	BUNZLE	66,000	31.48	2,077,680.00	
英ポンド	FERGUSON PLC	44,900	103.80	4,660,620.00	
	RENTOKIL INTIAL PLC	373,000	5.39	2,011,962.00	
英ポンド	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	207,000	4.82	997,740.00	
	PERSIMMON PLC	64,000	18.49	1,183,360.00	
英ポンド	TAYLOR WIMPEY PLC	710,000	1.22	872,590.00	
	THE BERKELEY GRP HOLDINGS	24,300	40.82	991,926.00	
英ポンド	BURBERRY GROUP PLC	82,000	18.06	1,481,330.00	
	COMPASS GROUP PLC	362,000	19.56	7,082,530.00	
英ポンド	ENTAIN PLC	121,000	14.06	1,701,865.00	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	38,600	51.06	1,970,916.00	
英ポンド	WHITBREAD PLC	41,000	26.66	1,093,060.00	
	NEXT PLC	26,000	65.64	1,706,640.00	
英ポンド	JD SPORTS FASHION PLC	465,000	1.30	604,500.00	

KINGFISHER PLC	390,000	2.55	995,280.00	
OCADO GROUP PLC	122,000	9.31	1,136,796.00	
SAINSBURY	340,000	2.23	760,580.00	
TESCO PLC	1,540,000	2.67	4,125,660.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	39,000	20.38	794,820.00	
DIAGEO PLC	470,000	38.48	18,085,600.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	68,000	16.58	1,127,780.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	439,000	34.06	14,954,535.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	180,000	19.03	3,425,400.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	144,500	65.58	9,476,310.00	
HALEON PLC	1,021,000	2.69	2,747,511.00	
UNILEVER PLC	518,000	39.21	20,313,370.00	
SMITH & NEPHEW PLC	182,000	10.60	1,929,200.00	
NMC HEALTH PLC	13,300	0.00	6.65	
ASTRAZENECA PLC	313,380	109.68	34,371,518.40	
GSK PLC	827,000	14.25	11,784,750.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	37,000	15.50	573,500.00	
BARCLAYS PLC	3,410,000	1.70	5,814,050.00	
HSBC HOLDINGS PLC	4,097,000	5.49	22,525,306.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,400,000	0.45	6,585,120.00	
NATWEST GROUP PLC	1,120,000	2.61	2,923,200.00	
STANDARD CHARTERED PLC	534,000	6.03	3,220,020.00	
M&G PLC	500,000	2.17	1,086,000.00	
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	22.88	800,800.00	
AVIVA PLC	568,000	4.60	2,613,368.00	
LEGAL & GENERAL	1,210,000	2.83	3,435,190.00	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	144,000	6.77	975,456.00	
PRUDENTIAL PLC	552,000	9.89	5,459,280.00	
AVEVA GROUP PLC	26,000	24.26	630,760.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	197,000	7.38	1,454,254.00	
HALMA PLC	76,000	22.76	1,729,760.00	
BT GROUP PLC	1,390,000	1.60	2,234,425.00	
VODAFONE GROUP PLC	5,410,000	1.23	6,666,202.00	
SSE PLC	212,000	18.30	3,880,660.00	
NATIONAL GRID PLC	731,000	11.68	8,538,080.00	

	SEVERN TRENT PLC	53,000	30.03	1,591,590.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	135,000	11.34	1,531,575.00	
	3I GROUP PLC	202,000	12.53	2,532,070.00	
	ABRDN PLC	420,000	1.72	724,500.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	9.72	631,800.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	66,900	83.72	5,600,868.00	
	SCHRODERS PLC	24,000	29.88	717,120.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	104,000	12.49	1,298,960.00	
	EXPERIAN PLC	186,000	28.92	5,379,120.00	
	INTERTEK GROUP PLC	31,000	42.46	1,316,260.00	
	RELX PLC	394,000	23.84	9,392,960.00	
	INFORMA PLC	300,000	5.95	1,787,400.00	
	PEARSON	143,000	8.78	1,255,826.00	
	WPP PLC	235,000	8.33	1,958,020.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	195,000	6.58	1,283,100.00	
小計	銘柄数：80			373,087,944.05	
				(60,671,561,461)	
	組入時価比率：4.3%			4.4%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	18.57	761,370.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,370	737.50	1,010,375.00	
	GIVAUDAN-REG	1,860	3,352.00	6,234,720.00	
	SIKA AG-REG	29,800	243.40	7,253,320.00	
	HOLCIM LTD	114,000	46.25	5,272,500.00	
	GEBERIT AG-REG	7,290	500.80	3,650,832.00	
	ABB LTD	333,000	29.00	9,657,000.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	4,900	175.40	859,460.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,500	180.45	1,533,825.00	
	VAT GROUP AG	5,300	264.20	1,400,260.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	10,900	240.50	2,621,450.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	105,500	112.05	11,821,275.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	5,500	240.80	1,324,400.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	44.64	468,720.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	710	2,082.00	1,478,220.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	212	10,580.00	2,242,960.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	22	108,300.00	2,382,600.00	
		569,400	115.22	65,606,268.00	

	NESTLE SA-REG				
	ALCON INC	101,400	65.52	6,643,728.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	10,900	283.70	3,092,330.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	22,100	120.00	2,652,000.00	
	NOVARTIS AG-REG	443,200	80.98	35,890,336.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	142,100	315.65	44,853,865.00	
	ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,400	385.00	2,079,000.00	
	BALOISE HOLDING AG	8,600	156.40	1,345,040.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	6,430	523.60	3,366,748.00	
	SWISS RE LTD	60,000	75.86	4,551,600.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	30,600	433.80	13,274,280.00	
	TEMENOS AG-REG	13,700	80.34	1,100,658.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	34,200	55.14	1,885,788.00	
	SWISSCOM AG-REG	5,290	510.00	2,697,900.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	540,000	5.43	2,932,200.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	46,300	51.08	2,365,004.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,640	1,015.00	4,709,600.00	
	UBS GROUP AG	717,000	16.07	11,525,775.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	5,500	67.00	368,500.00	
	LONZA AG-REG	15,090	558.40	8,426,256.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	33,000	33.69	1,111,770.00	
	SGS SA-REG	1,270	2,236.00	2,839,720.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	15,300	88.35	1,351,755.00	
	小計銘柄数：40			284,643,408.00	
				(40,259,963,627)	
	組入時価比率：2.8%			2.9%	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	53,000	354.35	18,780,550.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	19,000	438.10	8,323,900.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	123,000	155.60	19,138,800.00	
	ASSA ABLOY AB-B	200,000	235.90	47,180,000.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	298,000	100.45	29,934,100.00	
	SKANSKA AB-B SHS	66,000	172.40	11,378,400.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	33,000	243.30	8,028,900.00	
	LIFCO AB-B SHS	52,000	187.85	9,768,200.00	
	ALFA LAVAL AB	63,000	307.30	19,359,900.00	

ATLAS COPCO AB-A SHS	542,000	117.28	63,565,760.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	314,000	105.48	33,120,720.00	
EPIROC AB - A	129,000	178.85	23,071,650.00	
EPIROC AB - B	79,000	161.95	12,794,050.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	94,000	79.14	7,439,160.00	
INDUTRADE AB	55,000	239.90	13,194,500.00	
SANDVIK AB	216,000	185.55	40,078,800.00	
SKF AB-B SHARES	78,000	169.00	13,182,000.00	
VOLVO AB-A SHS	40,000	191.10	7,644,000.00	
VOLVO AB-B SHS	308,000	184.20	56,733,600.00	
SECURITAS AB-B SHS	54,000	102.75	5,548,500.00	
VOLVO CAR AB-B	120,000	76.23	9,147,600.00	
ELECTROLUX AB-B	41,000	153.20	6,281,200.00	
EVOLUTION AB	36,300	962.50	34,938,750.00	
HENNES&MAURITZ AB-B	146,000	133.68	19,517,280.00	
SWEDISH MATCH AB	325,000	106.80	34,710,000.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	124,000	262.00	32,488,000.00	
GETINGE AB-B SHS	45,000	224.80	10,116,000.00	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,000	232.60	8,373,600.00	
NORDEA BANK ABP	673,000	104.30	70,193,900.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	331,000	114.90	38,031,900.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	301,000	93.46	28,131,460.00	
SWEDBANK AB	186,000	143.40	26,672,400.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	262.10	6,314,513.20	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	32,000	259.20	8,294,400.00	
INVESTOR AB-A SHS	105,000	200.60	21,063,000.00	
INVESTOR AB-B SHS	367,000	186.66	68,504,220.00	
KINNEVIK AB - B	44,000	181.00	7,964,000.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	15,500	472.70	7,326,850.00	
SINCH AB	92,000	23.30	2,144,060.00	
ERICSSON LM-B	590,000	79.70	47,023,000.00	
HEXAGON AB-B SHS	394,000	121.30	47,792,200.00	
TELIA CO AB	530,000	37.81	20,039,300.00	
TELE 2 AB-B SHS	116,000	115.80	13,432,800.00	
EQT AB	59,000	272.60	16,083,400.00	

小計	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	141,000	66.11	9,321,510.00	
	SAGAX AB-B	40,000	254.80	10,192,000.00	
	EMBRACER GROUP AB	134,000	76.00	10,184,000.00	
	銘柄数：47			1,062,546,833.20	
				(13,813,108,831)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	64,986	323.00	20,990,478.00	
	EQUINOR ASA	200,000	366.50	73,300,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33,100	423.30	14,011,230.00	
	NORSK HYDRO	266,000	65.98	17,550,680.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	17,000	361.00	6,137,000.00	
	MOWI ASA	84,000	214.70	18,034,800.00	
	ORKLA ASA	153,000	83.44	12,766,320.00	
	SALMAR ASA	11,400	672.00	7,660,800.00	
	DNB BANK ASA	186,000	197.95	36,818,700.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40,000	204.60	8,184,000.00	
	TELENOR ASA	146,000	114.15	16,665,900.00	
	ADEVINTA ASA	63,000	79.75	5,024,250.00	
	銘柄数：12			237,144,158.00	
				(3,291,560,913)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	20,400	475.90	9,708,360.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	40,200	452.30	18,182,460.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,700	1,882.00	3,199,400.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	201,000	189.58	38,105,580.00	
	DSV A/S	39,300	1,223.00	48,063,900.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	620	19,980.00	12,387,600.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,090	20,210.00	22,028,900.00	
	PANDORA A/S	20,000	501.20	10,024,000.00	
	CARLSBERG B	20,600	959.80	19,771,880.00	
	COLOPLAST-B	24,300	828.60	20,134,980.00	
	DEMANT A/S	20,100	243.40	4,892,340.00	
	GN STORE NORD A/S	24,100	236.90	5,709,290.00	
	GENMAB A/S	13,300	2,649.00	35,231,700.00	

小計	NOVO NORDISK A/S-B	340,600	769.80	262,193,880.00	
	DANSKE BANK AS	132,000	103.45	13,655,400.00	
豪ドル	TRYG A/S	76,000	170.10	12,927,600.00	
	ORSTED A/S	38,700	802.00	31,037,400.00	
	銘柄数：17			567,254,670.00	
	組入時価比率：0.7%			(10,414,795,741)	0.8%
豪ドル	AMPOL LTD	49,000	33.37	1,635,130.00	
	SANTOS LTD.	638,000	7.08	4,517,040.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	48,000	26.02	1,248,960.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	382,000	32.04	12,239,280.00	
	ORICA LTD	79,000	15.66	1,237,140.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	92,000	36.35	3,344,200.00	
	BHP GROUP LIMITED	1,024,000	40.51	41,482,240.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	104,000	17.10	1,778,400.00	
	EVOLUTION MINING LTD	340,000	2.68	911,200.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	343,000	19.43	6,664,490.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	34,000	60.57	2,059,380.00	
	NEWCREST MINING	175,000	19.08	3,339,000.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	222,000	8.11	1,800,420.00	
	RIO TINTO LTD	75,700	95.93	7,261,901.00	
	SOUTH32 LTD	930,000	4.08	3,794,400.00	
	REECE LTD	49,000	15.79	773,710.00	
	BRAMBLES LTD	295,000	11.80	3,481,000.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	4.77	810,900.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	380,000	3.99	1,516,200.00	
	TRANSURBAN GROUP	618,000	14.62	9,035,160.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	119,000	36.32	4,322,080.00	
	DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	13,600	72.04	979,744.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	480,000	4.51	2,164,800.00	
	WESFARMERS LIMITED	230,000	47.90	11,017,000.00	
	COLES GROUP LTD	274,000	18.97	5,197,780.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	284,000	8.16	2,317,440.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	246,000	38.61	9,498,060.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	156,000	12.57	1,960,920.00	

	COCHLEAR LTD	12,800	218.31	2,794,368.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	36,500	72.98	2,663,770.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	90,000	34.24	3,081,600.00	
	CSL LIMITED	97,100	296.40	28,780,440.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	610,000	23.83	14,536,300.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	345,200	101.46	35,023,992.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	658,000	31.04	20,424,320.00	
	WESTPAC BANKING CORP	714,000	22.34	15,950,760.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	480,000	4.58	2,198,400.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	590,000	3.51	2,070,900.00	
	QBE INSURANCE	290,000	12.00	3,480,000.00	
	SUNCORP GROUP LTD	245,000	11.09	2,717,050.00	
	COMPUTERSHARE LTD	113,000	23.69	2,676,970.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	28,000	54.14	1,515,920.00	
	XERO LIMITED	28,300	96.76	2,738,308.00	
	TELSTRA CORP LTD	850,000	4.10	3,485,000.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	370,000	6.04	2,234,800.00	
	APA GROUP	229,000	11.92	2,729,680.00	
	ASX LTD	37,800	84.24	3,184,272.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	73,200	182.75	13,377,300.00	
	IDP EDUCATION LTD	46,000	27.77	1,277,420.00	
	REA GROUP LTD	10,400	132.81	1,381,224.00	
	SEEK LTD	70,000	23.12	1,618,400.00	
	小計 銘柄数：51			316,329,169.00	
				(29,814,024,178)	
	組入時価比率：2.1%			2.2%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	270,000	7.70	2,079,000.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	109,000	21.48	2,341,320.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	380,000	5.14	1,953,200.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	6.33	867,210.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	250,000	5.29	1,322,500.00	
	小計 銘柄数：5			8,563,230.00	
				(729,415,931)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	

香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	15.40	5,082,000.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	550,040	52.55	28,904,602.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	276,000	95.70	26,413,200.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	280,000	24.60	6,888,000.00	
	MTR CORP	307,000	41.80	12,832,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	441,000	47.00	20,727,000.00	
	SANDS CHINA LTD	512,000	17.54	8,980,480.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	410,000	15.88	6,510,800.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	350,000	22.55	7,892,500.00	
	WH GROUP LIMITED	1,759,806	5.43	9,555,746.58	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	720,000	27.60	19,872,000.00	
	HANG SENG BANK	150,000	126.80	19,020,000.00	
	AIA GROUP LTD	2,447,000	76.70	187,684,900.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	719,600	11.04	7,944,384.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	134,000	50.10	6,713,400.00	
	CLP HLDGS	339,000	67.55	22,899,450.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	277,000	50.20	13,905,400.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,220,383	8.25	18,318,159.75	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	245,000	346.60	84,917,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	409,040	54.00	22,088,160.00	
	ESR GROUP LTD	380,000	19.86	7,546,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	360,000	13.28	4,780,800.00	
	HENDERSON LAND	310,443	27.90	8,661,359.70	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	309,916	26.50	8,212,774.00	
	SINO LAND CO.LTD	730,000	11.92	8,701,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	295,000	95.75	28,246,250.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	53.60	5,574,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	18.92	4,351,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	350,000	37.40	13,090,000.00	
	小計	銘柄数：29		626,315,366.03 (10,728,782,220)	
		組入時価比率：0.8%		0.8%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	310,000	3.96	1,227,600.00	

有価証券分報告書（内国役員信託）	小計	KEPPEL CORP.	280,000	6.94	1,943,200.00	
		SINGAPORE AIRLINES LTD	280,000	5.42	1,517,600.00	
		GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.80	904,000.00	
		WILMAR INTERNATIONAL LTD	380,000	4.09	1,554,200.00	
		DBS GROUP HLDGS	367,000	32.31	11,857,770.00	
		OCBC-ORD	694,000	12.18	8,452,920.00	
		UNITED OVERSEAS BANK	239,000	26.88	6,424,320.00	
		VENTURE CORP LTD	58,000	18.24	1,057,920.00	
		SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,710,000	2.71	4,634,100.00	
		SINGAPORE EXCHANGE LTD	173,000	9.89	1,710,970.00	
		CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	530,000	3.92	2,077,600.00	
		CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	8.67	606,900.00	
		UOL GROUP LIMITED	87,000	7.48	650,760.00	
		銘柄数：14			44,619,860.00	
					(4,347,312,959)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%		
	新シエケル	ICL GROUP LTD	139,000	32.89	4,571,710.00	
		ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	726.90	3,634,500.00	
		BANK HAPOLIM BM	254,000	33.89	8,608,060.00	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	315,000	35.04	11,037,600.00	
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	251,000	20.43	5,127,930.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	33,000	132.20	4,362,600.00	
		NICE LTD	12,900	739.90	9,544,710.00	
		TOWER SEMICONDUCTOR LTD	22,000	155.40	3,418,800.00	
		AZRIELI GROUP	8,600	299.00	2,571,400.00	
		銘柄数：9			52,877,310.00	
					(2,180,290,123)	
		組入時価比率：0.2%			0.2%	
合計				1,367,312,750,762		
				(1,367,312,750,762)		

(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8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	31,000	5,318,980.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	61,000	2,356,430.00	
		AMERICAN TOWER CORP	92,200	25,673,090.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	361,000	2,451,190.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,500	6,248,340.00	
		BOSTON PROPERTIES	30,700	2,757,781.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,800	2,904,858.00	
		CROWN CASTLE INC	87,900	16,025,049.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	57,100	7,681,663.00	
		DUKE REALTY CORP	77,500	5,019,675.00	
		EQUINIX INC	18,470	13,151,378.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,600	2,649,668.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	72,800	5,836,376.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,400	3,999,498.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	27,100	5,765,254.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	76,000	2,020,080.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	106,000	2,994,500.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	147,000	2,869,440.00	
		INVITATION HOMES INC	124,000	4,936,440.00	
		IRON MOUNTAIN INC	57,700	3,123,878.00	
		KIMCO REALTY CORP	123,000	2,918,790.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	119,000	1,977,780.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,600	4,450,016.00	
		PROLOGIS INC	150,300	20,607,633.00	
		PUBLIC STORAGE	31,600	11,161,752.00	
		REALTY INCOME CORP	118,700	8,748,190.00	
		REGENCY CENTERS CORP	31,900	2,123,902.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	21,900	7,621,857.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	67,200	7,695,744.00	
		SUN COMMUNITIES INC	23,800	4,072,180.00	
		UDR INC	64,000	3,224,960.00	
		VENTAS INC	81,700	4,134,837.00	
		VICI PROPERTIES INC	194,000	6,842,380.00	

小計	VORNADO REALTY TRUST	32,000	972,160.00	
	WELLTOWER INC	90,700	7,315,862.00	
	WEYERHAEUSER CO	152,000	5,637,680.00	
	WP CAREY INC	38,800	3,427,204.00	
	銘柄数：37	2,887,970	226,716,495.80	
	組入時価比率：2.1%		(30,450,292,550)	86.9%
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	711,624.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	602,000.00	
	銘柄数：2	42,900	1,313,624.00	
	組入時価比率：0.0%		(137,339,389)	0.4%
ユーロ	COVIVIO	8,100	499,365.00	
	GECINA SA	9,600	950,400.00	
	KLEPIERRE	40,000	908,800.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,900	1,436,390.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,000	980,200.00	
	銘柄数：5	110,600	4,775,155.00	
英ポンド	BRITISH LAND	183,000	876,570.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	152,000	1,108,080.00	
	SEGRO PLC	245,000	2,614,150.00	
	銘柄数：3	580,000	4,598,800.00	
	組入時価比率：0.1%		(747,856,856)	2.1%
豪ドル	DEXUS/AU	219,000	2,006,040.00	
	GOODMAN GROUP	346,000	7,110,300.00	
	GPT GROUP	380,000	1,675,800.00	
	LENDLEASE GROUP	135,000	1,401,300.00	
	MIRVAC GROUP	750,000	1,635,000.00	
	SCENTRE GROUP	1,010,000	2,858,300.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	460,000	1,748,000.00	
	VICINITY CENTRES	800,000	1,640,000.00	
	銘柄数：8	4,100,000	20,074,740.00	
小計			(1,892,044,245)	

		組入時価比率：0.1%		5.4%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		470,000	3,285,300.00	
	LINK REIT		437,000	28,361,300.00	
小計	銘柄数：2		907,000	31,646,600.00	
				(542,106,258)	
		組入時価比率：0.0%		1.5%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		710,040	2,115,919.20	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		1,044,221	2,192,864.10	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		710,029	1,285,152.49	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST		490,000	935,900.00	
小計	銘柄数：4		2,954,290	6,529,835.79	
				(636,201,901)	
		組入時価比率：0.0%		1.8%	
合計				35,057,888,614	
				(35,057,888,614)	

(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 8月17日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	13,251,100,165	—	14,299,188,587	1,048,088,422
合計	13,251,100,165	—	14,299,188,587	1,048,088,422

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,204,362,501
コール・ローン	2,972,736,728
国債証券	666,901,735,720
派生商品評価勘定	12,619,175
未収利息	5,123,655,261
前払費用	364,490,233
その他未収収益	13,153,726
流動資産合計	677,592,753,344
資産合計	677,592,753,344
負債の部	
流動負債	
未払金	2,606,385,562
未払解約金	535,950,979
未払利息	1,172
その他未払費用	5,503,645
流動負債合計	3,147,841,358
負債合計	3,147,841,358
純資産の部	
元本等	
元本	258,191,349,921
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	416,253,562,065
元本等合計	674,444,911,986
純資産合計	674,444,911,986
負債純資産合計	677,592,753,344

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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.6122円
(10,000口当たり純資産額)	(26,122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	
	252,295,022,957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	265,103,632,837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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、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 8月17日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 8月17日現在

期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	248,128,706,565円
同期中における追加設定元本額	23,021,271,009円
同期中における一部解約元本額	12,958,627,653円
期末元本額	258,191,349,921円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	79,874,344円
バランスセレクト50	81,065,712円
バランスセレクト70	80,432,977円
野村外国債券インデックスファンド	271,800,524円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,513,574,018円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	22,971,012,539円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,966,456,575円
野村資産設計ファンド2015	21,501,058円
野村資産設計ファンド2020	23,125,349円
野村資産設計ファンド2025	37,833,501円
野村資産設計ファンド2030	48,265,481円
野村資産設計ファンド2035	36,424,031円
野村資産設計ファンド2040	60,690,675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）	73,582,409,955円
のむラップ・ファンド（保守型）	6,571,461,627円
のむラップ・ファンド（普通型）	23,716,098,207円
のむラップ・ファンド（積極型）	6,599,473,856円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	605,249,120円
野村資産設計ファンド2045	10,648,183円
野村インデックスファンド・外国債券	980,001,218円
マイ・ロード	8,572,066,174円
ネクストコア	111,799,633円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	308,404,828円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	8,101,588,009円

野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,518,752,304円
野村資産設計ファンド2050	10,339,683円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,644,196円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,731,099円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,759,707円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,424,784円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	897,148,043円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	1,054,504,792円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	3,924,339円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,724,158円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	12,139,634円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,664,627円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	12,982,548円
野村6資産均等バランス	2,541,332,838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）	6,253,452,279円
世界6資産分散ファンド	66,823,196円
野村資産設計ファンド2060	5,218,052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	10,973,944,334円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	8,024,534,534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）	6,248,707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）	1,040,209,621円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	173,892,661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）	1,026,952,766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）	455,356,881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）	2,125,524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）	7,889,737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）	227,355円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,669,919,517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）	5,671,722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）	29,727,428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）	7,628,045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）	162,559,689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）	142,896,727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）	1,855,054,843円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	69,076,761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）	789,320,808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）	759,474,904円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	5,733,670円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,490,154円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,430,990円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	5,916,055円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	604,424,515円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	5,335,908,368円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	6,698,001,918円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	5,224,860,368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）	21,666,914,815円

マイバランスDC30	2,022,607,445円
マイバランスDC50	1,566,056,308円
マイバランスDC70	1,157,972,615円
野村DC外国債券インデックスファンド	8,714,249,456円
野村DC運用戦略ファンド	3,681,386,962円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	503,738,396円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	293,240,108円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	589,321,558円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	268,514,402円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	21,207,750円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	49,825,299円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	23,169,191円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	16,310,235円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	11,556,619円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	6,120,676円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	195,520,569円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	116,790,016円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	66,027,953円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	86,120,069円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	2,893,213円
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	24,741,064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）	58,424,969円
みらいバランス・株式10（富士通企業年金基金DC向け）	216,240,656円
野村DCバランスファンド（年金運用戦略タイプ）	97,102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8月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	30,000,000.00	30,916,404.00	
		US TREASURY BOND	56,700,000.00	55,769,762.79	
		US TREASURY BOND	66,600,000.00	72,864,562.50	
		US TREASURY BOND	17,600,000.00	20,246,874.56	
		US TREASURY BOND	129,400,000.00	146,090,568.42	

US TREASURY BOND	100,000.00	118,585.93	
US TREASURY BOND	2,300,000.00	2,123,906.25	
US TREASURY BOND	1,200,000.00	1,269,656.16	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,044,175.51	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,974,023.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,136.71	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,390,538.94	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,007.81	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,697,327.58	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	995,273.40	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,453,242.15	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,507.80	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	34,497,372.80	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,406.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,296.86	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,781.24	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,397,937.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	995,781.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,875.00	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	42,303,793.68	
US TREASURY N/B	300,000.00	288,984.36	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,067,030.56	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	29,146,632.08	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,093.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,929.68	
US TREASURY N/B	45,900,000.00	45,268,875.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	792,874.96	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,218.74	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,435,546.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,881,249.60	
US TREASURY N/B	15,800,000.00	15,628,421.48	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,250.00	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,183,500.00	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,622,968.75	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,179,843.72	

US TREASURY N/B	400,000.00	394,781.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,390.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,382.81	
US TREASURY N/B	50,850,000.00	49,952,177.14	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,410.15	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,375.00	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,644,312.50	
US TREASURY N/B	700,000.00	688,515.59	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,678,816.30	
US TREASURY N/B	72,000,000.00	71,055,000.00	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,199,569.27	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,374,750.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,132.79	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,726.56	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,303,132.37	
US TREASURY N/B	500,000.00	486,679.65	
US TREASURY N/B	300,000.00	298,652.34	
US TREASURY N/B	300,000.00	284,250.00	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,210,304.58	
US TREASURY N/B	500,000.00	486,093.75	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,031.24	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,984.36	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,057,117.16	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,320.31	
US TREASURY N/B	47,600,000.00	46,532,717.56	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,061,585.91	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,562.50	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,351,250.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	481,679.65	
US TREASURY N/B	57,850,000.00	56,661,361.83	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,250.00	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,244,296.76	
US TREASURY N/B	500,000.00	480,820.30	
US TREASURY N/B	200,000.00	190,031.24	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,857,992.14	

US TREASURY N/B	100,000.00	96,601.56	
US TREASURY N/B	200,000.00	190,296.86	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	982,812.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	286,640.61	
US TREASURY N/B	25,100,000.00	24,364,647.81	
US TREASURY N/B	200,000.00	191,718.74	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,878,179.64	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	16,410,671.01	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,359.37	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	27,299,646.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,156.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,449.21	
US TREASURY N/B	48,800,000.00	48,346,311.28	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,648.43	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	7,818,562.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,746.09	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	990,625.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	184,265.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,062.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,962,734.30	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,734.36	
US TREASURY N/B	300,000.00	298,277.34	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,152,468.36	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,484.36	
US TREASURY N/B	35,150,000.00	33,949,954.39	
US TREASURY N/B	700,000.00	691,250.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,046.86	
US TREASURY N/B	42,750,000.00	42,549,609.37	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,687.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,523.43	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,203.12	
US TREASURY N/B	51,300,000.00	49,857,187.50	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,913,281.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,640.62	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,842,187.00	

US TREASURY N/B	200,000.00	182,265.62	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,328,304.48	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,980.46	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,901,015.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	978,984.30	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,253.90	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,854,101.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,898.42	
US TREASURY N/B	42,300,000.00	41,235,888.51	
US TREASURY N/B	300,000.00	275,402.34	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,706,484.24	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,968.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	274,863.27	
US TREASURY N/B	800,000.00	765,468.72	
US TREASURY N/B	300,000.00	275,964.84	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,881,624.64	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,906.25	
US TREASURY N/B	42,350,000.00	39,856,974.08	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,230,311.60	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,261.71	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	13,700,233.65	
US TREASURY N/B	300,000.00	274,781.25	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,287,624.72	
US TREASURY N/B	300,000.00	277,335.93	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	13,701,745.20	
US TREASURY N/B	81,000,000.00	76,472,221.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	464,394.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,875.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	185,554.68	
US TREASURY N/B	200,000.00	187,476.56	
US TREASURY N/B	36,950,000.00	35,744,794.46	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,289,476.44	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,281.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	269,601.54	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,921.87	

US TREASURY N/B	17,000,000.00	15,151,913.00	
US TREASURY N/B	37,350,000.00	36,973,579.23	
US TREASURY N/B	67,500,000.00	65,617,377.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	622,972.63	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,515.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	266,320.29	
US TREASURY N/B	300,000.00	303,820.29	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,179.68	
US TREASURY N/B	31,200,000.00	30,142,123.44	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,492.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,695.31	
US TREASURY N/B	300,000.00	264,398.43	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	964,531.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	265,710.93	
US TREASURY N/B	500,000.00	441,816.40	
US TREASURY N/B	500,000.00	444,257.80	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	27,377,552.61	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,675.78	
US TREASURY N/B	500,000.00	455,703.10	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,906.25	
US TREASURY N/B	53,600,000.00	53,290,122.32	
US TREASURY N/B	500,000.00	454,296.85	
US TREASURY N/B	16,400,000.00	14,879,155.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,292.96	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,130,420.96	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,855.46	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,433.59	
US TREASURY N/B	300,000.00	272,988.27	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,211,296.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,613.28	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,042.96	
US TREASURY N/B	200,000.00	186,171.86	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,079,761.65	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,385,546.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,562.50	

US TREASURY N/B	100,000.00	99,589.84	
US TREASURY N/B	21,700,000.00	20,977,795.79	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,075,882.76	
US TREASURY N/B	300,000.00	306,281.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	277,101.54	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,956,609.27	
US TREASURY N/B	600,000.00	516,445.26	
US TREASURY N/B	11,700,000.00	10,665,281.25	
US TREASURY N/B	48,100,000.00	59,354,644.83	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	14,086,655.42	
US TREASURY N/B	100,000.00	84,429.68	
US TREASURY N/B	155,050,000.00	184,303,562.59	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	875,859.30	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,980.46	
US TREASURY N/B	22,900,000.00	20,093,854.61	
US TREASURY N/B	32,850,000.00	29,002,956.21	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,528,671.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,378.90	
US TREASURY N/B	20,350,000.00	24,305,531.25	
US TREASURY N/B	8,650,000.00	10,878,050.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	120,257.81	
US TREASURY N/B	800,000.00	853,124.96	
US TREASURY N/B	100,000.00	116,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	119,828.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	117,656.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	121,187.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	117,343.75	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,341,726.42	
US TREASURY N/B	100,000.00	109,812.50	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,471,640.52	
US TREASURY N/B	100,000.00	114,960.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	72,843.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	368,015.61	
US TREASURY N/B	200,000.00	159,156.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	116,625.00	

US TREASURY N/B	200,000.00	169,343.74	
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,919,843.52	
US TREASURY N/B	200,000.00	154,359.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,546.87	
US TREASURY N/B	200,000.00	161,359.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,257.81	
US TREASURY N/B	200,000.00	172,000.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,125.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	495,000.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,218.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,843.75	
US TREASURY N/B	290,000.00	279,057.02	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,960.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,757.81	
US TREASURY N/B	8,900,000.00	8,877,054.02	
US TREASURY N/B	39,950,000.00	38,199,063.41	
US TREASURY N/B	42,200,000.00	39,476,779.14	
US TREASURY N/B	43,700,000.00	37,363,500.00	
US TREASURY N/B	24,400,000.00	22,804,466.92	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	16,005,662.75	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,995,249.92	
US TREASURY N/B	49,700,000.00	42,462,437.50	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	24,066,937.50	
US TREASURY N/B	34,500,000.00	27,985,427.10	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	13,009,639.56	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,876,406.20	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,596,140.54	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	10,238,625.00	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	8,363,460.24	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	8,990,116.95	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	4,960,148.31	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	9,985,663.80	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	6,242,491.73	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,372,357.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,929.68	

小計	US TREASURY N/B	11,250,000.00	9,307,616.62	
	US TREASURY N/B	300,000.00	255,187.50	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	781,796.80	
	US TREASURY N/B	21,900,000.00	14,031,397.89	
	US TREASURY N/B	13,100,000.00	8,674,656.25	
	US TREASURY N/B	7,900,000.00	5,592,335.74	
	US TREASURY N/B	20,300,000.00	15,332,843.75	
	US TREASURY N/B	65,650,000.00	55,869,174.14	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	777,187.50	
	US TREASURY N/B	100,000.00	75,343.75	
	US TREASURY N/B	100,000.00	82,609.37	
	US TREASURY N/B	100,000.00	95,128.90	
	銘柄数：262	2,564,810,000.00	2,518,992,313.93	
			(338,325,857,683)	
	組入時価比率：50.2%		50.8%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	3,070,000.00	3,023,259.25	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	491,876.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	8,086,069.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	32,742,160.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	95,676.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,611,455.30	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	99,420.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	317,357.95	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	284,115.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	15,300,000.00	14,162,904.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	93,014.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	183,282.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	298,053.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	764,528.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	15,030,000.00	17,774,462.97	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	967,951.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	289,907.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	447,614.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,950,000.00	5,366,435.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	89,689.60	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	93,482.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	16,900,000.00	21,443,243.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,240,000.00	2,802,914.24	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	581,170.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	10,425,070.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,272,516.70	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	10,028,419.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	231,564.90	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	874,388.70	
	銘柄数：29	134,040,000.00	136,942,003.91	
			(14,317,286,508)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	78,500,000.00	76,950,410.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	66,316,146.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	119,000,000.00	108,457,397.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	886,250.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,800,000.00	106,386,115.80	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	77,379,425.75	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	85,600,000.00	81,791,228.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	378,028.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	60,168,877.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	38,800,000.00	38,347,378.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	62,409,820.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	54,000,000.00	50,707,879.20	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	64,800,000.00	63,549,360.00	
	銘柄数：13	816,700,000.00	793,728,316.25	
			(5,355,046,831)	
	組入時価比率：0.8%		0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	900,000.00	896,940.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,145,600.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	997,021.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,703,529.20	
	BELGIUM KINGDOM	7,800,000.00	8,820,575.40	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,316,813.50	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	1,984,076.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	985,244.00	

BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	6,378,385.00	
BELGIUM KINGDOM	11,400,000.00	11,040,330.00	
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,321,826.20	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	96,790.00	
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,119,966.00	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	98,829.50	
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,613,080.50	
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	5,106,464.00	
BELGIUM KINGDOM	5,750,000.00	5,080,918.50	
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,403,839.70	
BELGIUM KINGDOM	3,600,000.00	3,603,153.60	
BELGIUM KINGDOM	2,200,000.00	2,158,365.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	14,341,201.50	
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	14,252,049.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,750,000.00	14,563,353.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,600,000.00	14,294,280.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,700,000.00	6,989,446.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,137,989.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,650,000.00	21,807,628.95	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,600,000.00	6,851,367.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,090,210.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000.00	41,093,964.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	804,844.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	100,920.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	97,690.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,300,000.00	11,394,920.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,797,365.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,003,250.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,500,000.00	17,687,825.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	99,409.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	94,940.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,050,130.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	5,510,700.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	954,088.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	2,578,461.50	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	5,610,935.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000,000.00	15,820,959.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	3,373,200.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	10,607,362.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,200,000.00	5,830,416.80	
BUNDES OblIGATION	2,600,000.00	2,570,256.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	612,912.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,600,000.00	2,650,154.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,100,000.00	5,150,337.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,697,840.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,200,000.00	11,344,816.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	20,358,180.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	977,300.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	688,968.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,700,000.00	27,718,495.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	198,406.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	24,300,244.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	593,232.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	13,158,004.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	97,127.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	96,893.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,300,000.00	24,082,984.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	25,950,000.00	35,756,505.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,800,000.00	25,269,378.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,050,000.00	22,083,195.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	97,134.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	5,416,089.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	4,384,814.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,542,534.75	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	6,492,402.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	14,831,856.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	24,200,000.00	24,334,068.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,700,000.00	14,987,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	25,000,000.00	26,250,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	302,946.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,214,718.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,600,000.00	6,905,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	6,384,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,021,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,036,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	33,200,000.00	36,005,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	796,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,466,417.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	400,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	97,995.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,750,000.00	11,972,075.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,013,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	95,173.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,600,000.00	20,268,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	98,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,007,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	26,600,000.00	32,303,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	96,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	94,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	199,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	197,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	35,000,000.00	42,381,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	196,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,000,000.00	16,891,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	817,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	36,800,000.00	43,258,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	105,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	910,879.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,000,000.00	24,838,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	804,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	82,530.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	94,530.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,800,000.00	12,161,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,313,340.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	26,349,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,000,000.00	15,175,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	89,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	7,936,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	492,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	484,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	5,479,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	192,340.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	13,830,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	10,601,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,410,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,877,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	8,317,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	6,541,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	3,490,801.50	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	718,053.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	3,940,740.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	100,446.90	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,977,002.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,613,876.20	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,284,860.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,238,909.10	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	189,404.00	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	3,222,260.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	447,028.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	917,786.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	99,153.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,900,000.00	4,012,879.65	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,762,348.68	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	12,888,677.10	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,774,735.38	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	12,925,219.30	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,011,360.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	6,776,738.40	
FRANCE (GOVT OF)	15,100,000.00	14,770,820.00	

FRANCE (GOVT OF)	3,300,000.00	3,161,175.60	
FRANCE (GOVT OF)	11,400,000.00	12,501,365.40	
FRANCE (GOVT OF)	15,000,000.00	14,290,155.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	93,220.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	98,400.80	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	10,404,514.80	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,751,842.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	351,196.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,159,275.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	100,000.00	104,432.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,700,000.00	5,829,859.11	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,050,000.00	11,690,625.31	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,031,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	291,147.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	36,400,000.00	39,854,360.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,200,000.00	8,915,450.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,000,000.00	43,504,768.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,100,000.00	13,309,180.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,650,000.00	34,583,383.05	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	36,200,000.00	48,691,534.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	387,934.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,350,000.00	7,427,495.95	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,450,000.00	29,698,485.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,650,000.00	10,841,381.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,540,000.00	19,674,784.44	
IRISH GOVERNMENT	6,130,000.00	6,845,432.30	
IRISH GOVERNMENT	6,900,000.00	6,808,706.10	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	595,688.40	
IRISH TSY 1.3% 2033	5,100,000.00	4,935,273.06	
IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	3,302,574.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,600,000.00	2,253,760.60	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	3,059,111.00	
IRISH TSY 1% 2026	10,800,000.00	10,854,183.60	
IRISH TSY 2.4% 2030	7,500,000.00	8,140,485.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	1,588,196.80	

小計	IRISH TSY 3.4% 2024	12,800,000.00	13,363,968.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	99,560.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,300,000.00	3,391,766.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,484,250.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,879,195.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,486,822.50	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	15,331,950.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	988,050.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	758,838.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	11,750,000.00	13,098,982.25	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,050,000.00	8,002,135.35	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	421,094.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	5,871,637.10	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	9,600,000.00	11,982,499.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	795,280.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	152,219.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,284,738.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	715,751.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,900,000.00	1,927,259.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,900,000.00	9,038,390.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,995,001.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	9,594,354.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	11,600,000.00	11,109,900.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	9,550,000.00	10,334,763.61	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	519,944.80	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	5,425,138.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	6,496,700.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,498,474.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,405,354.00	
	SPANISH GOVERNMENT	32,300,000.00	41,318,483.00	
	SPANISH GOVERNMENT	28,950,000.00	38,926,170.00	
	SPANISH GOVERNMENT	7,750,000.00	9,547,116.50	
	銘柄数：215	1,469,750,000.00	1,686,607,286.44	
			(230,306,224,963)	
	組入時価比率：34.1%		34.6%	

英債券	UK TREASURY	350,000.00	349,819.40	
	UK TREASURY	300,000.00	290,865.00	
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,275,560.00	
	UK TREASURY	3,550,000.00	3,596,482.28	
	UK TREASURY	16,370,000.00	17,564,381.39	
	UK TREASURY	200,000.00	192,930.00	
	UK TREASURY	800,000.00	800,672.00	
	UK TREASURY	8,110,000.00	7,955,841.87	
	UK TREASURY	500,000.00	466,369.50	
	UK TREASURY	400,000.00	386,441.60	
	UK TREASURY	12,250,000.00	13,606,863.90	
	UK TREASURY	200,000.00	196,269.20	
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,220,065.00	
	UK TREASURY	200,000.00	181,433.30	
	UK TREASURY	200,000.00	185,064.00	
	UK TREASURY	6,650,000.00	8,035,062.00	
	UK TREASURY	9,610,000.00	11,403,514.30	
	UK TREASURY	17,350,000.00	21,277,679.12	
	UK TREASURY	750,000.00	598,447.50	
	UK TREASURY	8,980,000.00	10,852,150.40	
	UK TREASURY	100,000.00	130,026.00	
	UK TREASURY	350,000.00	432,088.86	
	UK TREASURY	500,000.00	622,704.00	
	UK TREASURY	320,000.00	416,823.80	
	UK TREASURY	18,440,000.00	21,215,515.04	
	UK TREASURY	5,900,000.00	7,645,208.20	
	UK TREASURY	8,200,000.00	6,594,768.00	
	UK TREASURY	16,100,000.00	13,659,690.80	
	UK TREASURY	5,350,000.00	7,108,127.70	
	UK TREASURY	1,100,000.00	814,006.60	
	UK TREASURY	6,750,000.00	8,486,100.00	
	UK TREASURY	1,400,000.00	1,133,466.32	
	UK TREASURY	700,000.00	584,822.00	
	UK TREASURY	9,300,000.00	12,813,726.00	
	UK TREASURY	100,000.00	103,213.00	

小計	UK TREASURY	200,000.00	260,649.84	
	UK TSY 3 1/4% 2044	6,100,000.00	6,747,893.20	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	7,170,000.00	10,012,655.48	
	銘柄数：38	182,800,000.00	206,217,396.60	
	組入時価比率：5.0%		(33,535,073,035)	5.0%
スウェーデン ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	9,200,000.00	9,182,690.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	37,055,190.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	15,625,481.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,300,000.00	16,626,177.11	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	18,023,542.74	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,100,000.00	11,748,636.75	
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	27,974,791.65	
	銘柄数：7	132,150,000.00	136,236,510.05	
	組入時価比率：0.3%		(1,771,074,630)	0.3%
ノルウェー クロネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,800,000.00	22,775,658.72	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,102,200.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	6,751,411.30	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	9,724,680.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	9,008,020.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	28,000,000.00	26,098,856.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	6,635,550.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,570,900.00	
	銘柄数：8	104,400,000.00	99,667,276.42	
	組入時価比率：0.2%		(1,383,381,796)	0.2%
デンマーク クロネ	KINGDOM OF DENMARK	870,000.00	880,362.57	
	KINGDOM OF DENMARK	22,200,000.00	22,810,500.00	
	KINGDOM OF DENMARK	18,400,000.00	17,900,660.80	
	KINGDOM OF DENMARK	37,250,000.00	35,462,000.00	
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	54,848,512.35	
	KINGDOM OF DENMARK	3,500,000.00	2,384,725.00	
	銘柄数：6	120,320,000.00	134,286,760.72	
	組入時価比率：0.4%		(2,465,504,926)	0.4%

ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	38,800,000.00	35,674,660.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,300,000.00	6,424,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	51,853,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,183,350.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000.00	2,244,400.00	
	銘柄数：5	111,800,000.00	98,379,910.00	
	組入時価比率：0.4%		(2,880,612,954)	0.4%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,499,000.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	7,763,396.41	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,680,000.00	18,451,686.03	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,697,330.93	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,182,650.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	294,085.14	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,713,895.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,300,000.00	9,028,440.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	21,192,530.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	4,789,299.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	2,868,103.26	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	245,820.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	501,468.42	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	2,699,032.67	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,950,000.00	12,177,349.36	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	292,096.44	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,450,000.00	2,292,826.13	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	8,530,358.92	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	668,290.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,326,261.15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,060,460.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	1,973,700.00	
	銘柄数：22	113,730,000.00	111,248,081.24	
	組入時価比率：1.6%		(10,485,131,656)	1.6%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,437,351.79	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,318,837.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,096,151.98	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,480,200.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	474,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,850,000.00	6,085,521.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	501,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	304,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,150,000.00	5,234,975.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	3,170,720.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,920,000.00	1,808,275.20	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,950,000.00	1,912,170.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,846,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,690,500.00	
	銘柄数：14	29,500,000.00	29,362,401.97 (2,860,778,823)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	407,718.08	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,716,035.92	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,614,584.96	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	424,834.76	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,220,405.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,519,752.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,920,445.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,440,411.92	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	16,600,000.00	17,084,374.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,625,675.82	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,921,313.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,179,798.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	279,018.62	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	15,940,312.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,500,613.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	9,578,868.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	11,151,315.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,380,776.07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	10,872,975.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	318,171.69	
	銘柄数：20	111,880,000.00	114,097,403.24	
小計				

			(3,432,859,981)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	141,900,000.00	142,945,505.01	
	CHINA GOVERNMENT BOND	144,100,000.00	144,385,159.49	
	CHINA GOVERNMENT BOND	14,400,000.00	14,411,702.88	
	CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	90,688,255.70	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,010,230.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	84,800,000.00	85,159,976.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	70,000,000.00	71,426,103.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	60,694,656.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,170,018.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,829,950.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,317,100.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,112,574.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	31,500,000.00	31,859,109.45	
	CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,385,775.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	36,000,000.00	38,325,780.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	34,000,000.00	34,983,110.00	
小計	銘柄数：16	847,200,000.00	858,705,004.53	
			(16,990,251,349)	
	組入時価比率：2.5%		2.5%	
新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,967,575.50	
	ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,358,219.04	
	ISRAEL FIXED BOND	12,200,000.00	12,012,988.64	
	ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	7,503,226.25	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,914,418.00	
	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,975,061.50	
	ISRAEL FIXED BOND	8,500,000.00	7,679,680.30	
	ISRAEL FIXED BOND	5,900,000.00	4,924,697.55	
	ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	8,167,586.40	
	ISRAEL FIXED BOND	5,700,000.00	6,225,079.44	
小計	銘柄数：10	66,000,000.00	67,728,532.62	
			(2,792,650,585)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
合計			666,901,735,720	
			(666,901,735,720)	

(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 8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	5,325,000	
		US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	170,000	
		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	14,875,000	
		US TREASURY N/B	5,500,000	
		US TREASURY N/B	8,925,000	
		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	4,200,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY N/B	12,000,000	
		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	20,000,000	
		US TREASURY N/B	11,000,000	
		US TREASURY N/B	23,000,000	
		US TREASURY N/B	11,800,000	
		US TREASURY N/B	255,000	
		US TREASURY N/B	170,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		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	170,000	
US TREASURY N/B	655,000	
US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	935,000	
US TREASURY N/B	29,000,000	
US TREASURY N/B	9,000,000	
US TREASURY N/B	8,597,000	
US TREASURY N/B	8,400,000	
US TREASURY N/B	19,000,000	
US TREASURY N/B	9,945,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	50,000,000	
US TREASURY N/B	325,000	
US TREASURY N/B	12,000,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	19,000,000	
US TREASURY N/B	12,750,000	
US TREASURY N/B	11,050,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	5,950,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	1,020,000	
US TREASURY N/B	37,000,000	
US TREASURY N/B	30,000,000	
US TREASURY N/B	1,445,000	
US TREASURY N/B	7,395,000	
US TREASURY N/B	24,500,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
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	5,200,000	
US TREASURY N/B	2,000,000	
US TREASURY N/B	1,000,000	
US TREASURY BOND	17,000,000	
US TREASURY BOND	577,000	
US TREASURY BOND	25,000,000	
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	24,000,000	
US TREASURY N/B	37,000,000	
US TREASURY N/B	1,445,000	
US TREASURY N/B	680,000	
US TREASURY N/B	12,750,000	

	US TREASURY N/B	22,000,000	
	US TREASURY N/B	578,000	
	US TREASURY N/B	23,000,000	
	US TREASURY N/B	36,000,000	
	US TREASURY N/B	19,000,000	
	US TREASURY N/B	11,000,000	
	US TREASURY N/B	850,000	
	US TREASURY N/B	85,000	
	US TREASURY N/B	14,000,000	
	US TREASURY N/B	1,560,000	
	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	
	US TREASURY N/B	15,000,000	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,600,000	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,900,000	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,500,000	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,000,000	
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	153,000	
	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	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	550,000	
	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	
	ISRAEL FIXED BOND	8,000,000	
	ISRAEL FIXED BOND	100,000	
	ISRAEL FIXED BOND	5,270,000	
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,240,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000	
	BUNDESOBLIGATION	1,700,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000	

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,450,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,275,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,160,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,930,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	680,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,375,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,500,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	685,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,410,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,900,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,235,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,000,000	
	FRANCE (GOVT OF)	8,058,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000	
	BELGIUM KINGDOM	3,400,000	
	BELGIUM KINGDOM	6,600,000	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	9,770,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,610,000	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,500,000	
	SPANISH GOVERNMENT	1,845,000	
	SPANISH GOVERNMENT	20,000,000	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,600,000	
	FINNISH GOVERNMENT	1,700,000	
	IRISH TSY 1% 2026	6,375,000	
	IRISH TSY 2.4% 2030	6,000,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000	
	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 8月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,380,500,805	—	2,393,119,980	12,619,175
米ドル	1,242,375,425	—	1,248,943,880	6,568,455
ユーロ	842,929,344	—	846,601,180	3,671,836
英ポンド	177,137,330	—	178,867,920	1,730,590

人民元	118,058,706	—	118,707,000	648,294
合計	2,380,500,805	—	2,393,119,980	12,619,175

(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。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,624,089,872
コール・ローン	114,373,867
株式	70,150,685,106
投資信託受益証券	3,149,361,319
投資証券	84,549,802
派生商品評価勘定	80,778,167
未収入金	964,354
未収配当金	319,960,312
差入委託証拠金	879,792,692
流動資産合計	77,404,555,491
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,672,160
未払解約金	29,134,973
未払利息	45
その他未払費用	2,148,900
流動負債合計	32,956,078
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	48,371,789,879
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	28,999,809,534
元本等合計	77,371,599,413
純資産合計	

(2022年 8月17日現在)

負債純資産合計

77,404,555,491

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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.5995円
(10,000口当たり純資産額)	(15,995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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、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 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（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 8月17日現在	
期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	44,775,261,155円
同期中における追加設定元本額	5,983,971,704円
同期中における一部解約元本額	2,387,442,980円
期末元本額	48,371,789,879円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド２０１５	19,733,690円
野村資産設計ファンド２０２０	21,239,192円
野村資産設計ファンド２０２５	34,379,135円
野村資産設計ファンド２０３０	53,010,850円
野村資産設計ファンド２０３５	47,462,210円
野村資産設計ファンド２０４０	88,857,091円
野村資産設計ファンド２０４５	18,086,404円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,669,897,380円
ネクストコア	2,441,227円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	519,264,770円
野村資産設計ファンド２０５０	22,141,592円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	6,217,781円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	3,678,344円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	2,911,779円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	2,566,202円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,035,862円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	933,626円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	7,556,138円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,734,122円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	11,831,241円
野村つみたて外国株投信	4,664,172,319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）	1,072,930,468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）	1,948,691,390円
世界６資産分散ファンド	112,511,061円
野村資産設計ファンド２０６０	16,658,588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	1,307,117,029円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,523,001,126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）	4,281,876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）	455,009,827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）	803,944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）	32,532,865,243円
野村DC運用戦略ファンド	76,113,848円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	5,458,820円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０３０	17,909,773円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０４０	16,919,972円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０５０	13,106,907円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０６０	9,236,547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）	59,022,505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8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	20,300	10.61	215,383.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL CO LTD	85,000	1.58	134,555.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	7,000	0.00	0.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	456,300	0.00	0.00	
		PJSC LUKOIL	32,050	0.00	0.00	
		ROSNEFT OJSC - GDR	83,900	0.00	0.00	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	103,000	0.00	0.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	19,100	0.00	0.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	12,100	0.00	0.00	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	11,579	105.70	1,223,900.30	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	21,600	5.96	128,736.00	
		NOVOLIPETSK STEEL PJSC	103,000	0.00	0.00	
		PJSC ALROSA	176,000	0.00	0.00	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	48,600	0.00	0.00	
		POLYUS PJSC-REG S-GDR	4,710	0.00	0.00	

SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	0.00	0.00	
SOUTHERN COPPER CORP	6,300	49.32	310,716.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	34,600	26.85	929,010.00	
LI AUTO INC - ADR	45,600	31.09	1,417,704.00	
NIO INC ADR	109,600	20.91	2,291,736.00	
XPENG INC ADR	35,300	22.91	808,723.00	
H WORLD GROUP LTD-ADR	15,900	39.99	635,841.00	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	45,200	26.56	1,200,512.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	35,500	48.00	1,704,000.00	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	5,300	0.00	0.00	
PINDUODUO INC ADR	36,600	49.34	1,805,844.00	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	41,400	9.96	412,344.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	31,300	0.00	0.00	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	11,500	0.00	0.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	7,100	11.21	79,591.00	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	56,300	1.52	85,576.00	
BEIGENE, LTD ADR	3,830	188.25	720,997.50	
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	4,500	45.95	206,775.00	
ZAI LAB LTD - ADR	7,090	45.56	323,020.40	
HUTCHMED CHINA-ADR	7,800	13.65	106,470.00	
BANCO DE CHILE-ADR	18,100	19.70	356,570.00	
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	16.71	230,598.00	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	10,030	32.43	325,272.90	
CREDICORP LTD	6,350	138.29	878,141.50	
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	811,000	0.00	0.00	
STATE BANK OF INDIA-GDR	14,890	66.10	984,229.00	
TCS GROUP HOLDING-REG S	9,300	0.00	0.00	
VTB BANK JSC	175,780,000	0.00	0.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	37,700	3.45	130,065.00	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,800	68.25	327,600.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	28,650	0.00	0.00	
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	1.63	69,927.00	
INTER RAO UES PJSC	3,660,000	0.00	0.00	
360 DIGITECH INC-ADR	6,000	14.81	88,860.00	
LUFAX HOLDING LTD	67,100	3.94	264,374.00	

	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	133,000	0.00	0.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	29,730	4.50	133,785.00	
	KE HOLDINGS INC ADR	27,600	15.93	439,668.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.86	76,078.46	
	IQIYI INC-ADR	21,400	4.04	86,456.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	59,400	4.79	284,526.00	
	AUTOHOME INC-ADR	7,500	35.46	265,950.00	
	JOYY INC	4,250	28.21	119,892.50	
	KANZHUN LTD	8,400	21.60	181,440.00	
	VK CO LTD GDR	7,000	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	4,500	19.26	86,670.00	
	YANDEX NV-A	23,640	0.00	0.00	
小計	銘柄数：62			20,071,537.56 (2,695,808,209)	
	組入時価比率：3.5%			3.8%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	93,958	42.06	3,951,873.48	
	CEMEX SAB - CPO	1,234,985	9.10	11,238,363.50	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	254,983	79.54	20,281,347.82	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	188.55	1,585,705.50	
	ALFA S.A.B. -A	218,000	14.31	3,119,580.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	79.71	2,781,879.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,900	440.96	8,334,144.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	30,400	303.07	9,213,328.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,400	148.56	2,436,384.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	441,000	71.96	31,734,360.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,000	142.75	6,281,000.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	52,000	125.69	6,535,880.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	170,300	131.55	22,402,965.00	
	GRUMA S.A.B. -B	15,600	233.33	3,639,948.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	107,000	74.77	8,000,390.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	110,000	28.59	3,144,900.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	213,200	123.86	26,406,952.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	169,000	36.72	6,205,680.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,351,000	19.59	46,056,090.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	201,000	29.66	5,961,660.00	

小計	銘柄数：20			229,312,430.30	
				(1,547,102,173)	
	組入時価比率：2.0%			2.2%	
リアル	COSAN SA	99,000	21.00	2,079,000.00	
	PETRO RIO SA	65,300	24.32	1,588,096.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	302,000	35.16	10,618,320.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	397,000	32.01	12,707,970.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	13.73	659,040.00	
	BRASKEM SA-PREF A	13,200	34.30	452,760.00	
	KLABIN SA-UNIT	61,000	20.30	1,238,300.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	16.00	739,200.00	
	GERDAU SA PFD NPV	95,000	24.43	2,320,850.00	
	VALE SA	333,652	69.95	23,338,957.40	
	SUZANO SA	62,960	49.91	3,142,333.60	
	WEG SA	134,748	30.59	4,121,941.32	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,660	63.00	3,884,580.00	
	RUMO SA	96,000	19.71	1,892,160.00	
	CCR SA	121,000	14.30	1,730,300.00	
	AMERICANAS SA	60,039	15.17	910,791.63	
	LOJAS RENNER S.A.	80,974	28.06	2,272,130.44	
	MAGAZINE LUIZA SA	230,000	4.15	954,500.00	
	VIBRA ENERGIA SA	83,600	18.74	1,566,664.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	54,000	20.08	1,084,320.00	
	RAIA DROGASIL SA	102,000	22.53	2,298,060.00	
	AMBEV SA	389,956	15.50	6,044,318.00	
	BRF SA	63,000	17.62	1,110,060.00	
	JBS SA	74,600	31.52	2,351,392.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	62,500	14.68	917,500.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	420,987	7.84	3,300,538.08	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	29,800	37.45	1,116,010.00	
	HYPERA SA	33,000	41.94	1,384,020.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	122,153	16.30	1,991,093.90	
	BANCO BRADESCO SA - PREF	435,042	19.71	8,574,677.82	
	BANCO DO BRASIL SA	72,800	43.20	3,144,960.00	
	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	29.96	731,024.00	

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	414,991	27.24	11,304,354.84	
	ITAUSA SA	378,017	9.49	3,587,381.33	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	67,000	30.49	2,042,830.00	
	TOTVS SA	40,000	29.59	1,183,600.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	41,605	45.28	1,883,874.40	
	TIM SA	82,952	12.54	1,040,218.08	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	49.99	899,820.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	93,800	48.44	4,543,672.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	135,987	12.35	1,679,439.45	
	CPFL ENERGIA SA	18,400	34.84	641,056.00	
	ENERGISA SA-UNITS	20,800	46.92	975,936.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	91,000	24.97	2,272,270.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	33,600	44.45	1,493,520.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	499,999	13.12	6,559,986.88	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	90,000	26.29	2,366,100.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,600	43.08	715,128.00	
小計	銘柄数：48			153,455,055.17	
				(4,003,841,880)	
	組入時価比率：5.2%			5.7%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	7,450.00	192,955,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	119,000	1,685.00	200,515,000.00	
	CIA SUD AMERICANA VAPORES	1,226,200	96.30	118,083,060.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	1,997.00	100,249,400.00	
	CENCOSUD SA	126,000	1,193.80	150,418,800.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	5,800	27,700.00	160,660,000.00	
	ENEL AMERICAS SA	1,495,000	97.50	145,762,500.00	
小計	銘柄数：7			1,068,643,760.00	
				(162,806,808)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	39,600.00	629,640,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	21,000.00	709,800,000.00	
小計	銘柄数：2			1,339,440,000.00	
				(42,369,166)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	8,000	16.24	129,920.00	

	FF GROUP	2,030	0.00	0.00	
	OPAP SA	20,200	13.64	275,528.00	
	JUMBO SA	6,732	15.25	102,663.00	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	206,500	0.98	202,659.10	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	180,800	0.98	177,907.20	
	NATIONAL BANK OF GREECE	43,700	3.40	148,580.00	
	HELLENIC TELECOM	18,000	16.83	302,940.00	
	PUBLIC POWER CORP	20,000	6.17	123,400.00	
小計	銘柄数：9			1,463,597.30 (199,854,211)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	12,700	299.90	3,808,730.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	27.76	3,220,160.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	24.04	996,698.40	
	KOC HLDGS	53,000	43.08	2,283,240.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	88,000	23.90	2,103,200.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	44,000	67.85	2,985,400.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	6,200	338.50	2,098,700.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	45,000	110.60	4,977,000.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	10.58	2,168,900.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	81,000	24.26	1,965,060.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	203,995	6.18	1,260,689.10	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	117,000	17.06	1,996,020.00	
小計	銘柄数：12			29,863,797.50 (223,781,380)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	640.00	3,232,000.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	82.50	3,465,000.00	
	CEZ AS	12,500	1,090.00	13,625,000.00	
小計	銘柄数：3			20,322,000.00 (113,124,445)	
	組入時価比率：0.1%			0.2%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	37,500	2,916.00	109,350,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	11,700	8,055.00	94,243,500.00	
	OTP BANK NYRT	18,300	9,212.00	168,579,600.00	

小計	銘柄数：3			372,173,100.00	
				(125,938,910)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	25,900	69.70	1,805,230.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	175,000	6.40	1,121,400.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	13,800	112.80	1,556,640.00	
	LPP SA	94	9,735.00	915,090.00	
	ALLEGRO.EU SA	29,400	29.45	865,830.00	
	DINO POLSKA SA	3,820	382.00	1,459,240.00	
	BANK PEKAO SA	15,700	73.64	1,156,148.00	
	MBANK	1,100	258.20	284,020.00	
	PKO BANK POLSKI SA	71,400	25.37	1,811,418.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,100	248.80	771,280.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,500	30.54	1,542,270.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	6.46	253,222.20	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	73,000	9.62	702,698.00	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	20.88	394,632.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,960	92.55	459,048.00	
小計	銘柄数：15			15,098,166.20	
				(442,081,855)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	130,000	7.32	951,600.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	150,000	6.38	957,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,080,900	3.56	7,408,004.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	283,000	22.80	6,452,400.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	129,000	3.53	455,370.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,700,000	3.32	5,644,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	138,000	27.35	3,774,300.00	
	DONGYUE GROUP LTD	108,000	8.58	926,640.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	107,000	31.35	3,354,450.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	309,000	7.89	2,438,010.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	176,000	4.95	871,200.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280,000	2.81	786,800.00	

CHINA HONGQIAO GROUP LTD	160,000	7.93	1,268,800.00	
CMOC GROUP LTD-H	240,000	3.83	919,200.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD	31,640	73.05	2,311,302.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	9.94	974,120.00	
MMG LTD	312,000	2.37	739,440.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	60,000	13.54	812,400.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	94,000	7.46	701,240.00	
ZIJIN MINING GROUP CO-H	489,000	9.29	4,542,810.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	118,000	6.90	814,200.00	
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	4.05	818,100.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	9.43	867,560.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	3.33	580,752.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	134,000	16.76	2,245,840.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	420,000	4.44	1,864,800.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	8.11	1,242,857.50	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	55,984	14.84	830,802.56	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	55,200	36.60	2,020,320.00	
CITIC LTD	473,000	8.31	3,930,630.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	225,940	5.87	1,326,267.80	
CRRC CORP LTD-H	320,000	2.90	928,000.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	57,000	17.16	978,120.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	77,000	8.19	630,630.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	50,000	8.51	425,500.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	149,800	10.82	1,620,836.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	116,000	3.64	422,240.00	
BOC AVIATION LTD	15,000	65.15	977,250.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	4.04	1,135,240.00	
AIR CHINA LIMITED-H	148,000	6.34	938,320.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	4.25	450,500.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	273,000	11.26	3,073,980.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	10,500	235.60	2,473,800.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	204,000	4.78	975,120.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	106,000	11.90	1,261,400.00	

COSCO SHIPPING PORTS LTD	182,000	4.88	888,160.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	6.83	464,440.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	6.94	548,260.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	6.14	699,960.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	36.70	1,600,120.00	
MINTH GROUP LTD	54,000	21.05	1,136,700.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	2.74	597,320.00	
BYD CO LTD-H	68,500	284.80	19,508,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	232,000	4.97	1,153,040.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	490,000	17.44	8,545,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	248,000	11.26	2,792,480.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	285,890	7.02	2,006,947.80	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	86,000	16.20	1,393,200.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	192,000	23.40	4,492,800.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	101,600	85.30	8,666,480.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	350,000	4.45	1,557,500.00	
LI NING CO LTD	196,500	69.85	13,725,525.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	67,400	82.80	5,580,720.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	105,000	12.72	1,335,600.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	111,000	16.68	1,851,480.00	
JIU MAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	18.00	1,026,000.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	125,600	16.26	2,042,256.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,266,180	89.95	113,892,891.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	386,000	4.59	1,771,740.00	
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	368,000	2.10	772,800.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	97,000	61.45	5,960,650.00	
JD.COM, INC.	167,267	221.20	36,999,460.40	
MEITUAN-CLASS B	341,500	164.50	56,176,750.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	20.20	739,320.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	42,000	17.18	721,560.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	44,600	18.76	836,696.00	

TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	202,000	6.53	1,319,060.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	55,000	42.50	2,337,500.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	123.52	864,640.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	135,333	53.90	7,294,448.70	
NONGFU SPRING LTD	147,000	46.30	6,806,100.00	
TSING TAO BREWERY CO-H	50,000	75.15	3,757,500.00	
CHINA FEIHE LTD	292,000	7.05	2,058,600.00	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	261,000	34.60	9,030,600.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	3.59	400,285.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	168,000	12.80	2,150,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	125,000	6.82	852,500.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	388,000	6.23	2,417,240.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	21.50	666,500.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	147,000	16.98	2,496,060.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	20.10	462,300.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	60,000	38.00	2,280,000.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	18.60	874,200.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	248,000	9.74	2,415,520.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO	25,200	44.00	1,108,800.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	163,000	5.73	933,990.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	11.08	563,972.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	132,400	17.40	2,303,760.00	
3SBIO, INC	119,000	5.15	612,850.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	104,000	36.25	3,770,000.00	
CANSINO BIOLOGICS INC	5,800	60.50	350,900.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	98,000	12.44	1,219,120.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	248,000	3.21	796,080.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	791,520	8.45	6,688,344.00	
HANSO PHARMACEUTICAL GROUP	84,000	15.28	1,283,520.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	27.35	943,575.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	868,500	4.37	3,795,345.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,510,000	2.57	6,450,700.00	

BANK OF CHINA LTD-H	6,630,000	2.76	18,298,800.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	745,790	4.60	3,430,634.00	
CHINA CITIC BANK-H	810,000	3.27	2,648,700.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,021,000	4.90	39,302,900.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	2.39	614,230.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	334,192	41.10	13,735,291.20	
CHINA MINSHENG BANKING-H	589,800	2.56	1,509,888.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,710,000	4.07	19,169,700.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	681,000	4.91	3,343,710.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.12	942,480.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	607,000	11.28	6,846,960.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	215,000	16.30	3,504,500.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	8.03	830,880.16	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	72,000	18.16	1,307,520.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	850,000	2.30	1,955,000.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	550,420	7.46	4,106,133.20	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	528,000	43.90	23,179,200.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	58,000	20.75	1,203,500.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED	280,000	7.50	2,100,000.00	
GDS HOLDINGS LIMITED	84,200	27.80	2,340,760.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	13.34	880,440.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	219,000	16.66	3,648,540.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	57,000	6.22	354,540.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	21.45	1,104,675.00	
ZTE CORP-H	76,052	16.32	1,241,168.64	
LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
LENOVO GROUP LTD	604,000	6.92	4,179,680.00	
XIAOMI CORPORATION	1,304,000	11.68	15,230,720.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,000	14.90	774,800.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	60,000	23.30	1,398,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	65,000	7.36	478,400.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	61,500	120.50	7,410,750.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	28,000	25.50	714,000.00	

HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	46,000	24.50	1,127,000.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	398,000	11.98	4,768,040.00	
CHINA TOWER CORP LTD	3,610,000	1.00	3,610,000.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	24.60	885,600.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	247,000	11.92	2,944,240.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	76,000	33.55	2,549,800.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,500	126.80	8,178,600.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	5.73	1,810,680.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	2.27	919,350.00	
GUANGDONG INVESTMENT	240,000	7.68	1,843,200.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.07	663,400.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.06	1,079,960.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	124,400	14.44	1,796,336.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	190,050	16.30	3,097,815.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	10.24	845,824.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	268,000	5.33	1,428,440.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	126,000	10.58	1,333,080.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY	149,000	19.80	2,950,200.00	
CGN POWER CO LTD-H	980,000	1.87	1,832,600.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	284,000	12.50	3,550,000.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	490,000	4.16	2,038,400.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	14.40	2,160,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	410,000	3.88	1,590,800.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	98,000	27.90	2,734,200.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	75.85	606,800.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD	14,400	58.40	840,960.00	
WUXI APPTEC CO LTD	30,500	92.20	2,812,100.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	299,000	70.00	20,930,000.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	70,000	8.53	597,100.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	410,000	1.68	688,800.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	320,000	20.20	6,464,000.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	7.88	669,800.00	

	CHINA RESOURCES LAND LTD	268,444	30.70	8,241,230.80	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	52,200	34.05	1,777,410.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	128,000	14.22	1,820,160.00	
	CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	80,000	4.89	391,200.00	
	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	335,712	2.10	704,995.20	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	718,380	2.53	1,817,501.40	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	173,000	15.92	2,754,160.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	15.10	845,600.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.	128,000	6.67	853,760.00	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	58,080	10.08	585,446.40	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	154,000	24.90	3,834,600.00	
	SEAZEN GROUP LTD	168,000	2.82	473,760.00	
	WHARF(HOLDING)	117,000	28.30	3,311,100.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	100,000	9.49	949,000.00	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	29.60	840,640.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	0.62	539,400.00	
	BILIBILI INC	15,020	191.60	2,877,832.00	
	KINGSOFT CORP LTD	91,000	25.40	2,311,400.00	
	NETEASE, INC.	172,950	142.70	24,679,965.00	
	BAIDU INC-CLASS A	186,360	134.10	24,990,876.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	142,300	71.90	10,231,370.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	520,700	303.00	157,772,100.00	
	小計銘柄数：197			987,648,949.76 (16,918,426,509)	
	組入時価比率：21.9%			24.1%	
リング	DIALOG GROUP BHD	313,044	2.38	745,044.72	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	30,000	23.02	690,600.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	190,000	8.75	1,662,500.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	296,000	4.81	1,423,760.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	7.50	253,500.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.30	506,000.00	
	MISC BHD	99,960	7.26	725,709.60	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	121,460	6.23	756,695.80	
	GENTING BHD	187,000	4.76	890,120.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	3.01	689,290.00	

	MR DIY GROUP M BHD	187,500	2.13	399,375.00	
	IOI CORP	247,000	4.22	1,042,340.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	42,400	22.46	952,304.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,300	135.80	991,340.00	
	PPB GROUP BERHAD	51,740	16.96	877,510.40	
	QL RESOURCES BHD	119,000	5.14	611,660.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	4.69	676,767.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	1.77	207,090.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	428,000	0.83	357,380.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	6.49	1,012,440.00	
	AMMB HOLDING	125,000	4.02	502,500.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	596,000	5.45	3,248,200.00	
	HONG LEONG BANK	60,960	20.76	1,265,529.60	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	19.62	263,339.64	
	MALAYAN BANKING	379,000	8.97	3,399,630.00	
	PUBLIC BANK BHD	1,177,000	4.65	5,473,050.00	
	RHB BANK BHD	125,023	5.92	740,136.16	
	INARI AMERTRON BHD	271,000	2.95	799,450.00	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	5.80	359,600.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.08	600,600.00	
	DIGI.COM BERHAD	286,000	3.86	1,103,960.00	
	MAXIS BHD	146,200	3.98	581,876.00	
	TENAGA NASIONAL	210,000	8.89	1,866,900.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	63,000	17.30	1,089,900.00	
	小計銘柄数：34			36,766,097.92 (1,106,185,264)	
	組入時価比率：1.4%			1.6%	
パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	113,000	156.00	17,628,000.00	
	PTT PCL-NVDR	886,000	37.50	33,225,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	56.00	4,648,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	44.00	4,882,548.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	227,994	47.50	10,829,715.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	68,300	365.00	24,929,500.00	
	SCG PACKAGING PLC-NVDR	89,700	58.00	5,202,600.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	8.50	4,046,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	361,000	71.50	25,811,500.00	

	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	810,000	8.80	7,128,000.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	700,000	5.35	3,745,000.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	270,978	33.75	9,145,507.50	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	39.25	6,084,731.25	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	579,997	14.00	8,119,958.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	258,000	27.00	6,966,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	34.00	2,505,800.00	
	CP ALL PCL-NVDR	482,000	59.50	28,679,000.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	20,900	111.50	2,330,350.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	112,000	32.00	3,584,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	26.25	7,323,750.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	17.20	3,436,560.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	912,000	28.25	25,764,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	189.50	6,101,900.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	16.30	4,352,915.00	
	SCB X PCL-NVDR	81,000	106.00	8,586,000.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	26,300	590.00	15,517,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	4.90	4,508,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	94,600	201.00	19,014,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	75.50	10,570,000.00	
	JMT NETWORK SERVICES-NVDR	51,000	76.50	3,901,500.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	68,000	60.00	4,080,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	45.50	2,229,500.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	51.75	3,260,250.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	154,000	18.30	2,818,200.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	39.00	1,326,000.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	183.50	3,174,550.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	134,000	83.75	11,222,500.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	71.25	4,203,750.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	261,000	49.50	12,919,500.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	115,000	41.25	4,743,750.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	185,000	65.25	12,071,250.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	8.90	5,518,000.00	
小計	銘柄数：42			386,134,684.75	
				(1,467,311,802)	

	組入時価比率：1.9%			2.1%	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	60.20	8,789,200.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	770.00	16,248,540.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	529.50	2,893,717.50	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	255,005	55.60	14,178,278.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,100	880.00	19,448,000.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	93,000	188.00	17,484,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	43,000	237.40	10,208,200.00	
	MONDE NISSIN CORP	680,000	16.48	11,206,400.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	125.00	8,375,000.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	145,999	95.60	13,957,504.40	
	BDO UNIBANK INC	168,998	125.40	21,192,349.20	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	53.50	6,831,682.50	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.85	2,879,030.00	
	CONVERGE ICT SOLUTIONS INC	180,000	19.40	3,492,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,294.00	4,748,580.00	
	PLDT INC	7,000	1,755.00	12,285,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	324.00	5,475,600.00	
	ACEN CORP	617,479	8.72	5,384,416.88	
	AYALA LAND LTD	608,000	30.20	18,361,600.00	
	SM PRIME HLDGS	919,975	38.15	35,097,046.25	
小計	銘柄数：20			238,536,144.73 (573,798,696)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,170,000	3,150.00	3,685,500,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	147,050	32,400.00	4,764,420,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,880,000	975.00	2,808,000,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	6,875.00	1,210,000,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	650,000	1,760.00	1,144,000,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	760,000	2,080.00	1,580,800,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,115,813	4,230.00	4,719,888,990.00	
	VALE INDONESIA TBK	198,000	6,525.00	1,291,950,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	240,000	7,900.00	1,896,000,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,660,000	6,975.00	11,578,500,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	1,320,000	1,950.00	2,574,000,000.00	

	小計	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	8,750.00	1,557,500,000.00	
		INDOFOOD SUKSES MAK TBK	420,000	6,550.00	2,751,000,000.00	
		PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	700,000	5,700.00	3,990,000,000.00	
		GUDANG GARAM TBK	29,200	25,300.00	738,760,000.00	
		UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	4,770.00	2,497,095,000.00	
		KALBE FARMA PT	1,540,000	1,635.00	2,517,900,000.00	
		BANK CENTRAL ASIA	4,730,000	7,975.00	37,721,750,000.00	
		BANK JAGO TBK PT	368,000	9,725.00	3,578,800,000.00	
		BANK MANDIRI	1,570,000	8,525.00	13,384,250,000.00	
		BANK NEGARA INDONESIA PT	610,000	8,575.00	5,230,750,000.00	
		BANK RAKYAT INDONESIA	5,860,028	4,280.00	25,080,919,840.00	
		SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	1,250.00	1,848,750,000.00	
		TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,040,000	4,410.00	17,816,400,000.00	
		TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	553,000	2,990.00	1,653,470,000.00	
		銘柄数：25			157,620,403,830.00	
					(1,434,345,674)	
		組入時価比率：1.9%			2.0%	
ウォン		HD HYUNDAI CO LTD	2,985	59,100.00	176,413,500.00	
		S-OIL CORPORATION	3,930	89,600.00	352,128,000.00	
		SK INNOVATION CO LTD	4,520	203,500.00	919,820,000.00	
		HANWHA SOLUTIONS CORP	10,300	47,850.00	492,855,000.00	
		KUMHO PETRO CHEMICAL CO	1,490	134,500.00	200,405,000.00	
		LG CHEM LTD - PREFERRED	630	316,500.00	199,395,000.00	
		LG CHEMICALS LTD	4,123	662,000.00	2,729,426,000.00	
		LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,610	186,500.00	300,265,000.00	
		SK CHEMICALS CO LTD/NEW	900	107,000.00	96,300,000.00	
		SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,490	92,600.00	230,574,000.00	
		SKC CO LTD	1,450	137,000.00	198,650,000.00	
		POSCO CHEMICAL CO LTD	2,241	162,000.00	363,042,000.00	
		HYUNDAI STEEL CO	7,399	34,050.00	251,935,950.00	
		KOREA ZINC CO LTD	850	596,000.00	506,600,000.00	
		POSCO HOLDINGS INC	6,550	258,000.00	1,689,900,000.00	
		KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,000	55,800.00	390,600,000.00	
		GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	32,100.00	135,462,000.00	
		HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	6,900	46,800.00	322,920,000.00	

SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,400	22,150.00	318,960,000.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	31,900	21,200.00	676,280,000.00	
ECOPRO BM CO LTD	3,960	118,100.00	467,676,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	1,920	460,500.00	884,160,000.00	
CJ CORP	1,100	80,800.00	88,880,000.00	
GS HOLDINGS CORP	3,600	43,800.00	157,680,000.00	
LG CORP	7,700	84,400.00	649,880,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,720	123,000.00	826,560,000.00	
SK INC	3,370	229,500.00	773,415,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	32,750.00	109,712,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,410	138,000.00	194,580,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	3,210	92,900.00	298,209,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	63,000	6,010.00	378,630,000.00	
S-1 CORPORATION	1,450	63,000.00	91,350,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,810	188,500.00	341,185,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	12,600	26,600.00	335,160,000.00	
HMM COMPANY LIMITED	20,600	23,800.00	490,280,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	5,610.00	83,532,900.00	
CJ LOGISTICS	780	128,000.00	99,840,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNNOGY CO	5,320	39,200.00	208,544,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	10,750.00	125,237,500.00	
HYUNDAI MOBIS	5,510	218,500.00	1,203,935,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	11,360	197,500.00	2,243,600,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	94,900.00	250,536,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	93,800.00	137,886,000.00	
KIA CORP	21,490	82,000.00	1,762,180,000.00	
COWAY CO LTD	4,970	65,500.00	325,535,000.00	
LG ELECTRONICS INC	8,870	102,000.00	904,740,000.00	
HLB INC	7,400	43,900.00	324,860,000.00	
F&F CO LTD / NEW	1,600	147,500.00	236,000,000.00	
KANGWON LAND INC	7,900	25,900.00	204,610,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	800	101,000.00	80,800,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	72,800.00	142,688,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	166,500.00	80,752,500.00	
E-MART CO	1,710	105,500.00	180,405,000.00	

CJ CHEILJEDANG CORP	820	418,500.00	343,170,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	105,500.00	189,900,000.00	
KT & G CORP	9,410	81,700.00	768,797,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,460	128,000.00	314,880,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	35,650.00	54,188,000.00	
LG H&H	806	732,000.00	589,992,000.00	
LG H&H-PREF	104	356,000.00	37,024,000.00	
SD BIOSENSOR INC	3,500	38,600.00	135,100,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	7,570	78,200.00	591,974,000.00	
ALTEOGEN INC	2,130	71,800.00	152,934,000.00	
CELLTRION INC	8,220	211,000.00	1,734,420,000.00	
GREEN CROSS CORP	410	172,000.00	70,520,000.00	
SEEGENE, INC.	2,720	36,700.00	99,824,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,950	128,500.00	250,575,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,081	88,600.00	95,776,600.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	499	314,500.00	156,935,500.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,320	78,900.00	261,948,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,991	58,000.00	231,478,000.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	23,700	39,150.00	927,855,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	26,100	9,800.00	255,780,000.00	
KAKAOBANK CORP	9,500	32,400.00	307,800,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	32,200	51,800.00	1,667,960,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	37,900	35,750.00	1,354,925,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	42,300	12,350.00	522,405,000.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,360	28,400.00	95,424,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	3,800	62,900.00	239,020,000.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	4,230	37,150.00	157,144,500.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	2,510	197,000.00	494,470,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	6,500	62,300.00	404,950,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,570	133,500.00	343,095,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	398,240	61,000.00	24,292,640,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	68,700	56,000.00	3,847,200,000.00	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,150	77,500.00	166,625,000.00	
L&F CO LTD	2,180	243,800.00	531,484,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	1,260	351,000.00	442,260,000.00	

	LG.DISPLAY CO LTD	23,500	16,600.00	390,100,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	4,800	138,000.00	662,400,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	4,700	632,000.00	2,970,400,000.00	
	SK HYNIX INC	45,530	96,700.00	4,402,751,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	8,699	43,700.00	380,146,300.00	
	LG UPLUS CORP	17,400	12,400.00	215,760,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	2,520	51,900.00	130,788,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	19,600	21,700.00	425,320,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	62,100.00	194,994,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	4,910.00	120,295,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	24,737	6,710.00	165,985,270.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	10,100.00	78,073,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES	6,800	35,450.00	241,060,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,559	905,000.00	1,410,895,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	22,700.00	133,930,000.00	
	CJ ENM CO LTD	657	102,900.00	67,605,300.00	
	HYBE CO LTD	1,220	187,000.00	228,140,000.00	
	KAKAO GAMES CORP	2,810	59,100.00	166,071,000.00	
	KRAFTON INC	2,240	269,000.00	602,560,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,296	378,000.00	489,888,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	68,500.00	100,695,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	2,860	58,400.00	167,024,000.00	
	KAKAO CORP	26,050	80,700.00	2,102,235,000.00	
	NAVER CORP	10,950	259,500.00	2,841,525,000.00	
小計	銘柄数：112			86,054,085,320.00	
				(8,829,149,153)	
	組入時価比率：11.4%			12.6%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	84.40	7,457,584.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	289,998	70.00	20,299,860.00	
	FORMOSA PLASTIC	351,424	94.40	33,174,425.60	
	NAN YA PLASTICS CORP	399,726	70.40	28,140,710.40	
	ASIA CEMENT	208,980	42.40	8,860,752.00	
	TAIWAN CEMENT	534,888	39.35	21,047,842.80	
	CHINA STEEL	1,006,544	29.00	29,189,776.00	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	5,000	1,770.00	8,850,000.00	

WALSIN LIHWA CORP	205,429	37.10	7,621,415.90	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	313,454	30.60	9,591,692.40	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,464	834.00	10,394,976.00	
CHINA AIRLINES LTD	219,000	21.90	4,796,100.00	
EVA AIRWAYS CORP	202,000	32.10	6,484,200.00	
EVERGREEN MARINE	202,375	97.10	19,650,612.50	
WAN HAI LINES LIMITED	49,335	99.90	4,928,566.50	
YANG MING MARINE TRANSPORT	143,000	86.00	12,298,000.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	28.95	4,139,850.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	35.50	5,042,278.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,000	302.50	4,235,000.00	
GIANT MANUFACTURING	23,752	262.50	6,234,900.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	14,443	455.50	6,578,786.50	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,815	182.00	5,972,330.00	
POU CHEN CORP	175,468	28.75	5,044,705.00	
MOMO.COM INC	3,600	830.00	2,988,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	611.00	15,886,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	47,816	279.00	13,340,664.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	402,836	65.80	26,506,608.80	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	362,603	17.70	6,418,073.10	
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,514,212	24.55	37,173,904.60	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	1,045,044	28.30	29,574,745.20	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	895,501	26.55	23,775,551.55	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	709,710	23.55	16,713,670.50	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	974,139	35.80	34,874,176.20	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	918,644	17.25	15,846,609.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	871,051	17.30	15,069,182.30	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	875,520	27.65	24,208,128.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	291,574	51.90	15,132,690.60	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	117,699	224.50	26,423,425.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	911,706	20.90	19,054,655.40	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	647,035	47.10	30,475,348.50	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	1,269,789	13.90	17,650,067.10	

FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	587,775	60.00	35,266,500.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,030,113	8.95	9,219,511.35
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	41,000	279.50	11,459,500.00
ACER INC	256,767	22.15	5,687,389.05
ADVANTECH CO.,LTD.	34,750	342.50	11,901,875.00
ASUSTEK COMPUTER INC	57,805	254.50	14,711,372.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	54,840	177.50	9,734,100.00
COMPAL ELECTRONICS	354,590	22.50	7,978,275.00
INVENTEC CO.,LTD	251,911	24.15	6,083,650.65
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	189,897	67.20	12,761,078.40
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	127.50	6,630,000.00
PEGATRON CORP	159,692	62.20	9,932,842.40
QUANTA COMPUTER INC	224,684	78.40	17,615,225.60
WIWYNN CORP	7,000	760.00	5,320,000.00
AUO CORP	717,008	15.85	11,364,576.80
DELTA ELECTRONICS INC	158,681	272.50	43,240,572.50
E INK HOLDINGS INC	66,000	217.00	14,322,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,040,649	111.00	115,512,039.00
INNOLUX CORP	837,322	11.65	9,754,801.30
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	2,105.00	16,924,200.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	16,000	277.00	4,432,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	122,566	56.60	6,937,235.60
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	162.50	16,250,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	51.70	6,224,007.90
YAGEO CORPORATION	34,377	332.50	11,430,352.50
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	64,410	118.50	7,632,585.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	292,658	90.70	26,544,080.60
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	980.00	1,960,000.00
EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,000	1,360.00	6,800,000.00
GLOBALWAFERS CO LTD	17,000	509.00	8,653,000.00
MEDIATEK INC	126,538	706.00	89,335,828.00
NANYA TECHNOLOGY CO	100,000	53.80	5,380,000.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,058	262.00	12,329,196.00
PARADE TECHNOLOGIES LTD	6,000	961.00	5,766,000.00
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	211,000	35.50	7,490,500.00

	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	38,417	361.00	13,868,537.00	
	SILERGY CORP	28,000	637.00	17,836,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,055,000	525.00	1,078,875,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,025,500	43.05	44,147,775.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	76.20	5,257,800.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	24,000	174.00	4,176,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	22.20	5,372,400.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	312,065	123.50	38,540,027.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	144,000	75.40	10,857,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	154,200	101.50	15,651,300.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	113,112	63.50	7,182,612.00	
小計	銘柄数：87			2,475,495,210.60	
				(11,086,257,751)	
	組入時価比率：14.3%			15.8%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	70,000	345.90	24,213,000.00	
	COAL INDIA LTD	142,000	222.90	31,651,800.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	64,380	255.40	16,442,652.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	268,500	73.15	19,640,775.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	219,000	139.95	30,649,050.00	
	PETRONET LNG LTD	77,000	217.80	16,770,600.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	253,900	2,651.30	673,165,070.00	
	ASIAN PAINTS LTD	33,300	3,501.00	116,583,300.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	680.15	12,922,850.00	
	PI INDUSTRIES LTD	7,000	3,389.95	23,729,650.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,400	2,665.75	33,055,300.00	
	SRF LTD	11,000	2,493.85	27,432,350.00	
	UPL LTD	43,200	788.55	34,065,360.00	
	ACC LIMITED	6,000	2,271.35	13,628,100.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	396.10	22,577,700.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	23,300	1,591.55	37,083,115.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	880	21,440.55	18,867,684.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	8,130	6,656.00	54,113,280.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	428.90	50,181,300.00	
	JINDAL STEEL&POWER LTD	32,000	409.95	13,118,400.00	
	JSW STEEL LTD	66,000	673.85	44,474,100.00	

TATA STEEL LIMITED	611,000	113.00	69,043,000.00	
VEDANTA LTD	59,000	262.50	15,487,500.00	
BHARAT ELECTRONICS LTD	84,800	293.75	24,910,000.00	
LARSEN&TOUBRO LIMITED	59,600	1,848.90	110,194,440.00	
HAVELLS INDIA LTD	17,700	1,301.35	23,033,895.00	
SIEMENS LIMITED	7,000	2,915.40	20,407,800.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	23,600	2,975.85	70,230,060.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,200	668.15	14,832,930.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,400	2,069.15	19,450,010.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	22,400	718.90	16,103,360.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	824.15	35,108,790.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	2,206.45	15,445,150.00	
BHARAT FORGE LIMITED	20,900	779.00	16,281,100.00	
MRF LTD	200	86,971.45	17,394,290.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	106,000	128.55	13,626,300.00	
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	4,091.15	22,869,528.50	
EICHER MOTORS LTD	11,600	3,338.05	38,721,380.00	
HERO MOTOCORP LTD	9,300	2,817.00	26,198,100.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	73,700	1,288.30	94,947,710.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,620	9,003.70	86,615,594.00	
TATA MOTORS LTD	134,000	489.85	65,639,900.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	530	49,678.85	26,329,790.50	
TITAN CO LTD	29,600	2,493.85	73,817,960.00	
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	36,000	584.25	21,033,000.00	
ZOMATO LTD	143,000	64.25	9,187,750.00	
TRENT LTD	15,000	1,409.95	21,149,250.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,690	4,402.10	60,264,749.00	
UNITED SPIRITS LTD	22,600	811.35	18,336,510.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,800	3,690.45	32,475,960.00	
MARICO LIMITED	46,000	511.60	23,533,600.00	
NESTLE INDIA LIMITED	2,890	19,682.95	56,883,725.50	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,300	779.50	35,311,350.00	
ITC LTD	255,000	310.55	79,190,250.00	
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,567.50	15,988,500.00	

DABUR INDIA LTD	45,900	579.60	26,603,640.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33,400	889.85	29,720,990.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	67,100	2,644.50	177,445,950.00	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	8,770	4,349.40	38,144,238.00	
BIOCON LTD	31,000	317.35	9,837,850.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	584.00	10,920,800.00	
CIPLA LIMITED	39,500	1,034.55	40,864,725.00	
DR.REDDYS LABORATORIES	9,140	4,297.80	39,281,892.00	
LUPIN LTD	14,900	683.55	10,184,895.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	82,900	914.60	75,820,340.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,540	1,573.70	10,291,998.00	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	12,600	639.85	8,062,110.00	
AXIS BANK LIMITED	185,100	764.65	141,536,715.00	
BANDHAN BANK LTD	56,000	280.40	15,702,400.00	
ICICI BANK LTD	428,800	879.25	377,022,400.00	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	46,300	1,846.35	85,486,005.00	
YES BANK LTD	839,000	15.90	13,340,100.00	
BAJAJ FINSERV LTD	3,160	15,915.75	50,293,770.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	1,926.70	15,272,950.90	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	76,300	570.60	43,536,780.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	23,100	1,296.00	29,937,600.00	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,200	577.90	19,186,280.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	36,500	1,309.60	47,800,400.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	84,900	958.20	81,351,180.00	
INFOSYS LTD	280,600	1,596.45	447,963,870.00	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,000	4,887.00	19,548,000.00	
MINDTREE LIMITED	4,880	3,528.40	17,218,592.00	
MPHASIS LTD	6,200	2,353.75	14,593,250.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	77,200	3,392.70	261,916,440.00	
TECH MAHINDRA LTD	49,700	1,077.70	53,561,690.00	
WIPRO LTD	106,000	437.10	46,332,600.00	
TATA ELXSI LTD	2,700	10,579.10	28,563,570.00	
INDUS TOWERS LTD	61,000	195.80	11,943,800.00	
BHARTI AIRTEL LIMITED	188,900	704.10	133,004,490.00	

	ADANI TRANSMISSION LTD	23,600	3,581.60	84,525,760.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	261,966	228.85	59,950,919.10	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	106,000	236.00	25,016,000.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	23,400	3,489.70	81,658,980.00	
	GAIL INDIA LTD	127,000	135.10	17,157,700.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	34,200	438.25	14,988,150.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	143,600	2,484.15	356,723,940.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	22,810	7,286.10	166,195,941.00	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	28,600	788.50	22,551,100.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,040.10	10,401,000.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	24,000	961.40	23,073,600.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,700	1,364.70	21,425,790.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	24,900	2,218.20	55,233,180.00	
	ADANI POWER LIMITED	61,000	362.35	22,103,350.00	
	NTPC LIMITED	309,000	158.75	49,053,750.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	11,070	3,732.00	41,313,240.00	
	DLF LIMITED	58,000	379.15	21,990,700.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,300	1,363.10	12,676,830.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	6,670	4,428.75	29,539,762.50	
小計	銘柄数：108			6,152,280,672.00	
				(10,520,399,949)	
	組入時価比率：13.6%			15.0%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	18.26	633,622.00	
	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	220,000	4.00	880,000.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.63	804,895.00	
	INDUSTRIES QATAR	143,000	18.00	2,574,000.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	184,000	7.80	1,435,200.00	
	MASRAF AL RAYAN	455,000	4.71	2,143,050.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	12.55	589,850.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	132,000	26.50	3,498,000.00	
	QATAR NATIONAL BANK	394,000	22.03	8,679,820.00	
	OOREDOO QSC	65,000	9.01	585,650.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	19.15	658,760.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	195,000	3.60	702,000.00	
小計	銘柄数：12			23,184,847.00	

				(847,638,006)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
エジプトボンド	EASTERN TOBACCO	51,525	10.44	537,921.00	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	121,733	37.49	4,563,770.17	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	60,000	12.29	737,400.00	
小計	銘柄数：3			5,839,091.17	
				(40,947,794)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,600	216.18	4,237,128.00	
	SASOL LTD	46,200	362.10	16,729,020.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	241.52	1,690,640.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,259.34	5,175,887.40	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	35,000	261.19	9,141,650.00	
	GOLD FIELDS LTD	71,600	154.08	11,032,128.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	56.07	2,287,656.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	70,700	192.38	13,601,266.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,900	466.03	1,817,517.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	26,700	181.62	4,849,254.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	229,000	41.88	9,590,520.00	
	BIDVEST GROUP LTD	25,500	225.12	5,740,560.00	
	NASPERS LTD-N SHS	18,160	2,580.58	46,863,332.80	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	94,000	54.95	5,165,300.00	
	MR PRICE GROUP LTD	25,000	198.86	4,971,500.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	173,000	21.37	3,697,010.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,000	138.82	4,442,240.00	
	BID CORP LTD	27,300	323.06	8,819,538.00	
	CLICKS GROUP LTD	18,300	306.79	5,614,257.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,600	238.31	9,437,076.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	156.82	2,399,346.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	31,500	156.44	4,927,860.00	
	ABSA GROUP LTD	68,400	186.72	12,771,648.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,290	2,150.52	15,677,290.80	
	NEDBANK GROUP LTD	35,779	221.66	7,930,773.14	
	STANDARD BANK GROUP LTD	117,300	173.57	20,359,761.00	
	FIRSTRAND LTD	410,000	70.40	28,864,000.00	
	REMGRO LTD	47,300	139.34	6,590,782.00	

	DISCOVERY LTD	46,907	136.32	6,394,362.24	
	OLD MUTUAL LTD	434,000	11.59	5,030,060.00	
	SANLAM LIMITED	149,000	58.92	8,779,080.00	
	MTN GROUP LTD	141,400	148.28	20,966,792.00	
	VODACOM GROUP	51,700	137.52	7,109,784.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	14,200	295.48	4,195,816.00	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	41,900	96.24	4,032,456.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	123.73	3,298,641.80	
小計	銘柄数：36			334,231,933.18	
				(2,737,359,532)	
	組入時価比率：3.5%			3.9%	
UAEディールハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	298,000	4.60	1,370,800.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	237,870	9.45	2,247,871.50	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	128,000	9.16	1,172,480.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	214,029	5.95	1,273,472.55	
	EMIRATES NBD PJSC	165,000	13.90	2,293,500.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	357,125	20.46	7,306,777.50	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	296,900	27.90	8,283,510.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	4.87	1,348,990.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	349,000	5.85	2,041,650.00	
小計	銘柄数：9			27,339,051.55	
				(1,001,429,458)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
クウェートディナール	AGILITY	134,400	0.85	114,240.00	
	BOUBAYAN BANK K.S.C	127,951	0.83	106,583.18	
	GULF BANK	128,000	0.34	44,544.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	421,300	0.85	361,475.40	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	585,000	1.07	627,705.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	189,000	0.62	117,369.00	
	MABANEE CO SAKC	40,449	0.79	32,318.75	
小計	銘柄数：7			1,404,235.33	
				(615,939,742)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
サウジアラビア	RABIGH REFINING AND PETROCHE	22,951	18.36	421,380.36	

リヤル

SAUDI ARABIAN OIL CO	206,400	39.80	8,214,720.00
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	10,833	54.30	588,231.90
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	17.10	478,800.00
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	19,300	164.00	3,165,200.00
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	51.90	1,520,670.00
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	75,200	105.60	7,941,120.00
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	29,368	28.00	822,304.00
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	67,000	16.08	1,077,360.00
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,900	53.00	1,054,700.00
SAUDI ARABIAN MINING CO	70,200	73.80	5,180,760.00
JARIR MARKETING CO	3,730	177.80	663,194.00
ALMARAI CO	18,000	53.40	961,200.00
SAVOLA	27,400	34.30	939,820.00
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	7,800	213.60	1,666,080.00
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,400	235.20	799,680.00
AL RAJHI BANK	162,000	88.00	14,256,000.00
ALINMA BANK	81,000	38.35	3,106,350.00
ARAB NATIONAL BANK	47,800	32.00	1,529,600.00
BANK AL - JAZIRA	34,100	24.38	831,358.00
BANK ALBILAD	42,666	50.60	2,158,899.60
BANQUE SAUDI FRANSI	49,200	52.10	2,563,320.00
RIYAD BANK	111,800	36.70	4,103,060.00
SAUDI BRITISH BANK	73,600	42.15	3,102,240.00
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	39,000	20.50	799,500.00
THE SAUDI NATIONAL BANK	181,800	72.70	13,216,860.00
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,200	159.60	989,520.00
ELM CO	1,900	293.20	557,080.00
SAUDI TELECOM CO	51,800	104.60	5,418,280.00
ETIHAD ETISALAT CO	34,300	39.00	1,337,700.00
MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	12.38	359,020.00
SAUDI ELECTRICITY CO	77,000	26.20	2,017,400.00
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	2,900	215.00	623,500.00
ACWA POWER CO	6,400	173.60	1,111,040.00
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	53,000	13.90	736,700.00

		EMAAR ECONOMIC CITY	35,000	10.96	383,600.00	
		SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	2,800	208.00	582,400.00	
	小計	銘柄数：37			95,278,647.86	
					(3,414,786,739)	
		組入時価比率：4.4%			4.9%	
	合計				70,150,685,106	
					(70,150,685,106)	

(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8月17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	4,460,000	23,448,450.00	
	小計	銘柄数：1	4,460,000	23,448,450.00	
				(3,149,361,319)	
		組入時価比率：4.1%		97.4%	
	合計			3,149,361,319	
				(3,149,361,319)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	234,000	4,979,520.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	111,000	2,534,130.00	
		銘柄数：2	345,000	7,513,650.00	
				(50,692,342)	
		組入時価比率：0.1%		1.6%	
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	300,000	4,134,000.00	
		銘柄数：1	300,000	4,134,000.00	
				(33,857,460)	
		組入時価比率：0.0%		1.0%	
	合計			84,549,802	
				(84,549,802)	
	合計			3,233,911,121	
				(3,233,911,121)	

(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)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 8月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	3,835,106,543	—	3,913,750,420	78,643,877
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	66,683,470	—	67,145,600	462,130
米ドル	66,683,470	—	67,145,600	462,130
合計	—	—	—	79,106,007

(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。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 8月17日現在)

資産の部
流動資産

(2022年 8月17日現在)

預金	243,249,522
コール・ローン	60,629,670
国債証券	26,859,085,761
派生商品評価勘定	154,868
未収利息	285,219,901
前払費用	77,348,261
流動資産合計	27,525,687,983
資産合計	27,525,687,983
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	191,430
未払金	71,539,147
未払解約金	34,616,587
未払利息	23
その他未払費用	57,100
流動負債合計	106,404,287
負債合計	106,404,287
純資産の部	
元本等	
元本	14,092,067,341
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	13,327,216,355
元本等合計	27,419,283,696
純資産合計	27,419,283,696
負債純資産合計	27,525,687,983

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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.9457円
(10,000口当たり純資産額)	(19,457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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、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 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 8月17日現在	
期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	12,405,234,030円
同期中における追加設定元本額	6,318,066,319円
同期中における一部解約元本額	4,631,233,008円
期末元本額	14,092,067,341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	503,558,755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	1,104,796,853円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	832,835円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	501,154円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	3,044,767円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	735,127円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	2,386,911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）	1,737,658,869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）	2,854,460,060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	1,316,463,103円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	162,175,204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）	3,514,862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）	2,170,210円
新興国債券・インデックスF（適格機関投資家専用）	84,204,807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）	192,843,707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）	5,842,181,433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）	161,903,899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8月17日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2022年8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ABU DHABI GOVT INT'L	1,300,000.00	1,266,445.70	
		ABU DHABI GOVT INT'L	1,200,000.00	1,175,894.40	

ABU DHABI GOVT INT'L	2,100,000.00	2,101,123.50	
ABU DHABI GOVT INT'L	1,600,000.00	1,453,440.00	
ABU DHABI GOVT INT'L	800,000.00	757,535.20	
ABU DHABI GOVT INT'L	1,200,000.00	1,179,270.00	
ABU DHABI GOVT INT'L	1,200,000.00	1,050,093.60	
ABU DHABI GOVT INT'L	400,000.00	356,829.60	
ABU DHABI GOVT INT'L	800,000.00	784,080.00	
ABU DHABI GOVT INT'L	1,000,000.00	821,975.00	
ABU DHABI GOVT INT'L	2,200,000.00	2,072,562.80	
ABU DHABI GOVT INT'L	1,000,000.00	724,331.00	
ARAB REPUBLIC OF EGYPT	1,500,000.00	1,177,455.00	
ARAB REPUBLIC OF EGYPT	1,300,000.00	927,240.60	
ARAB REPUBLIC OF EGYPT	2,400,000.00	1,558,296.00	
ARAB REPUBLIC OF EGYPT	1,800,000.00	1,195,254.00	
BRAZIL GLOBAL	650,000.00	729,996.02	
BRAZIL GLOBAL	370,000.00	428,827.66	
CHINA GOVT INTL BOND	1,200,000.00	1,101,520.32	
CHINA GOVT INTL BOND	1,500,000.00	1,405,065.60	
CHINA GOVT INTL BOND	1,400,000.00	1,328,092.50	
CHINA GOVT INTL BOND	1,500,000.00	1,317,656.25	
CROATIA	1,100,000.00	1,114,512.30	
DOMINICAN REPUBLIC	1,200,000.00	1,049,382.96	
DOMINICAN REPUBLIC	1,500,000.00	1,274,037.00	
DOMINICAN REPUBLIC	1,500,000.00	1,365,546.00	
DOMINICAN REPUBLIC	1,300,000.00	1,025,515.14	
DOMINICAN REPUBLIC	1,400,000.00	1,175,559.98	
DOMINICAN REPUBLIC	2,000,000.00	1,525,429.40	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,100,000.00	1,061,415.85	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000.00	634,888.44	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,400,000.00	1,364,973.12	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,417,116.90	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,400,000.00	2,146,596.48	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	700,000.00	611,566.55	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	176,163.52	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	200,000.00	160,813.26	

FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,300,000.00	1,118,742.04	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,100,000.00	1,587,252.03	
HUNGARY	950,000.00	970,366.10	
HUNGARY	200,000.00	203,898.80	
HUNGARY	700,000.00	715,629.60	
HUNGARY	400,000.00	326,264.00	
HUNGARY	600,000.00	418,669.20	
INDONESIA GLOBAL	200,000.00	206,654.84	
MEXICO GLOBAL	200,000.00	136,754.80	
OMAN GOV INTERNTL BOND	1,500,000.00	1,524,900.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	2,200,000.00	2,269,652.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	1,200,000.00	1,247,028.00	
OMAN GOV INTERNTL BOND	2,200,000.00	2,086,040.00	
PANAMA GLOBAL	700,000.00	770,414.05	
PANAMA GLOBAL	1,150,000.00	1,284,905.46	
PHILIPPINES GLOBAL	1,000,000.00	985,088.70	
PHILIPPINES GLOBAL	750,000.00	1,008,886.87	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	630,085.65	
REPUBLIC OF ARGENTINA	3,975,113.00	949,717.69	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,365,309.00	566,776.76	
REPUBLIC OF ARGENTINA	6,537,686.00	1,449,901.85	
REPUBLIC OF ARGENTINA	6,286,159.00	1,845,075.04	
REPUBLIC OF ARGENTINA	3,300,000.00	905,549.70	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,000,000.00	229,726.70	
REPUBLIC OF CHILE	1,000,000.00	957,993.20	
REPUBLIC OF CHILE	900,000.00	790,370.19	
REPUBLIC OF CHILE	2,000,000.00	1,744,246.20	
REPUBLIC OF CHILE	1,100,000.00	925,185.25	
REPUBLIC OF CHILE	1,000,000.00	911,426.90	
REPUBLIC OF CHILE	1,200,000.00	939,642.72	
REPUBLIC OF CHILE	1,400,000.00	1,277,513.16	
REPUBLIC OF CHILE	1,200,000.00	954,652.44	
REPUBLIC OF CHILE	1,400,000.00	1,090,555.06	
REPUBLIC OF CHILE	800,000.00	566,971.20	
REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000.00	672,230.44	

REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	822,373.74	
REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	730,968.57	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,114,842.40	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,600,000.00	1,255,511.68	
REPUBLIC OF COLOMBIA	400,000.00	273,157.52	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,022,879.65	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,200,000.00	881,396.52	
REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000.00	520,252.81	
REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000.00	520,145.84	
REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000.00	371,638.50	
REPUBLIC OF ECUADOR	1,700,000.00	957,720.84	
REPUBLIC OF ECUADOR	5,100,000.00	2,141,351.79	
REPUBLIC OF ECUADOR	2,600,000.00	990,084.68	
REPUBLIC OF HUNGARY	1,350,000.00	1,670,826.15	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	404,632.48	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	412,772.32	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	717,557.47	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	594,903.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	203,801.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,600,000.00	1,678,070.24	
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	468,239.95	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	999,950.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	150,000.00	189,606.93	
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	525,183.75	
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	515,220.55	
REPUBLIC OF INDONESIA	900,000.00	1,018,261.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	190,100.14	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,155,878.02	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,411,218.45	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	933,472.70	
REPUBLIC OF NIGERIA	1,000,000.00	815,685.00	
REPUBLIC OF NIGERIA	1,400,000.00	1,018,080.00	
REPUBLIC OF PANAMA	700,000.00	697,082.40	
REPUBLIC OF PANAMA	300,000.00	293,457.69	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	725,424.00	

REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000.00	1,372,855.40	
REPUBLIC OF PANAMA	1,300,000.00	1,097,735.73	
REPUBLIC OF PANAMA	2,300,000.00	1,901,342.61	
REPUBLIC OF PANAMA	900,000.00	665,122.41	
REPUBLIC OF PANAMA	1,200,000.00	965,847.96	
REPUBLIC OF PERU	800,000.00	755,696.96	
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	447,063.80	
REPUBLIC OF PERU	2,300,000.00	2,013,747.29	
REPUBLIC OF PERU	300,000.00	236,480.82	
REPUBLIC OF PERU	400,000.00	340,936.64	
REPUBLIC OF PERU	200,000.00	160,985.40	
REPUBLIC OF PERU	800,000.00	874,123.60	
REPUBLIC OF PERU	900,000.00	716,643.00	
REPUBLIC OF PERU	1,600,000.00	1,080,545.92	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	506,262.55	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	814,227.92	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	300,000.00	278,338.47	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	514,582.98	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	714,125.52	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	546,210.30	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	473,460.48	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	456,508.50	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	813,139.60	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	250,000.00	256,250.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	197,052.80	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	457,892.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,400,000.00	1,280,230.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	486,493.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	679,050.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	575,400.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,400,000.00	1,804,140.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	300,000.00	260,265.00	
REPUBLIC OF SRI LANKA	600,000.00	198,000.30	
REPUBLIC OF TURKEY	200,000.00	192,494.60	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	374,696.00	

REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,343,625.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,208,824.50	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,110,101.20	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,139,678.80	
REPUBLIC OF TURKEY	800,000.00	781,016.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000.00	1,308,096.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,263,690.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	538,983.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,000,000.00	762,870.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	858,033.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	461,673.00	
REPUBLIC OF TURKEY	700,000.00	480,063.50	
REPUBLIC OF TURKEY	500,000.00	357,099.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000.00	893,844.00	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	1,400,000.00	1,464,387.12	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY	1,700,000.00	1,797,194.95	
ROMANIA	500,000.00	428,825.00	
ROMANIA	200,000.00	200,700.00	
ROMANIA	100,000.00	88,937.60	
ROMANIA	1,300,000.00	974,481.30	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,000,000.00	1,015,150.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	2,500,000.00	2,475,332.50	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	2,600,000.00	2,612,480.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	2,000,000.00	2,103,172.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,000,000.00	1,058,853.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,100,000.00	1,079,705.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,500,000.00	1,324,254.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,200,000.00	1,173,894.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,000,000.00	1,029,070.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,100,000.00	1,174,992.50	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,200,000.00	1,042,038.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,300,000.00	1,256,060.00	
SAUDI INTERNATIONAL BOND	1,300,000.00	1,043,120.00	
STATE OF QATAR	1,000,000.00	997,700.00	
STATE OF QATAR	1,400,000.00	1,400,275.80	

小計	STATE OF QATAR	1,700,000.00	1,800,998.70	
	STATE OF QATAR	1,700,000.00	1,764,125.70	
	STATE OF QATAR	1,300,000.00	1,335,347.00	
	STATE OF QATAR	2,200,000.00	2,434,291.20	
	STATE OF QATAR	3,000,000.00	3,194,373.00	
	STATE OF QATAR	2,400,000.00	2,428,080.00	
	TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,446,825.00	
	TURKEY GLOBAL	1,000,000.00	971,171.00	
	UAE INT'L GOVT BOND	1,100,000.00	905,169.10	
	UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	149,130.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	2,000,000.00	515,100.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	1,200,000.00	282,000.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	1,600,000.00	369,840.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	2,100,000.00	487,725.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	206,412.50	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	200,000.00	49,900.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	157,780.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,161,145.18	
	UNITED MEXICAN STATES	200,000.00	200,683.58	
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	704,242.28	
	UNITED MEXICAN STATES	600,000.00	603,828.24	
	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000.00	1,802,245.68	
	UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,005,979.37	
	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,368,208.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,400,000.00	1,402,488.36	
	UNITED MEXICAN STATES	500,000.00	433,758.80	
	UNITED MEXICAN STATES	1,010,000.00	1,033,171.82	
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	590,124.85	
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	584,003.28	
	UNITED MEXICAN STATES	900,000.00	739,014.12	
	UNITED MEXICAN STATES	2,400,000.00	2,109,894.00	
	UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	554,371.37	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	903,690.32	
	銘柄数：210	249,194,267.00	199,978,302.15	
			(26,859,085,761)	

		組入時価比率：98.0%		100.0%	
合計				26,859,085,761	
				(26,859,085,761)	

(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 8月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	37,446,668	—	37,601,536	154,868
米ドル	37,446,668	—	37,601,536	154,868
売建	26,668,690	—	26,860,120	△191,430
米ドル	26,668,690	—	26,860,120	△191,430
合計	—	—	—	△36,562

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2022年 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	70,725,574
コール・ローン	8,673,771
国債証券	6,990,266,513
派生商品評価勘定	206,587
未収入金	78,612,966
未収利息	92,633,366
前払費用	11,149,411
流動資産合計	7,252,268,188
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	630,776
未払金	49,789,614
未払解約金	69,556,084
未払利息	3
その他未払費用	346,800
流動負債合計	120,323,277
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	4,972,767,518
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,159,177,393
元本等合計	7,131,944,911
純資産合計	
負債純資産合計	

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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4342円
(10,000口当たり純資産額)	(14,342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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、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 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 8月17日現在	
期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	6,295,141,360円
同期中における追加設定元本額	562,538,763円
同期中における一部解約元本額	1,884,912,605円
期末元本額	4,972,767,518円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド２０１５	12,146,531円
野村資産設計ファンド２０２０	13,076,699円
野村資産設計ファンド２０２５	21,473,331円
野村資産設計ファンド２０３０	27,817,705円
野村資産設計ファンド２０３５	20,975,511円
野村資産設計ファンド２０４０	34,949,898円
野村資産設計ファンド２０４５	6,138,350円
野村インデックスファンド・新興国債券	731,660,826円
ネクストコア	4,142,066円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	583,547,540円
野村資産設計ファンド２０５０	6,078,209円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	2,649,400円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	1,571,853円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	1,012,989円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	820,227円
世界６資産分散ファンド	126,438,991円
野村資産設計ファンド２０６０	2,949,175円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）	2,729,774,633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）	904,160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）	70,358,373円
野村ＤＣ新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド	431,133,404円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	111,086,393円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	10,780,051円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	9,392,712円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	6,655,189円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	3,598,083円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	1,635,219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8月17日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2022年8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,500,000.00	5,414,750.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,800,000.00	5,685,508.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000.00	14,385,502.44	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,500,000.00	13,215,397.15	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,431,250.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,650,000.00	1,584,269.77	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000.00	10,811,097.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000.00	12,708,216.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	3,969,294.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,047,954.40	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,600,000.00	1,581,335.20	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,700,000.00	7,961,370.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,600,000.00	9,953,768.88	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,500,000.00	9,316,650.00	
	小計	銘柄数：14	107,950,000.00	104,066,363.34	
				(702,104,533)	
		組入時価比率：9.8%		10.0%	
	リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	6,400,000.00	5,731,637.76	
		LETRA TESOURO NACIONAL	6,300,000.00	5,343,323.58	
		LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000.00	2,823,602.95	
		LETRA TESOURO NACIONAL	4,100,000.00	2,992,154.99	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000.00	4,698,928.44	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	230,000.00	2,206,847.93	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	2,348,025.75	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	160,000.00	1,470,620.16	
	小計	銘柄数：8	21,421,000.00	27,615,141.56	
				(720,514,942)	
		組入時価比率：10.1%		10.4%	
	チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	98,565,940.00	
		BONOS TESORERIA PESOS	150,000,000.00	134,652,735.00	

小計	BONOS TESORERIA PESOS	190,000,000.00	178,728,953.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	295,000,000.00	269,215,348.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	216,052,224.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	115,000,000.00	109,954,352.00	
	銘柄数：6	1,090,000,000.00	1,007,169,552.00	
	組入時価比率：2.2%		(153,441,274)	2.2%
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,790,000,000.00	1,661,227,400.00	
	TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	940,079,055.00	
	TITULOS DE TESORERIA	490,000,000.00	428,936,788.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	701,948,880.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,460,000,000.00	1,128,263,618.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,330,000,000.00	1,067,401,475.00	
	TITULOS DE TESORERIA	800,000,000.00	601,074,560.00	
	TITULOS DE TESORERIA	780,000,000.00	568,895,964.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,850,000,000.00	1,319,037,975.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	565,381,170.00	
	TITULOS DE TESORERIA	560,000,000.00	350,532,224.00	
	銘柄数：11	11,810,000,000.00	9,332,779,109.00	
小計	組入時価比率：4.1%		(295,214,468)	4.2%
ソル	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	197,464.20	
	BONOS DE TESORERIA	480,000.00	441,517.20	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	534,674.76	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	567,643.16	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	524,958.00	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	732,200.28	
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	479,576.35	
	PERU BONO SOBERANO	320,000.00	289,964.28	
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,043,678.02	
小計	銘柄数：9	5,300,000.00	4,811,676.25	
	組入時価比率：2.4%		(168,366,807)	2.4%
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,638,000.00	
小計	銘柄数：1	4,000,000.00	3,638,000.00	
			(12,162,925)	

	組入時価比率：0.2%		0.2%	
セルビアディナール	SERBIA TREASURY BONDS	22,000,000.00	17,765,422.40	
小計	銘柄数：1	22,000,000.00	17,765,422.40 (20,680,586)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	770,000.00	726,495.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	600,000.00	590,700.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	455,795.60	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	990,120.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	854,254.08	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,664,100.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	359,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	500,000.00	421,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	575,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	882,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,243,500.00	
小計	銘柄数：11	9,920,000.00	8,762,764.68 (65,662,900)	
	組入時価比率：0.9%		0.9%	
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	13,077,470.00	
	CZECH REPUBLIC	4,000,000.00	4,180,000.00	
	CZECH REPUBLIC	6,400,000.00	5,623,616.00	
	CZECH REPUBLIC	11,500,000.00	9,628,720.00	
	CZECH REPUBLIC	2,300,000.00	2,134,584.00	
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	10,627,980.00	
	CZECH REPUBLIC	5,800,000.00	4,696,956.00	
	CZECH REPUBLIC	11,300,000.00	9,523,414.00	
	CZECH REPUBLIC	5,200,000.00	5,417,100.00	
小計	銘柄数：9	73,700,000.00	64,909,840.00 (361,327,115)	
	組入時価比率：5.1%		5.2%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	51,000,000.00	46,920,000.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	27,000,000.00	25,610,850.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	60,044,340.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	56,070,000.00	

小計	HUNGARY GOVERNMENT BOND	66,000,000.00	50,094,000.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	107,000,000.00	81,683,800.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	51,845,946.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	102,000,000.00	72,220,039.20	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	130,000,000.00	92,261,000.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	44,000,000.00	24,904,000.00	
	銘柄数：10	715,000,000.00	561,653,975.20	
			(190,056,965)	
	組入時価比率：2.7%		2.7%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,398,325.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000.00	2,850,295.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	1,936,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,500,000.00	1,997,875.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	3,778,875.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000.00	2,465,680.00	
	銘柄数：6	19,200,000.00	16,427,050.00	
			(480,992,237)	
	組入時価比率：6.7%		6.9%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	21,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	21,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	28,300,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	32,500,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	38,700,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	29,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	16,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	24,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,200,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,500,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	27,500,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	0.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	51,000,000.00	0.00	

小計	銘柄数：18	427,400,000.00	0.00	
	組入時価比率：0.0%		(0)	0.0%
レイ	ROMANIA	550,000.00	545,355.25	
	ROMANIA	400,000.00	389,288.00	
	ROMANIA	500,000.00	483,517.90	
	ROMANIA	1,000,000.00	944,665.00	
	ROMANIA	800,000.00	741,494.32	
	ROMANIA	920,000.00	858,774.00	
	ROMANIA	500,000.00	447,775.00	
	ROMANIA	500,000.00	459,005.00	
	ROMANIA	700,000.00	604,543.03	
	ROMANIA	760,000.00	705,584.00	
	ROMANIA	1,150,000.00	1,001,736.25	
	ROMANIA	1,400,000.00	1,049,559.00	
小計	銘柄数：12	9,180,000.00	8,231,296.75	
	組入時価比率：3.2%		(230,542,982)	3.3%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	815,436.16	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,800,000.00	1,811,310.48	
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	774,691.84	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,400,000.00	1,486,921.66	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	402,199.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,008,200.90	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	700,000.00	706,492.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,209,481.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	612,459.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,237,044.26	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,314,239.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,416,857.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,477,044.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,081,645.32	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,937,655.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,103,056.92	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,570,000.00	1,452,747.21	
小計	銘柄数：17	23,070,000.00	22,847,483.77	

			(687,414,528)	
	組入時価比率：9.6%		9.8%	
パ ー ツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,700,000.00	11,948,326.65	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,384,189.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	14,799,985.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,194,280.88	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,259,160.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	12,072,171.94	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	13,478,821.16	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	9,863,479.22	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	11,968,483.14	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,500,000.00	14,898,558.15	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,800,000.00	14,172,199.68	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,100,000.00	11,786,290.56	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,467,987.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,094,985.16	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,100,000.00	8,680,918.69	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,090,680.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	6,050,184.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,700,000.00	14,121,832.86	
小 計	銘柄数：18	190,000,000.00	191,332,535.19	
	組入時価比率：10.2%		(727,063,633)	10.5%
ル ビ ア	INDONESIA GOVERNMENT	3,500,000,000.00	3,542,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,730,000,000.00	4,964,844,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,800,000,000.00	3,989,506,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,300,000,000.00	4,379,636,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,797,250,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,000,000,000.00	3,808,400,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,450,000,000.00	4,537,843,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	4,859,750,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,230,000,000.00	3,591,372,400.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,334,220,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,600,000,000.00	4,613,156,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,500,000,000.00	4,374,450,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,773,538,640.00	

小計	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,724,480,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,800,000,000.00	1,849,914,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,759,517,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,180,000,000.00	1,287,958,200.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,165,450,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,421,350,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,600,000,000.00	2,662,894,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000.00	2,356,925,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,800,000,000.00	1,793,421,000.00	
	銘柄数：22	73,380,000,000.00	75,587,875,740.00	
人民元			(687,849,669)	
	組入時価比率：9.6%		9.8%	
	CHINA GOVERNMENT BOND	9,300,000.00	9,368,521.47	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000.00	7,903,557.48	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,346,684.88	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,213,893.12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,150,900.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	500,000.00	505,700.15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,184,770.00	
	銘柄数：7	34,000,000.00	34,674,027.10	
エジプトポンド			(686,056,832)	
	組入時価比率：9.6%		9.8%	
	EGYPT GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,725,818.60	
	EGYPT GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	5,741,815.59	
	EGYPT GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	2,957,563.20	
	銘柄数：3	15,500,000.00	14,425,197.39	
			(101,159,581)	
	組入時価比率：1.4%		1.4%	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,200,000.00	15,127,086.76	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,600,000.00	12,150,785.36	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,660,000.00	6,203,834.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,000,000.00	7,780,178.70	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	8,567,178.84	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,248,106.24	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	8,108,100.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	5,936,039.49	

	小計	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	2,860,987.32	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,300,000.00	5,081,745.06	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,900,000.00	10,363,862.58	
		銘柄数：11	99,810,000.00	85,427,904.35	
		組入時価比率：9.8%		(699,654,536)	
合計				6,990,266,513	
				(6,990,266,513)	

(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 8月17日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	33,705,950	—	33,892,763	186,813
米ドル	33,705,950	—	33,892,763	186,813
売建	97,722,312	—	98,333,314	△611,002
米ドル	64,016,362	—	64,460,716	△444,354
メキシコペソ	6,045,930	—	6,068,790	△22,860
フォリント	3,389,870	—	3,381,850	8,020
リングギ	6,857,450	—	6,919,573	△62,123
ルピア	7,644,000	—	7,644,000	—
人民元	4,914,700	—	4,946,125	△31,425
ランド	4,854,000	—	4,912,260	△58,260
合計	—	—	—	△424,189

(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 8月17日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	996,661,862
投資証券	45,486,670,100
派生商品評価勘定	21,084,330
未収配当金	276,227,607
差入委託証拠金	48,181,050
流動資産合計	46,828,824,949
資産合計	46,828,824,949
負債の部	
流動負債	
未払金	36,480,502
未払解約金	7,733,709
未払利息	393
流動負債合計	44,214,604
負債合計	44,214,604
純資産の部	
元本等	
元本	16,891,918,310
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	29,892,692,035
元本等合計	46,784,610,345
純資産合計	46,784,610,345
負債純資産合計	46,828,824,949

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 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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 金融商品の時価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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	
	2.7696円
	(27,696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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日	
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 8月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 8月17日現在	
期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	17,123,088,767円
同期中における追加設定元本額	2,473,383,692円
同期中における一部解約元本額	2,704,554,149円
期末元本額	16,891,918,310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）	1,680,487,626円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,198,041,627円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	940,823,956円
野村資産設計ファンド2015	13,358,860円
野村資産設計ファンド2020	14,369,748円
野村資産設計ファンド2025	18,092,201円
野村資産設計ファンド2030	20,086,635円
野村資産設計ファンド2035	19,699,610円
野村資産設計ファンド2040	37,873,869円
野村資産設計ファンド2045	5,316,769円
野村インデックスファンド・J－REIT	3,156,542,045円
ネクストコア	14,503,804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	1,138,375,522円
野村J－REITインデックス（野村SMA・EW向け）	1,645,181,596円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	667,901,652円
野村資産設計ファンド2050	4,802,794円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,136,298円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	854,364円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	6,231,046円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	1,504,361円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	4,884,112円
野村6資産均等バランス	2,431,731,617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）	96,205,004円
野村資産設計ファンド2060	3,242,214円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	338,065,681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）	86,134,098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）	16,861,243円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,690,158,227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）	32,483,682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）	456,871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	477,530,977円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	39,412,842円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	10,149,878円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	4,767,633円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	11,088,610円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	6,785,555円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	7,211,862円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,843,056円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,797,684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）	33,543,160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8月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年8月17日現在)

（単位:円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	821	97,616,900	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,294	129,141,200	
		SOSILA物流リート投資法人 投資証券	1,888	294,905,600	
		東海道リート投資法人 投資証券	490	60,221,000	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,395	949,995,000	

森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,750	728,175,000	
産業ファンド投資法人 投資証券	6,036	1,111,227,600	
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,039	1,458,079,000	
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	2,897	635,022,400	
アクティビア・プロパティーズ投資 法人 投資証券	2,133	901,192,500	
G L P投資法人 投資証券	12,440	2,206,856,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,879	631,344,000	
日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	6,619	2,376,221,000	
星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	706	451,840,000	
One リート投資法人 投資証券	705	193,875,000	
イオンリート投資法人 投資証券	4,471	691,216,600	
ヒューリックリート投資法人 投資 証券	3,779	629,203,500	
日本リート投資法人 投資証券	1,312	489,376,000	
積水ハウス・リート投資法人 投資 証券	12,275	1,032,327,500	
トーセイ・リート投資法人 投資証 券	896	122,752,000	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,698	481,552,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	996	174,897,600	
サムティ・レジデンシャル投資法 人 投資証券	1,050	133,455,000	
野村不動産マスターファンド投資法 人 投資証券	13,062	2,211,396,600	
いちごホテルリート投資法人 投資 証券	669	63,755,700	
ラサールロジポート投資法人 投資 証券	4,945	864,386,000	
スターアジア不動産投資法人 投資 証券	5,043	286,946,700	
マリモ地方創生リート投資法人 投 資証券	504	66,780,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投 資法人 投資証券	1,596	876,204,000	

大江戸温泉リート投資法人 投資証券	652	43,944,800	
投資法人みらい 投資証券	4,907	247,312,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	948	124,567,200	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	1,246	602,441,000	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,564	326,719,600	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	655	84,429,500	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,593	177,141,600	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,575	245,700,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,712	3,260,704,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,039	2,568,804,000	
日本都市ファンド投資法人 投資証券	20,381	2,252,100,500	
オリックス不動産投資法人 投資証券	8,048	1,570,164,800	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,762	1,108,943,000	
N T T都市開発リート投資法人	3,883	573,130,800	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,708	530,226,400	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,767	303,816,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,093	1,342,126,800	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,887	417,171,500	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,779	766,274,900	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,499	795,969,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,761	424,089,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,724	890,748,000	

有価証券報告書（内国投資信託）

小計	福岡リート投資法人 投資証券	2,089	358,054,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,187	839,209,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,310	283,336,000	
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	844	577,296,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,825	283,605,000	
	スターツプロシード投資法人 投資証券	629	157,816,100	
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	6,089	1,954,569,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,026	904,004,400	
	大和証券リビング投資法人 投資証券	5,465	661,265,000	
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,706	461,026,400	
	銘柄数：61	237,741	45,486,670,100	
	組入時価比率：97.2%		100.0%	
合計		45,486,670,100		

(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 8月17日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	1,271,833,050	—	1,292,988,000	21,084,330
合計	1,271,833,050	—	1,292,988,000	21,084,330

(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 8月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,029,509,429
コール・ローン	52,359,348
投資証券	59,544,628,522
派生商品評価勘定	54,171,224
未収入金	6,856,605
未収配当金	116,750,399
差入委託証拠金	175,409,109
流動資産合計	60,979,684,636
資産合計	
60,979,684,636	
負債の部	
流動負債	
未払金	241,478,897
未払解約金	8,623,011
未払利息	20
その他未払費用	214,700
流動負債合計	250,316,628
負債合計	
250,316,628	
純資産の部	
元本等	
元本	17,353,439,108
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	43,375,928,900
元本等合計	60,729,368,008
純資産合計	
60,729,368,008	
負債純資産合計	
60,979,684,636	

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。 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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	3,4996円
(10,000口当たり純資産額)	(34,996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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスク、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 8月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 8月17日現在	
期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	16,192,356,534円
同期中における追加設定元本額	3,105,238,972円
同期中における一部解約元本額	1,944,156,398円
期末元本額	17,353,439,108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）	1,365,118,744円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	1,785,509,042円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	764,280,372円
野村資産設計ファンド2015	10,851,898円
野村資産設計ファンド2020	11,672,981円
野村資産設計ファンド2025	14,694,689円
野村資産設計ファンド2030	16,316,221円
野村資産設計ファンド2035	16,003,002円
野村資産設計ファンド2040	30,766,861円
野村資産設計ファンド2045	4,319,046円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,630,142,586円
ネクストコア	7,959,226円

野村インデックスファンド・海外5資産バランス	479,456,668円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	516,453,673円
野村資産設計ファンド2050	3,901,560円
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	1,182,209円
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	1,280,077円
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	8,643,816円
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	2,713,410円
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	10,114,050円
野村6資産均等バランス	1,975,421,298円
野村資産設計ファンド2060	2,633,818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	4,772,586,131円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	2,735,070,068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）	791,341,362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）	58,944,830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）	371,072円
野村DC運用戦略ファンド	261,817,411円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	19,438,452円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	8,246,072円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,873,025円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	9,008,727円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	5,512,297円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	5,858,603円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,309,574円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,460,357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）	18,165,880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8月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年8月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	27,800	502,346.00	
		AGREE REALTY CORP	22,800	1,825,824.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	21,300	428,343.00	

ALEXANDERS INC	620	161,020.20	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44,790	7,685,068.20	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,700	50,409.00	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	15,400	470,778.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	89,300	3,449,659.00	
AMERICOLD REALTY TRUST INC	80,700	2,605,803.00	
APARTMENT INCOME REIT CO	47,300	2,181,949.00	
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	46,000	429,640.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	64,200	1,108,092.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	20,000	291,200.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,200	108,100.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,150	9,240,966.00	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7,900	206,032.00	
BOSTON PROPERTIES	42,900	3,853,707.00	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,000	114,800.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	50,000	444,500.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	90,200	2,184,644.00	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	50,800	1,074,928.00	
BRT APARTMENTS CORP	3,500	85,015.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	32,030	4,699,121.30	
CARETRUST REIT INC	29,800	648,150.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,200	260,760.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	4,000	115,800.00	
CENTERSPACE	4,500	400,095.00	
CHATHAM LODGING TRUST	14,700	202,419.00	
CITY OFFICE REIT INC	12,400	162,936.00	
CLIPPER REALTY INC	4,000	36,480.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,200	291,528.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	33,800	935,584.00	
COUSINS PROPERTIES INC	44,300	1,366,212.00	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	5,200	36,504.00	
CTO REALTY GROWTH INC	4,800	104,496.00	
CUBESMART	67,800	3,423,222.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	62,000	617,520.00	

DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	100,000	87,000.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	85,800	11,542,674.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	68,000	128,520.00	
DOUGLAS EMMETT INC	52,400	1,176,904.00	
DUKE REALTY CORP	115,500	7,480,935.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	26,600	514,710.00	
EASTGROUP PROPERTIES	12,620	2,253,174.80	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	42,000	342,300.00	
EPR PROPERTIES	22,400	1,241,184.00	
EQUINIX INC	27,420	19,524,136.80	
EQUITY COMMONWEALTH	33,600	932,736.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,300	4,005,134.00	
EQUITY RESIDENTIAL	103,200	8,273,544.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	42,100	1,055,868.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,630	5,858,966.10	
EXTRA SPACE STORAGE INC	40,490	8,613,842.60	
FARMLAND PARTNERS INC	9,200	137,080.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,500	2,429,930.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	40,000	2,224,000.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	24,500	706,580.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	81,750.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	71,100	3,739,860.00	
GETTY REALTY CORP	11,700	354,861.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,300	237,865.00	
GLADSTONE LAND CORP	9,800	248,920.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	20,000	244,600.00	
GLOBAL NET LEASE INC	31,500	469,980.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	114,000	3,030,120.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	162,200	4,582,150.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,600	113,472.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,300	1,102,073.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	215,900	4,214,368.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	43,400	667,058.00	

INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	66,100	1,483,284.00	
INDUS REALTY TRUST INC	1,800	114,804.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	19,700	184,195.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,500	889,355.00	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20,600	616,764.00	
INVITATION HOMES INC	184,100	7,329,021.00	
IRON MOUNTAIN INC	87,700	4,748,078.00	
JBG SMITH PROPERTIES	32,700	791,340.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	250,000	167,500.00	
KILROY REALTY CORP	31,700	1,693,097.00	
KIMCO REALTY CORP	186,600	4,428,018.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	66,500	1,478,295.00	
LIFE STORAGE INC	25,300	3,443,583.00	
LTC PROPERTIES INC	11,900	527,170.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	87,000	977,010.00	
MACERICH CO /THE	65,000	749,450.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	549,515	299,485.67	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	181,500	3,016,530.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	34,680	6,539,260.80	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	52,700	2,515,898.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	25,200	1,439,172.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,000	917,700.00	
NETSTREIT CORP	14,000	300,160.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,800	431,324.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	14,300	294,580.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	70,900	2,365,933.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,800	131,856.00	
ORION OFFICE REIT INC	18,000	195,660.00	
PARAMOUNT GROUP INC	51,000	401,370.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	70,700	1,128,372.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	39,600	803,880.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,000	6,680.00	
PHILLIPS EDISON & CO INC	33,900	1,169,889.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	67,500	1,223,100.00	

PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	37,500	502,875.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	11,700	253,656.00	
POSTAL REALTY TRUST INC-A	5,500	92,180.00	
PRIME US REIT	170,000	111,350.00	
PROLOGIS INC	222,950	30,568,674.50	
PUBLIC STORAGE	46,010	16,251,652.20	
REALTY INCOME CORP	181,300	13,361,810.00	
REGENCY CENTERS CORP	46,900	3,122,602.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	37,900	698,497.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	49,900	3,396,194.00	
RLJ LODGING TRUST	49,600	664,144.00	
RPT REALTY	26,000	284,960.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,700	1,572,305.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	69,700	1,111,018.00	
SAFEHOLD INC	4,500	203,130.00	
SAUL CENTERS INC	3,900	191,997.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	50,000	408,000.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	99,000	11,337,480.00	
SITE CENTERS CORP	54,500	842,025.00	
SL GREEN REALTY CORP	19,500	991,575.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	40,100	1,787,658.00	
STAG INDUSTRIAL INC	53,500	1,879,990.00	
STORE CAPITAL CORP	76,000	2,220,720.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	34,000	304,640.00	
SUN COMMUNITIES INC	36,540	6,251,994.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	66,000	806,520.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	30,900	555,273.00	
TERRENO REALTY CORP	22,600	1,489,340.00	
THE NECESSITY RETAIL REIT WHERE AMERICA	38,000	305,520.00	
UDR INC	90,400	4,555,256.00	
UMH PROPERTIES INC	14,800	290,820.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,700	207,015.00	
URBAN EDGE PROPERTIES	33,800	585,754.00	
URSTADT BIDDLE-CL A	8,400	155,148.00	

小計	VENTAS INC	120,100	6,078,261.00	
	VERIS RESIDENTIAL INC	23,500	351,325.00	
	VICI PROPERTIES INC	290,300	10,238,881.00	
	VORNADO REALTY TRUST	48,200	1,464,316.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	25,600	553,984.00	
	WELLTOWER INC	136,800	11,034,288.00	
	WHITESTONE REIT	13,000	145,210.00	
	WP CAREY INC	58,200	5,140,806.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	33,500	610,370.00	
	銘柄数：148	7,826,645	345,200,975.17	
	組入時価比率：76.3%		(46,363,942,975)	77.9%
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	19,400	652,616.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	18,000	214,200.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	6,000	79,200.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,800	347,412.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	15,000	57,600.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	25,900	1,236,984.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	47,000	681,970.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	15,400	256,410.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14,600	252,726.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	36,000	468,000.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,700	134,134.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,000	42,680.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	528,660.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,900	809,325.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	41,000	558,010.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	4,000	21,960.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20,800	276,640.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	17,800	322,892.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,000	81,400.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,800	105,154.00	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	8,000	87,920.00	

小計	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	36,000	473,400.00	
	PLAZA RETAIL REIT	12,000	52,680.00	
	PRIMARIS REIT	15,925	236,645.50	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	45,400	976,100.00	
	SLATE GROCERY REIT	8,000	120,880.00	
	SLATE OFFICE REIT	12,000	54,840.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	21,100	627,725.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	28,100	544,016.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	14,000	89,740.00	
	銘柄数：30	559,625	10,391,919.50	
			(1,086,475,183)	
ユーロ	組入時価比率：1.8%		1.8%	
	AEDIFICA	11,700	1,189,890.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,000	52,600.00	
	ALTAREA	1,220	176,168.00	
	BEFIMMO S.C.A.	1,400	66,360.00	
	CARE PROPERTY INVEST	8,000	186,400.00	
	CARMILA	13,000	219,180.00	
	COFINIMMO	8,800	962,720.00	
	COVIVIO	14,300	881,595.00	
	CROMWELL REIT EUR	94,000	200,220.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11,754	274,808.52	
	GECINA SA	16,400	1,623,600.00	
	HAMBORNER REIT AG	22,000	190,960.00	
	ICADE	9,800	478,044.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	18,000	67,500.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	81,000	537,435.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	7,600	204,820.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	135,000	184,410.00	
	KLEPIERRE	58,100	1,320,032.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	20,000	96,900.00	
	MERCIALYS	16,000	145,600.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	100,000	998,000.00	
	MONTEA	3,200	318,080.00	
	NSI NV	5,400	172,260.00	
	RETAIL ESTATES	3,300	227,700.00	

小計	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	35,300	2,121,530.00	
	VASTNED RETAIL NV	5,200	122,980.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	42,300	1,429,740.00	
	WERELDHAVE NV	12,600	193,788.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	6,200	278,380.00	
	銘柄数：29	765,574	14,921,700.52	
			(2,037,558,206)	
英ボンド	組入時価比率：3.4%		3.4%	
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	110,000	86,130.00	
	AEW UK REIT PLC	48,000	56,064.00	
	ASSURA PLC	900,000	631,800.00	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	230,000	258,520.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	51,600	723,432.00	
	BRITISH LAND	285,000	1,365,150.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	248,000	343,976.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	190,000	158,650.00	
	CUSTODIAN REIT PLC	139,000	150,676.00	
	DERWENT LONDON PLC	33,900	920,046.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	172,000	170,280.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	75,000	438,375.00	
	HAMMERSON PLC	1,040,000	265,512.00	
	HOME REIT PLC	242,000	296,208.00	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	124,000	149,296.00	
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	0.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	228,000	1,662,120.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	291,000	711,786.00	
	LXI REIT PLC	573,000	864,084.00	
	NEWRIVER REIT PLC	100,000	86,100.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	170,000	158,610.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	406,000	593,166.00	
	PRS REIT PLC/THE	170,000	185,980.00	
	REGIONAL REIT LTD	120,000	91,560.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	62,900	725,866.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	160,000	90,880.00	

小計	TRUST			
	SEGRO PLC	361,500	3,857,205.00	
	SHAFTESBURY PLC	85,000	398,820.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	378,000	480,060.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	120,000	108,000.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	559,000	1,072,162.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	270,000	207,900.00	
	UNITE GROUP PLC	119,200	1,382,720.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	44,000	255,200.00	
	銘柄数：34	8,290,100	18,946,334.00	
			(3,081,052,835)	
	組入時価比率：5.1%		5.2%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	117,000	334,620.00	
	ARENA REIT	106,000	469,580.00	
	BWP TRUST	145,000	593,050.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	190,000	364,800.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	166,000	502,980.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	139,000	235,605.00	
	CHARTER HALL GROUP	143,000	1,816,100.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	182,000	806,260.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	152,000	608,000.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	104,000	387,920.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	410,000	330,050.00	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	70,000	200,200.00	
	DEXUS/AU	324,000	2,967,840.00	
	GDI PROPERTY GROUP	160,000	148,000.00	
	GOODMAN GROUP	510,600	10,492,830.00	
	GPT GROUP	578,000	2,548,980.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	89,000	331,080.00	
	HEALTHCO REIT	73,000	129,575.00	
	HOME CONSORTIUM LTD	57,000	288,990.00	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	430,000	567,600.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	56,000	179,200.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	114,000	546,060.00	
	MIRVAC GROUP	1,177,000	2,565,860.00	

小計	NATIONAL STORAGE REIT	318,000	775,920.00	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	100,000	84,000.00	
	RURAL FUNDS GROUP	116,000	305,080.00	
	SCENTRE GROUP	1,571,000	4,445,930.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	340,000	965,600.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	725,000	2,755,000.00	
	VICINITY CENTRES	1,177,000	2,412,850.00	
	WAYPOINT REIT	214,000	545,700.00	
	銘柄数：31	10,053,600	39,705,260.00	
	組入時価比率：6.2%		(3,742,220,755)	6.3%
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	240,000	330,000.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	310,000	697,500.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	480,000	494,400.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	390,000	567,450.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	150,000	426,000.00	
	銘柄数：5	1,570,000	2,515,350.00	
	組入時価比率：0.4%		(214,257,513)	0.4%
香港ドル	CHAMPION REIT	600,000	2,154,000.00	
	FORTUNE REIT	430,000	2,924,000.00	
	LINK REIT	634,000	41,146,600.00	
	PROSPERITY REIT	360,000	864,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	290,000	1,087,500.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	689,800	1,731,398.00	
	銘柄数：6	3,003,800	49,907,498.00	
シンガポールドル	組入時価比率：1.4%		(854,915,440)	1.4%
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	130,000	179,400.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,009,762	3,009,090.76	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	569,956	649,749.84	
	CAPITALAND CHINA TRUST	350,279	406,323.64	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,528,694	3,210,257.40	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	260,000	332,800.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	100,000	73,000.00	

小計	EC WORLD REIT	60,000	33,300.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,529,692	650,119.10	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	330,000	211,200.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	356,400	99,792.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	319,838	748,420.92	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	879,746	1,284,429.16	
	IREIT GLOBAL	141,212	84,727.20	
	KEPPEL DC REIT	404,211	820,548.33	
	KEPPEL REIT	590,000	654,900.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	570,000	478,800.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	594,900	1,612,179.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	952,980	1,724,893.80	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	666,716	1,273,427.56	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	690,216	258,831.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	116,000	559,120.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	140,000	111,300.00	
	SPH REIT	290,000	274,050.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	420,000	247,800.00	
	SUNTEC REIT	670,000	1,078,700.00	
	銘柄数：26	13,670,602	20,067,159.71	
			(1,955,143,370)	
	組入時価比率：3.2%		3.3%	
ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,000	74,640,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	42,000	229,320,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,000	51,000,000.00	
	JR REIT XXVII	40,524	192,286,380.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11,445	64,435,350.00	
	LOTTE REIT CO LTD	40,000	204,000,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	30,000	136,800,000.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	8,000	37,240,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	18,000	139,140,000.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	8,000	38,720,000.00	
	SK REITS CO LTD	22,822	125,521,000.00	
	銘柄数：11	246,791	1,293,102,730.00	
小計				

				(132,672,340)	
		組入時価比率：0.2%		0.2%	
	新シェケル	REIT 1 LTD	56,000	1,161,440.00	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	64,000	691,200.00	
	小計	銘柄数：2	120,000	1,852,640.00	
				(76,389,905)	
		組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計				59,544,628,522	
				(59,544,628,522)	

(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 8月17日現在			
	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	1,069,369,504	—	1,123,409,133	54,039,629
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	20,012,085	—	20,143,680	131,595
米ドル	20,012,085	—	20,143,680	131,595
合計	—	—	—	54,171,224

(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。

野村マネー マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2022年 8月17日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,142,572,055
地方債証券	750,551,672
特殊債券	3,162,044,131
社債券	800,970,354
未収利息	7,113,109
前払費用	6,545,524
流動資産合計	7,869,796,845
資産合計	7,869,796,845
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,035,165
未払利息	1,239
流動負債合計	16,036,404
負債合計	16,036,404
純資産の部	
元本等	
元本	7,700,567,267
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	153,193,174
元本等合計	7,853,760,441
純資産合計	7,853,760,441
負債純資産合計	7,869,796,845

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価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 8月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0199円
(10,000口当たり純資産額)	(10,199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 2022年 2月18日 至 2022年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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 8月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法 地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2022年 8月17日現在	
期首	2022年 2月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	7,924,810,012円
同期中における追加設定元本額	1,036,653,602円
同期中における一部解約元本額	1,260,896,347円
期末元本額	7,700,567,267円
期末元本額の内訳＊	
野村世界業種別投資シリーズ（マネープール・ファンド）	441,709,194円
ノムラ・アジア・シリーズ（マネープール・ファンド）	131,774,470円
ネクストコア	2,282,012円
野村世界高金利通貨投信	34,318,227円
野村新世界高金利通貨投信	982,608円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（欧州通貨コース）	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円コース）	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（豪ドルコース）	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）年2回決算型	9,826円
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,260円
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	98,261円
野村日本ブランド株投資（円コース）毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）毎月分配型	98,261円
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）毎月分配型	982,607円
野村日本ブランド株投資（円コース）年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,260円
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608円

野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	98,260円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信（円コース）毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信（中国元コース）毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信（円コース）年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信（米ドルコース）年2回決算型	98,261円
野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	9,826円
野村新エマージング債券投信（中国元コース）年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信（インドネシアルピアコース）年2回決算型	98,261円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（資源国通貨コース）毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（アジア通貨コース）毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（資源国通貨コース）年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（アジア通貨コース）年2回決算型	984,834円
野村アジアC B投信（毎月分配型）	982,608円
野村グローバルC B投信（円コース）毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信（資源国通貨コース）毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信（アジア通貨コース）毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信（円コース）年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信（資源国通貨コース）年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信（アジア通貨コース）年2回決算型	984,543円
ノムラ新興国債券ファンズ（野村SMA向け）	10,000円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（円コース）毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（豪ドルコース）毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（円コース）年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）年2回決算型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（豪ドルコース）年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	984,252円
野村日本ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型	982,609円
野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型	982,609円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）毎月分配型	982,608円

野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）年2回決算型	98,261円
野村米国ブランド株投資（円コース）毎月分配型	98,261円
野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資（円コース）年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型	983,768円
ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド（円コース）年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）年2回決算型	983,672円
野村テンプレトン・トータル・リターン Aコース	983,381円
野村テンプレトン・トータル・リターン Bコース	98,261円
野村テンプレトン・トータル・リターン Cコース	983,381円
野村テンプレトン・トータル・リターン Dコース	983,381円
野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型	98,262円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,609円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）年2回決算型	98,261円
野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	983,091円
野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）年2回決算型	982,898円
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801円
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401円
野村グローバルREITプレミアム（円コース）毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム（円コース）年2回決算型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,608円
野村日本高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,415円
野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）年2回決算型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,029円
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547円

野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547円
野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）毎月分配型	966円
野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）毎月分配型	177,539円
野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	398,357円
野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）毎月分配型	123,377円
野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）毎月分配型	626,503円
野村通貨選択日本株投信（中国元コース）毎月分配型	23,859円
野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型	27,600円
野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型	149,947円
野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）毎月分配型	48,092円
野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）年2回決算型	3,114円
野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）年2回決算型	132,547円
野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	100,946円
野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）年2回決算型	18,851円
野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）年2回決算型	373,897円
野村通貨選択日本株投信（中国元コース）年2回決算型	41,054円
野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）年2回決算型	14,308円
野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）年2回決算型	63,772円
野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）年2回決算型	13,741円
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451円
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451円
ノムラ THE USA Aコース	981,258円
ノムラ THE USA Bコース	981,258円
野村日本ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資（米ドルコース）年2回決算型	9,809円
野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）年2回決算型	9,809円
野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,808円
野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型	9,808円
野村米国ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型	9,807円
野村米国ブランド株投資（米ドルコース）年2回決算型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,807円
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型	9,805円
野村高配当インフラ関連株ファンド（円コース）毎月分配型	9,803円

野村高配当インフラ関連株ファンド（米ドルコース）毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド（通貨セレクトコース）毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド（円コース）年2回決算型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド（米ドルコース）年2回決算型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド（通貨セレクトコース）年2回決算型	9,803円
ノムラ新興国債券ファンズ（野村SMA・EW向け）	9,801円
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド（野村SMA・EW向け）	9,801円
グローバル・ストック Aコース	97,953円
グローバル・ストック Bコース	979,528円
グローバル・ストック Cコース	97,953円
グローバル・ストック Dコース	979,528円
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース（野村SMA・EW向け）	9,794円
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース（野村SMA・EW向け）	9,794円
野村MF S グローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース（野村SMA・EW向け）	9,794円
野村MF S グローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース（野村SMA・EW向け）	9,794円
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795円
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド（為替ヘッジあり）毎月分配型	9,797円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797円
（年3%目標払出）のむラップ・ファンド（普通型）	98,001円
（年6%目標払出）のむラップ・ファンド（普通型）	98,001円
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース	98,011円
野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース	98,011円
野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース	98,020円
野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース	98,020円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30（非課税適格機関投資家専用）	1,248,281,712円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50（適格機関投資家転売制限付）	188,174,367円
野村日経225ターゲット（公社債運用移行型）Hプライス（適格機関投資家専用）	1,503,668,510円
野村日経225ターゲット（公社債運用移行型）Iプライス（適格機関投資家専用）	1,997,050,289円
野村日経225ターゲット（公社債運用移行型）Kプライス（適格機関投資家専用）	1,941,761,887円
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134円
野村DCテンプレート・トータル・リターン Aコース	9,818円
野村DCテンプレート・トータル・リターン Bコース	9,818円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	7,492,405円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式(2022年8月17日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2022年8月17日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	日本円	東京都 公募第7 1 1 回	300,000,000	300,230,514	
		福岡県 公募平成2 4 年度第4 回	50,000,000	50,009,544	
		千葉県 公募平成2 4 年度第5 回	100,000,000	100,079,200	
		共同発行市場地方債 公募第1 1 4 回	300,000,000	300,232,414	
	小計	銘柄数: 4 組入時価比率: 9.6%	750,000,000	750,551,672 15.9%	
	合計			750,551,672	
特殊債券	日本円	日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第9 6 回	300,000,000	300,234,376	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第1 3 回	150,000,000	150,323,781	
		地方公共団体金融機構債券 第4 0 回	110,000,000	110,105,796	
		地方公共団体金融機構債券 第4 1 回	100,000,000	100,150,347	
		地方公共団体金融機構債券 第4 2 回	40,000,000	40,088,573	
		日本政策金融公庫社債 第3 0 回財投機関債	300,000,000	300,469,494	
		都市再生債券 財投機関債第6 8 回	200,000,000	200,168,504	
		都市再生債券 財投機関債第7 1 回	200,000,000	200,138,969	
		住宅金融支援機構債券 財投機関債第1 6 3 回	200,000,000	200,018,166	
		日本学生支援債券 財投機関債第6 0 回	300,000,000	300,000,000	
		日本学生支援債券 財投機関債第6 1 回	100,000,000	100,000,000	
		商工債券 利付第8 1 1 回い号	30,000,000	30,018,656	
		しんきん中金債券 利付第3 3 3 回	200,000,000	200,012,093	
		商工債券 利付（3 年）第2 3 6 回	300,000,000	300,020,256	
		国際協力機構債券 第1 4 回財投機関債	300,000,000	300,234,165	
		東日本高速道路 第4 8 回	100,000,000	100,032,852	
		西日本高速道路 第3 7 回	130,000,000	130,017,143	
		西日本高速道路 第3 8 回	100,000,000	100,010,960	
	小計	銘柄数: 18 組入時価比率: 40.3%	3,160,000,000	3,162,044,131 67.1%	
	合計			3,162,044,131	
社債券	日本円	伊藤忠商事 第6 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,057,500	

小計	東京三菱銀行 第 5 7 回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,420,152	
	三井不動産 第 4 6 回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	200,074,020	
	三菱地所 第 1 1 1 回担保提供制限 等財務上特約無	300,000,000	300,219,242	
	電源開発 第 3 5 回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,199,440	
	銘柄数：5	800,000,000	800,970,354	
	組入時価比率：10.2%		17.0%	
	合計		800,970,354	
合計			4,713,566,157	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ネクストコア

2022年9月30日現在

I 資産総額	1,280,270,578円
II 負債総額	228,220,789円
III 純資産総額（I－II）	1,052,049,789円
IV 発行済口数	1,063,279,226口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	0.9894円

（参考）国内株式マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	496,501,489,809円
II 負債総額	57,683,163,442円
III 純資産総額（I－II）	438,818,326,367円
IV 発行済口数	220,478,154,690口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.9903円

（参考）国内債券マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	25,132,044,812円
II 負債総額	1,629,251,819円
III 純資産総額（I－II）	23,502,792,993円
IV 発行済口数	17,886,074,935口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.3140円

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	1,325,802,115,985円
II 負債総額	5,434,062,495円
III 純資産総額（I－II）	1,320,368,053,490円
IV 発行済口数	299,584,592,002口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	4.4073円

（参考）外国債券マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	681,682,132,604円
II 負債総額	1,575,577,314円
III 純資産総額（I－II）	680,106,555,290円
IV 発行済口数	262,869,060,239口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.5872円

（参考）新興国株式マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	75,679,863,530円
II 負債総額	462,781,788円
III 純資産総額（I－II）	75,217,081,742円
IV 発行済口数	50,486,561,633口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.4898円

（参考）新興国債券マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	27,175,656,910円
II 負債総額	744,500,481円
III 純資産総額（I－II）	26,431,156,429円
IV 発行済口数	14,039,008,814口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.8827円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	7,093,912,501円
II 負債総額	9,436,804円
III 純資産総額（I－II）	7,084,475,697円
IV 発行済口数	4,950,199,186口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.4311円

（参考）J－REITインデックス マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	46,553,213,172円
II 負債総額	1,695,662,533円
III 純資産総額（I－II）	44,857,550,639円
IV 発行済口数	16,736,966,479口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.6801円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	53,310,327,978円
II 負債総額	486,087,559円
III 純資産総額（I－II）	52,824,240,419円
IV 発行済口数	17,847,544,796口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	2.9597円

（参考）野村マネー マザーファンド

2022年9月30日現在

I 資産総額	8,435,885,642円
II 負債総額	600,932,244円
III 純資産総額（I－II）	7,834,953,398円
IV 発行済口数	7,682,461,508口
V 1口当たり純資産額（III／IV）	1.0198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わないものとします。

(2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3)受益権の譲渡

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

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

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

(4)受益権の譲渡の対抗要件

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

(5)受益権の再分割

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

(6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2022年9月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間に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。

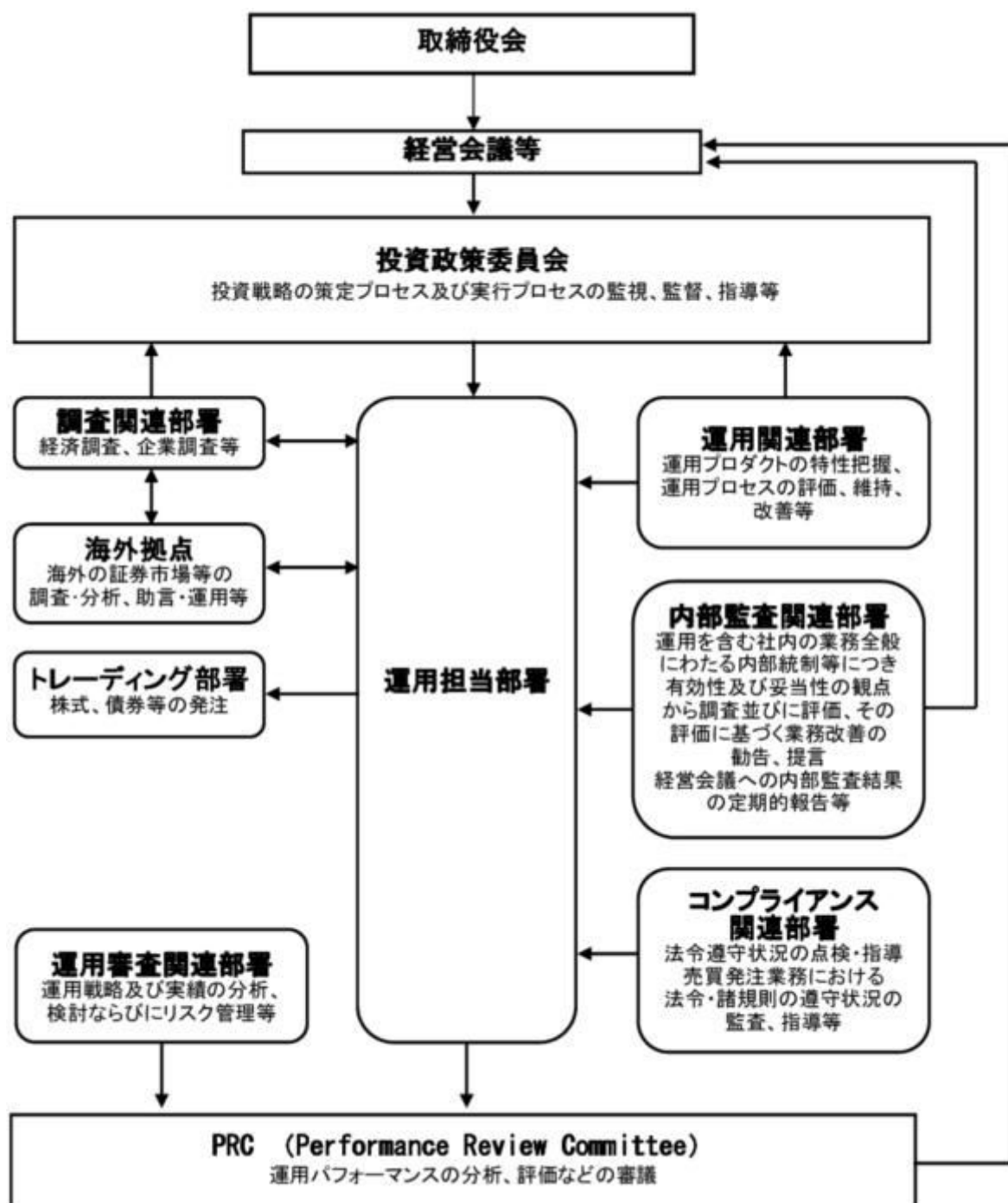
代表取締役・業務執行取締役

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8月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

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

追加型株式投資信託	1,012	39,323,903
単位型株式投資信託	197	746,384
追加型公社債投資信託	14	6,413,724
単位型公社債投資信託	497	1,315,914
合計	1,720	47,799,926

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
31.0%	31.0%
0.0%	0.0%
△3.5%	△2.9%
1.9%	1.8%
△0.5%	△0.5%
0.2%	0.4%
0.3%	0.1%
29.4%	29.9%

◇ 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8月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社 S M B C日興証券株式会社 株式会社S B I証券 a uカブコム証券株式会社 ぐんぎん証券株式会社 七十七証券株式会社 東海東京証券株式会社 ひろぎん証券株式会社 F F G証券株式会社 マネックス証券株式会社 楽天証券株式会社	10,000百万円 10,000百万円 48,323百万円 7,196百万円 3,000百万円 3,000百万円 6,000百万円 5,000百万円 3,000百万円 12,200百万円 19,495百万円	「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。
株式会社愛知銀行 株式会社青森銀行 株式会社足利銀行 株式会社イオン銀行 株式会社大分銀行 株式会社紀陽銀行 株式会社関西みらい銀行 株式会社熊本銀行 株式会社佐賀銀行 株式会社七十七銀行 株式会社十八親和銀行	18,000百万円 19,562百万円 135,000百万円 51,250百万円 19,598百万円 80,096百万円 38,971百万円 33,847百万円 16,062百万円 24,658百万円 36,878百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

株式会社十六銀行	36,839百万円
株式会社常陽銀行	85,113百万円
株式会社第四北越銀行	32,776百万円
株式会社但馬銀行	5,481百万円
株式会社千葉銀行	145,069百万円
株式会社きらぼし銀行	43,734百万円
株式会社南都銀行	37,900百万円
株式会社百五銀行	20,000百万円
株式会社広島銀行	54,573百万円
株式会社福井銀行	17,965百万円
株式会社福岡銀行	82,329百万円
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円
株式会社琉球銀行	56,967百万円

＊2022年8月末現在

2 【関係業務の概要】

(1) 受託者

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

(2) 販売会社

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

3 【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2022年 5月12日	有価証券届出書
2022年 5月12日	有価証券報告書

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に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10月25日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

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」に掲げられているネクストコアの2022年2月18日から2022年8月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ネクストコアの2022年8月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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。