

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年11月29日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 小池 広靖
【本店の所在の場所】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村インデックスファンド・海外5資産バランス
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

野村インデックスファンド・海外5資産バランス

（ファンドの愛称を「Funds-i 海外5資産バランス」とします。なお、「ファンド」という場合、または「野村Funds-i 海外5資産バランス」という場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

■信用格付■

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

2兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、純資産総額をその時の受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口あたりの価額で表示されます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（５）【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.00%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得

た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

（６）【申込単位】

1万口以上1万口単位(当初元本1口＝1円)または1万円以上1円単位

分配金を再投資する場合には1口単位となります。

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

（７）【申込期間】

2022年11月30日から2023年11月29日まで

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

（８）【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（９）【払込期日】

販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（１０）【払込取扱場所】

申込代金は申込みの販売会社にお支払いください。払込取扱場所についてご不明の場合は、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（ １ １ ） 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ １ ２ ） 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

外国および新興国の各株式、外国および新興国の各債券、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、信託財産の成長を目的に運用を行なうことを基本とします。

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

■ 信託金の限度額 ■

受益権の信託金限度額は1兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができません。

< 商品分類 >

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

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

（野村インデックスファンド・海外5資産バランス）

《商品分類表》

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

《属性区分表》

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を除く)			
	年2回				
	年4回	日本			日経225
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 ()	
	年12回 (毎月)	欧州			T O P I X
	日々	アジア			
不動産投信	日々	オセアニア			
	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (合成指数)
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券、不動産投 信)資産配分固定 型))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

< 商品分類表定義 >

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

〔投資形態による属性区分〕

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

〔為替ヘッジによる属性区分〕

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

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

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

〔特殊型〕

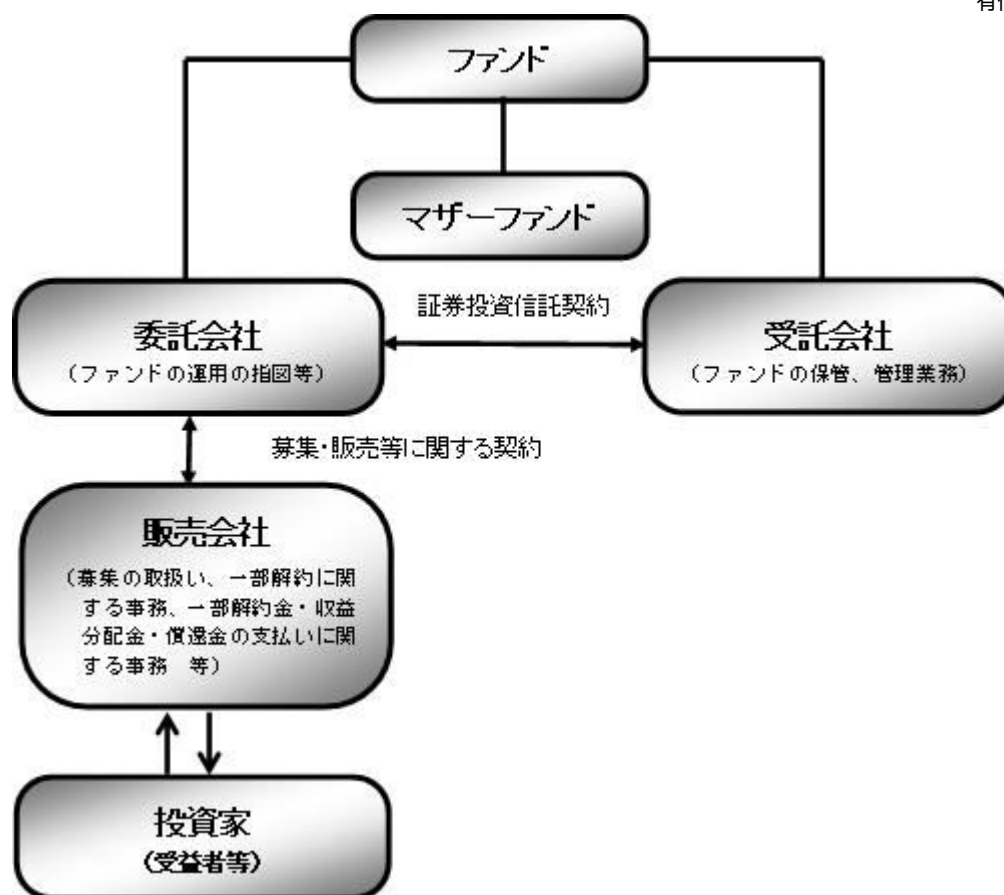
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

(2)【ファンドの沿革】

2013年9月12日

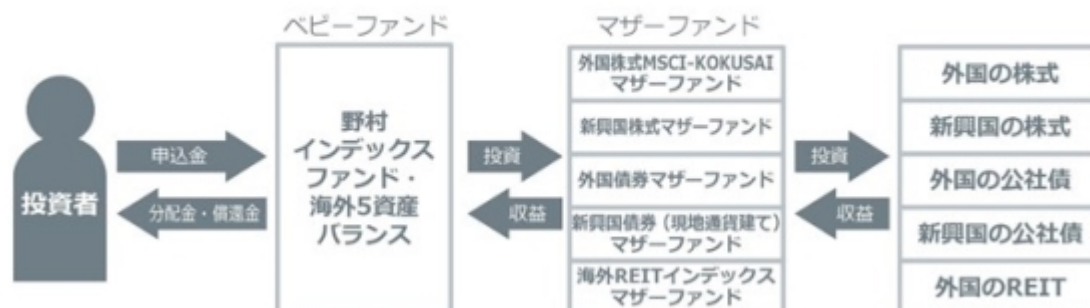
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



ファンド	野村インデックスファンド・海外5資産バランス
マザーファンド (親投資信託)	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 外国債券マザーファンド 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド 海外REITインデックス マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

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



■ 委託会社の概況(2022年10月末現在) ■

・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

・ 資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村

アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

〔1〕ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は、以下を基本（「基本投資割合」といいます。）とし、原則として毎月、リバランスを行ない、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

マザーファンド名	基本投資割合	主要投資対象	対象指数
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1/6	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし） ^{*1}
新興国株式マザーファンド	1/6	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}
外国債券マザーファンド	1/6	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1/6	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・マーケット・グローバル・ディバースィファイド（円換算ベース） ^{*3}
海外REITインデックス マザーファンド	1/3	日本を除く世界各国のREIT ²	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） ^{*4}

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。

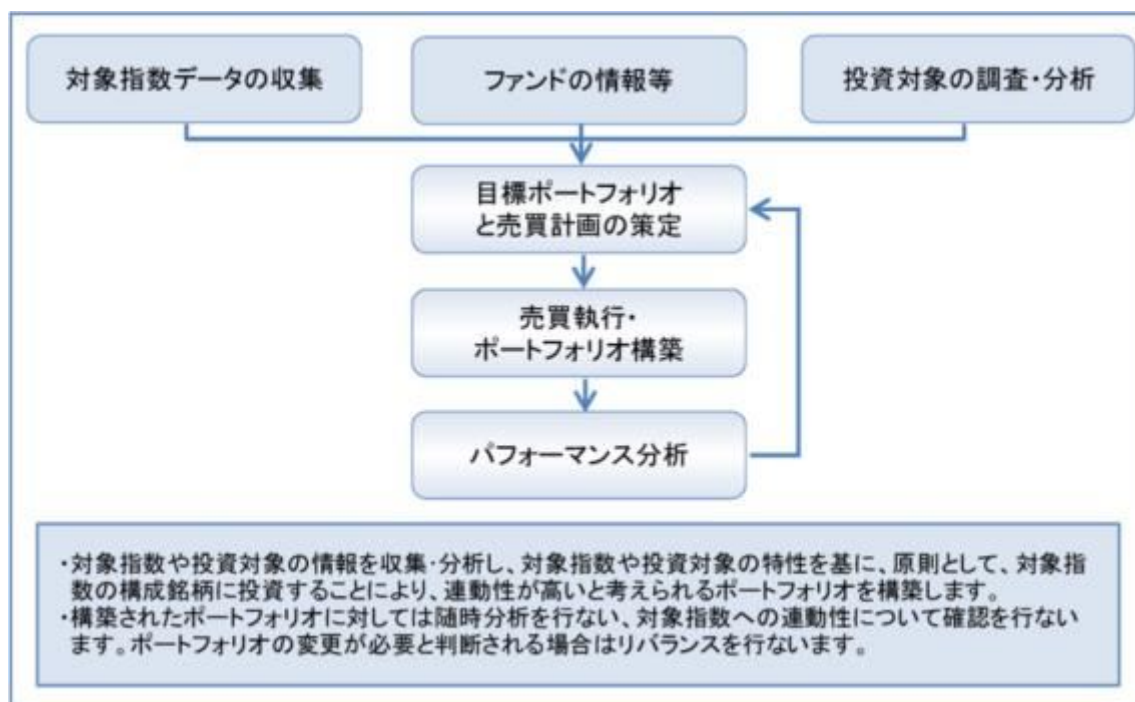
2 海外の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

*1 MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）は、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドの運用の基本方針における「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」と同一の指数です。

*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 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。
- *4 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。

■投資プロセス■



* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

[2] 合成指数の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、有価証券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引を実質的に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的または為替相場等の変動リスクを減じる目的で、ヘッジ目的外の利用も含め実質的に活用する場合があります。

[3] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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。

■各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について■

- MSCI-KOKUSAI指数(円換算ベース・為替ヘッジなし)
- 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)

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入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、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

換算ベース)

本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含みますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できるものですが、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・メイカーとして行っている可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

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

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

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

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

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

○ S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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。

(2) 【投資対象】

外国および新興国の各株式、外国および新興国の各債券、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す。

ファンドは、「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」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」の各受益証券を主要投資対象とします。

■ 各マザーファンドの主要投資対象 ■

マザーファンド名	主要投資対象
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式
新興国株式マザーファンド	新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)
外国債券マザーファンド	外国の公社債
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債
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

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、後述の「（５）投資制限」、および「」に定めるものに限りま。

ハ 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

- 2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

ロ 次に掲げるものをすべてみたす資産

・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・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

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、外国債券マザーファンド、新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド、および海外REITインデックス マザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。）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プリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの

- 14．前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
- 15．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 16．投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 17．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 18．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
- 19．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 21．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 22．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
- 23．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

金融商品の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、上記「有価証券の指図範囲等」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 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 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 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 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 各号以外のもの
- 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²5 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

（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

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

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。

同一銘柄の株式への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。

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。

(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

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。

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。

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

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への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。

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。

（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

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（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

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。

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。

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

外貨建資産への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。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（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

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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。

(3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

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。

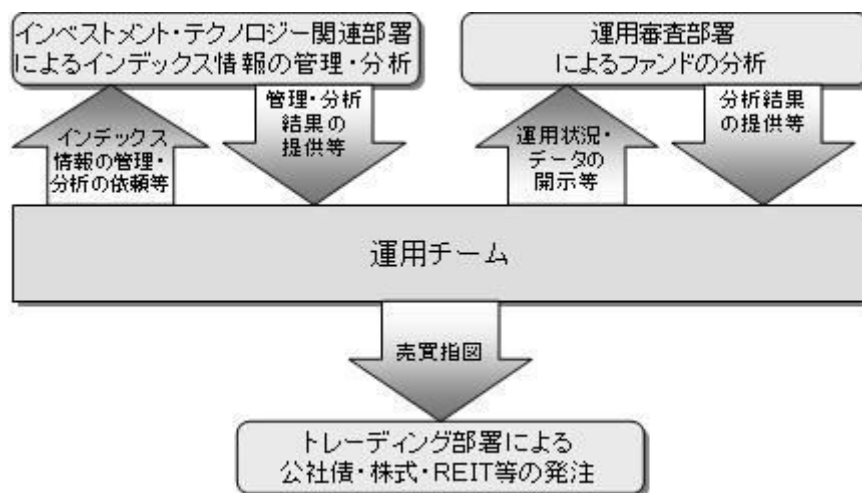
同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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。

（３）【運用体制】

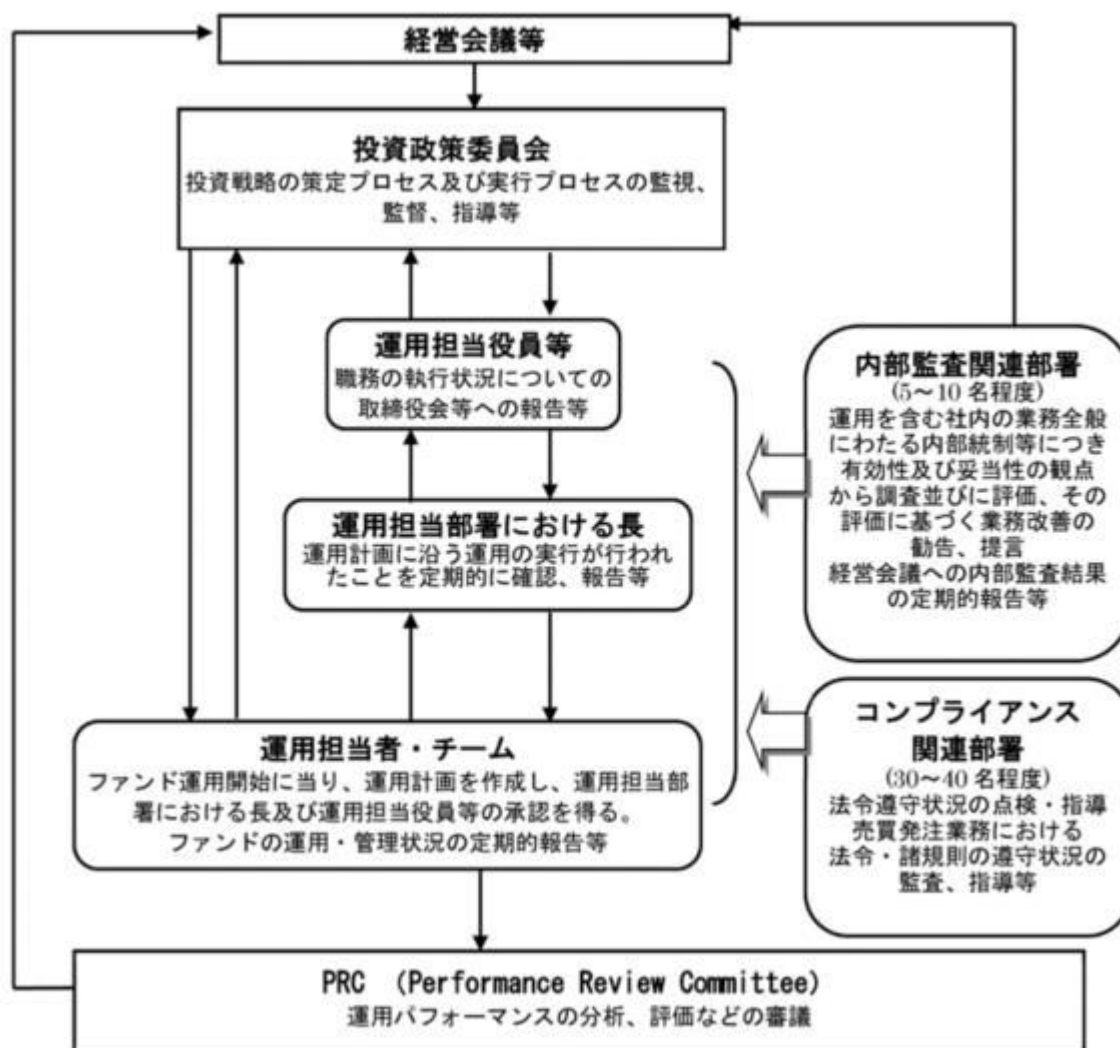
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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。

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。

収益分配金額は、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。

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

* 委託会社の判断により分配を行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9月6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】

運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 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。

投資する株式等の範囲(信託約款)

- () 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。
- () 上記()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。

信用取引の指図範囲(信託約款)

- () 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。
- () 上記()の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）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

先物取引等の運用指図(信託約款)

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

- () 上記()の店頭オプション取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- () 委託者は、上記()の店頭オプション取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

スワップ取引の運用指図(信託約款)

- () 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。
- () 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。
- () 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。
- () 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。

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- () 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。
- () 上記()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。
- () 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。

公社債の借入れ(信託約款)

- () 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。
- () 上記()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。
- () 信託財産の一部解約等の事由により、上記()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。
- () 上記()の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

- () 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。

- ()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。
- ()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。
- ()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。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券（外国通貨表示の有価証券をいいます。）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。

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

- ()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。
- ()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。
- ()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。
- ()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。

資金の借入れ(信託約款)

- ()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。
- ()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。
- ()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。
- ()借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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()の数が()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。

- ()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
- ()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^{（注）}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、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止等となる可能性、換金代金の支払いが遅延する可能性等があります。
- 資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。
- 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- ファンドの基準価額と対象指数（合成指数）は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。

せん。また、ファンドの投資成果が合成指数に連動または上回ることを保証するものではありません。

- 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。
- ファンドが実質的な投資対象とするREITの中には、流動性の低いものもあり、こうしたREITへの投資は、流動性の高い株式等に比べて制約を受けることが想定されます。
- REITに関する法律（税制度、会計制度等）、不動産を取り巻く規制が変更となった場合、REITの価格や配当に影響が及ぶことが想定されます。
- ファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。
- 金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入・換金の各受付けを中止すること、およびすでに受付けた購入・換金の各受付けを取り消す場合があります。
- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

パフォーマンスの考査

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

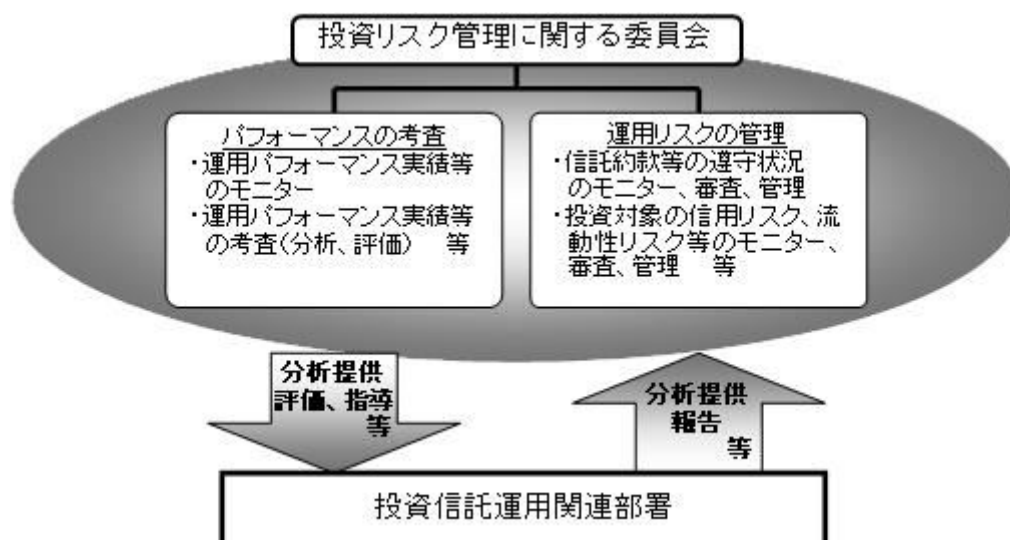
運用リスクの管理

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

流動性リスク管理について

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

リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。



投資リスク

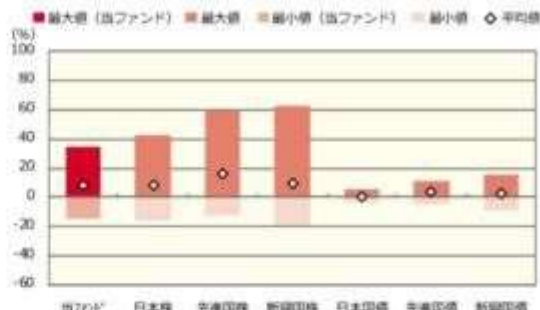
■ リスクの定量的比較（2017年10月末～2022年9月末：月次）

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



2017年10月 2018年9月 2019年9月 2020年9月 2021年9月 2022年9月

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



当ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

	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 (%)	34.8	42.1	59.8	62.7	5.4	11.4	15.7
最小値 (%)	△ 14.6	△ 16.0	△ 12.4	△ 19.4	△ 3.7	△ 4.5	△ 9.4
平均値 (%)	7.8	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・カバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・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）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標章又は商標は、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）に係る標章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。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・カバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・カバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイス等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、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSEC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての提供、保障または販売促進を行います。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または承認を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMSEC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA、JPMI、J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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2.00%）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。なお、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。

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、信託財産の純資産総額に年0.66%（税抜年0.60%）以内（2022年11月29日現在 年0.66%（税抜年0.60%））の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年0.28%	年0.28%	年0.04%

* 上記配分は、2022年11月29日現在の信託報酬率における配分です。

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

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】

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

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う債権回収に要する弁護士費用等を含みます。）および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額

は、信託報酬支払いのときに信託財産中から支払われます。

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

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

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■ 換金（解約）時および償還時の課税について ■

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

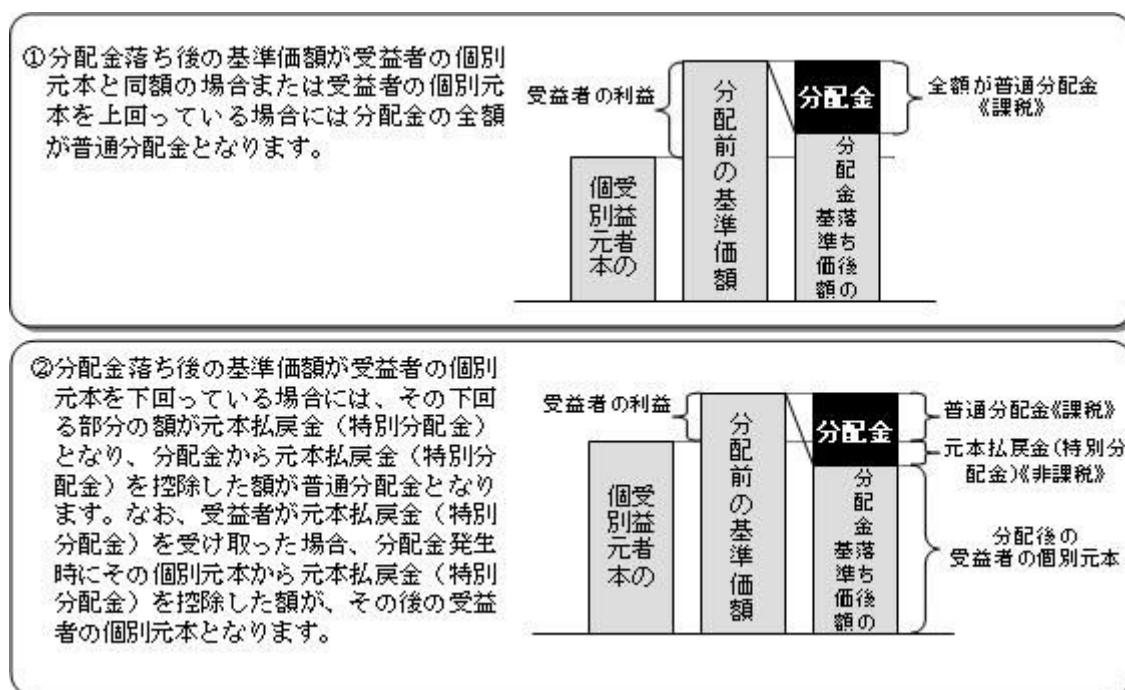
■ 個別元本について ■

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

■ 分配金の課税について ■

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



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】

野村インデックスファンド・海外５資産バランス

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	4,663,251,216	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	4,702,140	0.10
合計（純資産総額）		4,667,953,356	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）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）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）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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村インデックスファンド・海外５資産バランス

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	海外REITインデックス マ ザーファンド	497,369,402	3.3030	1,642,818,136	2.9597	1,472,064,219	31.53
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	317,004,268	2.6203	830,672,700	2.5872	820,153,442	17.56
3	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	572,023,739	1.4596	834,957,969	1.4311	818,623,172	17.53
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマ ザーファンド	178,669,931	4.6131	824,228,576	4.4073	787,451,986	16.86
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	513,463,819	1.5953	819,163,232	1.4898	764,958,397	16.38

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.89
合 計	99.89

（参考）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）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 AUCITS 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）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 TESOURO 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 TESOURO 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 TESOURO 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 TESOURO 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 TESOURO 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 TESOURO 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）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

【投資不動産物件】

野村インデックスファンド・海外5資産バランス

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村インデックスファンド・海外5資産バランス

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

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	SP1200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）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）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（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

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

野村インデックスファンド・海外５資産バランス

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	(2014年 9月 8日)	370	370	1.1988	1.1988
第2計算期間	(2015年 9月 7日)	955	955	1.1844	1.1844
第3計算期間	(2016年 9月 6日)	1,148	1,148	1.1966	1.1966
第4計算期間	(2017年 9月 6日)	1,268	1,268	1.3396	1.3396
第5計算期間	(2018年 9月 6日)	1,571	1,571	1.3748	1.3748
第6計算期間	(2019年 9月 6日)	1,920	1,920	1.4229	1.4229
第7計算期間	(2020年 9月 7日)	2,407	2,407	1.4222	1.4222
第8計算期間	(2021年 9月 6日)	3,390	3,390	1.7870	1.7870
第9計算期間	(2022年 9月 6日)	4,914	4,914	1.8576	1.8576
	2021年 9月末日	3,339	—	1.7366	—
	10月末日	3,547	—	1.8264	—
	11月末日	3,529	—	1.7945	—
	12月末日	3,715	—	1.8587	—

2022年 1月末日	3,616	—	1.7811	—
2月末日	3,708	—	1.7651	—
3月末日	4,124	—	1.8955	—
4月末日	4,337	—	1.8769	—
5月末日	4,419	—	1.8313	—
6月末日	4,676	—	1.8277	—
7月末日	4,861	—	1.8600	—
8月末日	4,891	—	1.8632	—
9月末日	4,667	—	1.7487	—

【分配の推移】

野村インデックスファンド・海外 5 資産バランス

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2013年 9月12日～2014年 9月 8日	0.0000円
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	0.0000円
第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	0.0000円
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	0.0000円
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	0.0000円
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	0.0000円
第7計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	0.0000円
第8計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	0.0000円
第9計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 6日	0.0000円

【収益率の推移】

野村インデックスファンド・海外 5 資産バランス

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 9月12日～2014年 9月 8日	19.9%
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	1.2%
第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	1.0%
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	12.0%
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	2.6%
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	3.5%
第7計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	0.0%
第8計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	25.7%
第9計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 6日	4.0%

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

（４）【設定及び解約の実績】

野村インデックスファンド・海外５資産バランス

	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 9月12日～2014年 9月 8日	395,745,491	86,381,200	309,364,291
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	906,155,539	408,381,112	807,138,718
第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	292,583,145	139,766,859	959,955,004
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	302,213,416	314,884,385	947,284,035
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	493,990,022	297,907,683	1,143,366,374
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	451,040,057	244,895,168	1,349,511,263
第7計算期間	2019年 9月 7日～2020年 9月 7日	682,842,826	339,267,398	1,693,086,691
第8計算期間	2020年 9月 8日～2021年 9月 6日	638,979,217	434,718,250	1,897,347,658
第9計算期間	2021年 9月 7日～2022年 9月 6日	1,130,649,254	382,358,166	2,645,638,746

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9月	0 円
2021年9月	0 円
2020年9月	0 円
2019年9月	0 円
2018年9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（％）
外国株式MSCI-KOKUSAマザーファンド	16.9
新興国株式マザーファンド	16.4
外国債券マザーファンド	17.6
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	17.5
海外REITインデックス マザーファンド	31.5

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「外国株式MSCI-KOKUSA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	0.9
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.6
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.4
4	TESLA INC	自動車	0.3
5	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.2

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.9
2	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	—	0.7
3	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.6
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.5
5	ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	インターネット販売・通信販売	0.4

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.6
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.5
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.3
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.3
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.3



運用実績（2022年9月30日現在）

・「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	0.5
2	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4
3	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4
4	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.3
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.3

・「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	2.0
2	EQUINIX INC	投資証券	1.4
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	1.2
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	1.0
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.8

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。
- ・2013年は設定日（2013年9月12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】

(1) 受益権の募集

申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。

(2) 申込締切時間

午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付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。

(3) 申込不可日

販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得の申込みができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）

申込日当日あるいは申込日の翌営業日が、下記のいずれかの休業日に該当する場合

・ニューヨーク証券取引所 ・ニューヨークの銀行

(4) 販売単位

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（分配金を再投資する場合には1口単位）とします。

(5) 販売価額

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

(6) 申込代金の支払い

販売会社の定める期日までに支払うものとします。

(7) 積立方式

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

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

(8) 申込受け付けの中止および取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、受益権の取得申込の受付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場合があります。

(9) 申込手続等に関する照会先

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

購入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】

(1)解約の請求

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。

(2)解約請求の締切時間

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

(3)申込不可日

販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求ができません。(申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。)

(4)換金単位

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。

(5)換金価額

解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額を差し引いた価額となります。

(6)換金制限

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。

(7)換金代金の支払い

原則として一部解約の実行の請求日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。

ただし、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、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

(8)解約請求の受け付けの中止および取り消し

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、一部解約の実行の請求の受け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け付けを取り消す場合があります。

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

(9)換金手続等に関する照会先

ファンドの換金（解約）手続等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/>

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 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 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） 価格情報会社の提供する価額
REIT (不動産投資信託)	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。

外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。
-------	-----------------------------------

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

無期限とします(2013年9月12日設定)。

（４）【計算期間】

原則として、毎年9月7日から翌年9月6日までとします。

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

ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

（a）ファンドの繰上償還条項

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

（b）信託期間の終了

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

（ ）上記（ ）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。以下本項において同じ。）は

受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更

- () 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。
- () 委託者は、上記()の事項(上記()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っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- () 上記()の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- () 上記()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。
- () 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。
- () 上記()から()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。

- () 上記()から()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

- () 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。

- () 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。

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

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下さい。

累積投資契約を結んでいる場合には、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

■ 収益分配金請求権の失効 ■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

■ 償還金の支払い開始日 ■

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

■ 償還金請求権の失効 ■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

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9期計算期間(2021年9月7日から2022年9月6日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【野村インデックスファンド・海外５資産バランス】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第8期 (2021年 9月 6日現在)	第9期 (2022年 9月 6日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	19,095,562	22,864,235
親投資信託受益証券	3,387,158,992	4,909,618,207
流動資産合計	3,406,254,554	4,932,482,442
資産合計	3,406,254,554	4,932,482,442
負債の部		
流動負債		
未払解約金	5,522,303	3,164,619
未払受託者報酬	676,112	983,053
未払委託者報酬	9,465,509	13,762,664
未払利息	14	23
その他未払費用	50,649	73,669
流動負債合計	15,714,587	17,984,028
負債合計	15,714,587	17,984,028
純資産の部		
元本等		
元本	1,897,347,658	2,645,638,746
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,493,192,309	2,268,859,668
（分配準備積立金）	660,646,781	699,760,176
元本等合計	3,390,539,967	4,914,498,414
純資産合計	3,390,539,967	4,914,498,414
負債純資産合計	3,406,254,554	4,932,482,442

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日	第9期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6日
営業収益		
有価証券売買等損益	659,677,722	187,200,930
その他収益	-	511
営業収益合計	659,677,722	187,201,441
営業費用		
支払利息	4,301	3,446
受託者報酬	1,234,057	1,765,615
委託者報酬	17,276,593	24,718,474
その他費用	92,434	132,298
営業費用合計	18,607,385	26,619,833
営業利益又は営業損失（ ）	641,070,337	160,581,608
経常利益又は経常損失（ ）	641,070,337	160,581,608
当期純利益又は当期純損失（ ）	641,070,337	160,581,608
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（ ）	64,700,711	14,727,407
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	714,854,187	1,493,192,309
剰余金増加額又は欠損金減少額	391,415,181	931,093,091
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	391,415,181	931,093,091
剰余金減少額又は欠損金増加額	189,446,685	301,279,933
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	189,446,685	301,279,933
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,493,192,309	2,268,859,668

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１．運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
２．費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
４．その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2021年 9月 7日から2022年 9月 6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8期 2021年 9月 6日現在	第9期 2022年 9月 6日現在
１． 計算期間の末日における受益権の総数 1,897,347,658口	１． 計算期間の末日における受益権の総数 2,645,638,746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 1.7870円 (10,000口当たり純資産額) (17,870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 1.8576円 (10,000口当たり純資産額) (18,576円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日	第9期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>80,352,274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>449,842,802円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>832,545,528円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>130,451,705円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>1,493,192,309円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,897,347,658口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>7,869円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>0円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	80,352,274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	449,842,802円	収益調整金額	C	832,545,528円	分配準備積立金額	D	130,451,705円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,493,192,309円	当ファンドの期末残存口数	F	1,897,347,658口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,869円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円	<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>111,610,571円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>34,243,630円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,569,099,492円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>553,905,975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>2,268,859,668円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>2,645,638,746口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>8,575円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>0円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	111,610,571円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	34,243,630円	収益調整金額	C	1,569,099,492円	分配準備積立金額	D	553,905,975円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,268,859,668円	当ファンドの期末残存口数	F	2,645,638,746口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,575円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	80,352,274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	449,842,802円																																																											
収益調整金額	C	832,545,528円																																																											
分配準備積立金額	D	130,451,705円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,493,192,309円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,897,347,658口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	7,869円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	111,610,571円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	34,243,630円																																																											
収益調整金額	C	1,569,099,492円																																																											
分配準備積立金額	D	553,905,975円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,268,859,668円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,645,638,746口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	8,575円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日	第9期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(2)金融商品の時価等に関する事項

第8期 2021年 9月 6日現在	第9期 2022年 9月 6日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 2.時価の算定方法

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日	第9期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6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8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日	第9期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6日
期首元本額 1,693,086,691円	期首元本額 1,897,347,658円
期中追加設定元本額 638,979,217円	期中追加設定元本額 1,130,649,254円
期中一部解約元本額 434,718,250円	期中一部解約元本額 382,358,166円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第8期 自 2020年 9月 8日 至 2021年 9月 6日	第9期 自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6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	596,231,452	161,537,590
合計	596,231,452	161,537,590

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年9月6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9月6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	外国債券マザーファンド	314,184,267	823,288,453	
		外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド	177,127,491	816,982,839	
		海外REITインデックス マザーファンド	493,159,171	1,629,102,005	
		新興国株式マザーファンド	508,960,546	811,995,655	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	567,449,476	828,249,255	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：99.9%	2,060,880,951	4,909,618,207 100.0%	
合計				4,909,618,207	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「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」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」および「海外REITインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2022年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	10,484,642,416
コール・ローン	2,657,042,609
株式	1,313,189,383,775
投資証券	33,790,802,738
派生商品評価勘定	7,429,197
未収入金	89,545,530
未収配当金	2,662,395,320
差入委託証拠金	5,470,793,181

(2022年 9月 6日現在)

流動資産合計	1,368,352,034,766
資産合計	1,368,352,034,766
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	700,057,563
未払金	625,287,224
未払解約金	143,949,946
未払利息	2,724
その他未払費用	5,921,300
流動負債合計	1,475,218,757
負債合計	1,475,218,757
純資産の部	
元本等	
元本	296,346,833,540
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,070,529,982,469
元本等合計	1,366,876,816,009
純資産合計	1,366,876,816,009
負債純資産合計	1,368,352,034,766

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

2022年 9月 6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	4.6124円
(10,000口当たり純資産額)	(46,124円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2021年 9月 7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	258,011,264,881円
同期中における追加設定元本額	61,697,142,310円
同期中における一部解約元本額	23,361,573,651円
期末元本額	296,346,833,540円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	30,033,839円
バランスセレクト50	91,495,693円
バランスセレクト70	113,002,796円
野村外国株インデックスファンド	494,617,833円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,004,347,516円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,907,772,713円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	3,972,634,586円
野村資産設計ファンド2015	9,218,014円
野村資産設計ファンド2020	9,914,239円
野村資産設計ファンド2025	16,413,430円
野村資産設計ファンド2030	25,337,520円
野村資産設計ファンド2035	23,067,757円
野村資産設計ファンド2040	42,264,640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）	46,126,461,050円
のむラップ・ファンド（保守型）	881,737,181円
のむラップ・ファンド（普通型）	10,879,195,014円
のむラップ・ファンド（積極型）	11,074,204,778円
野村資産設計ファンド2045	8,775,020円
野村インデックスファンド・外国株	7,911,138,574円
マイ・ロード	1,008,671,524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	177,127,491円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	2,765,131,696円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	279,665,919円
野村資産設計ファンド2050	10,689,960円

野村ターゲットデートファンド2016	2026 - 2028年目標型	2,930,528円
野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	1,755,192円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	1,388,629円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	1,204,359円
のむラップ・ファンド（やや保守型）		234,062,474円
のむラップ・ファンド（やや積極型）		952,729,560円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		2,216,077円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		2,636,212円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		27,497,170円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		7,974,346円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		35,925,278円
野村6資産均等バランス		1,485,444,250円
野村つみたて外国株投信		12,349,858,972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）		5,050,252,123円
世界6資産分散ファンド		38,646,694円
野村資産設計ファンド2060		7,837,852円
野村スリーゼロ先進国株式投信		1,103,114,215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		7,012,995,365円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式		5,951,379,446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）		119,644,248円
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）		61,338,299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）		494,392,325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）		494,559,512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）		1,032,366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）		4,128,781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）		717,718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）		713,887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）		11,111,462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）		362,162,271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）		4,367,749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）		26,283,310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）		81,552,005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）		2,110,510,820円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）		19,453,123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）		1,232,896,890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）		11,517,154,555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）		1,082,151円
先進8カ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）		7,625,361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）		8,671,603円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）		8,167,097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）		90,293,480,470円
マイバランス30（確定拠出年金向け）		2,041,152,395円

マイバランス５０（確定拠出年金向け）	7,727,032,084円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	7,553,080,522円
マイバランスＤＣ３０	811,737,454円
マイバランスＤＣ５０	1,798,320,755円
マイバランスＤＣ７０	1,664,538,272円
野村ＤＣ外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	38,319,801,984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）	411,069,907円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	340,183,738円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	352,224,748円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	18,321,945円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	8,546,544円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	46,478,949円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてNISA）２０３０	8,694,107円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてNISA）２０４０	8,244,174円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてNISA）２０５０	6,417,564円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	201,540,750円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	160,188,549円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	96,140,369円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	127,077,459円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてNISA）２０６０	4,560,984円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	37,360,247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）	100,658,095円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	50,230,319円
野村ＤＣバランスファンド（年金運用戦略タイプ）	55,477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9月6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	204,000	25.28	5,157,120.00	
		HALLIBURTON CO	187,000	30.01	5,611,870.00	
		SCHLUMBERGER LTD	286,000	38.07	10,888,020.00	
		APA CORPORATION	67,000	38.80	2,599,600.00	
		CHENIERE ENERGY INC	46,900	162.36	7,614,684.00	
		CHEVRON CORP	381,400	157.85	60,203,990.00	
		CONOCOPHILLIPS	264,300	110.26	29,141,718.00	

COTERRA ENERGY INC	162,000	30.11	4,877,820.00	
DEVON ENERGY CORP	128,100	70.34	9,010,554.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	35,100	133.87	4,698,837.00	
EOG RESOURCES INC	119,200	121.52	14,485,184.00	
EQT CORP	66,000	47.28	3,120,480.00	
EXXON MOBIL CORP	860,800	95.59	82,283,872.00	
HESS CORP	57,900	120.91	7,000,689.00	
KINDER MORGAN INC	421,000	18.22	7,670,620.00	
MARATHON OIL CORP	148,000	25.71	3,805,080.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	111,300	99.13	11,033,169.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	192,600	68.77	13,245,102.00	
ONEOK INC	90,900	60.55	5,503,995.00	
PHILLIPS 66	97,300	88.46	8,607,158.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	46,700	241.76	11,290,192.00	
TARGA RESOURCES CORP	45,100	69.62	3,139,862.00	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1,270	1,888.01	2,397,772.70	
VALERO ENERGY CORP	84,000	113.82	9,560,880.00	
WILLIAMS COS	251,000	33.72	8,463,720.00	
AIR PRODUCTS	45,600	246.53	11,241,768.00	
ALBEMARLE CORP	23,600	259.88	6,133,168.00	
CELANESE CORP-SERIES A	22,800	106.88	2,436,864.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	43,400	106.86	4,637,724.00	
CORTEVA INC	147,400	61.24	9,026,776.00	
DOW INC	147,800	49.31	7,288,018.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	103,300	54.76	5,656,708.00	
EASTMAN CHEMICAL CO.	27,200	89.52	2,434,944.00	
ECOLAB INC	53,000	161.64	8,566,920.00	
FMC CORP	24,800	106.44	2,639,712.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	51,300	107.83	5,531,679.00	
LINDE PLC	102,700	277.71	28,520,817.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	53,600	80.78	4,329,808.00	
MOSAIC CO/THE	76,000	54.84	4,167,840.00	
PPG INDUSTRIES	47,600	123.76	5,890,976.00	
RPM INTERNATIONAL INC	25,800	92.53	2,387,274.00	
SHERWIN-WILLIAMS	50,400	231.81	11,683,224.00	

WESTLAKE CORPORATION	7,500	95.76	718,200.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	12,800	340.60	4,359,680.00	
VULCAN MATERIALS CO	27,300	164.95	4,503,135.00	
AMCOR PLC	300,000	12.02	3,606,000.00	
AVERY DENNISON CORP	16,900	185.48	3,134,612.00	
BALL CORP	65,000	55.81	3,627,650.00	
CROWN HOLDINGS INC	24,700	91.37	2,256,839.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	73,000	40.93	2,987,890.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	18,800	136.11	2,558,868.00	
SEALED AIR CORP	29,400	52.86	1,554,084.00	
WESTROCK CO	52,000	39.64	2,061,280.00	
ALCOA CORP	35,700	49.25	1,758,225.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	102,000	16.81	1,714,620.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	295,000	28.30	8,348,500.00	
NEWMONT CORP	161,400	41.67	6,725,538.00	
NUCOR CORP	55,100	130.78	7,205,978.00	
STEEL DYNAMICS	39,800	77.94	3,102,012.00	
BOEING CO	115,300	151.82	17,504,846.00	
GENERAL DYNAMICS	48,600	224.88	10,929,168.00	
HEICO CORP	9,300	152.22	1,415,646.00	
HEICO CORP-CLASS A	15,500	122.35	1,896,425.00	
HOWMET AEROSPACE INC	78,000	35.02	2,731,560.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	8,400	226.80	1,905,120.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	39,700	227.20	9,019,840.00	
LOCKHEED MARTIN	48,900	418.57	20,468,073.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	30,200	476.95	14,403,890.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	303,900	87.59	26,618,601.00	
TEXTRON INC	43,500	61.85	2,690,475.00	
TRANSDIGM GROUP INC	10,720	601.20	6,444,864.00	
ALLEGION PLC	17,900	94.89	1,698,531.00	
CARLISLE COS INC	10,600	295.96	3,137,176.00	
CARRIER GLOBAL CORP	172,000	39.58	6,807,760.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	25,600	60.56	1,550,336.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	143,600	54.89	7,882,204.00	

LENNOX INTERNATIONAL INC	6,400	245.90	1,573,760.00	
MASCO CORP	49,600	49.86	2,473,056.00	
OWENS CORNING INC	18,900	80.92	1,529,388.00	
SMITH (A.O.) CORP	27,900	56.27	1,569,933.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	48,300	155.43	7,507,269.00	
QUANTA SERVICES INC	29,500	140.60	4,147,700.00	
AMETEK INC	47,200	117.83	5,561,576.00	
EATON CORP PLC	81,200	137.30	11,148,760.00	
EMERSON ELEC	122,300	81.75	9,998,025.00	
GENERAC HOLDINGS INC	13,100	223.39	2,926,409.00	
PLUG POWER INC	105,000	25.87	2,716,350.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	23,800	238.01	5,664,638.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	32,000	39.82	1,274,240.00	
3M CORP	113,600	121.65	13,819,440.00	
GENERAL ELECTRIC CO	223,500	72.43	16,188,105.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	138,700	186.89	25,921,643.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	34,000	53.95	1,834,300.00	
CATERPILLAR INC DEL	108,800	180.83	19,674,304.00	
CUMMINS INC	28,700	212.87	6,109,369.00	
DEERE & COMPANY	59,200	362.22	21,443,424.00	
DOVER CORP	29,700	127.97	3,800,709.00	
FORTIVE CORP	68,000	62.57	4,254,760.00	
IDEX CORP	15,200	200.02	3,040,304.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	63,200	195.40	12,349,280.00	
INGERSOLL-RAND INC	81,000	47.74	3,866,940.00	
NORDSON CORP	10,400	223.74	2,326,896.00	
OTIS WORLDWIDE CORP	85,600	71.72	6,139,232.00	
PACCAR	70,700	86.47	6,113,429.00	
PARKER HANNIFIN CORP	25,900	264.87	6,860,133.00	
PENTAIR PLC	33,700	43.91	1,479,767.00	
SNAP-ON INC	10,600	213.41	2,262,146.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	32,700	85.77	2,804,679.00	
WABTEC CORP	36,300	86.39	3,135,957.00	
XYLEM INC	35,900	91.21	3,274,439.00	
AERCAP HOLDINGS NV	29,000	43.49	1,261,210.00	

FASTENAL CO	117,100	50.47	5,910,037.00	
GRAINGER(W.W.) INC	9,300	555.31	5,164,383.00	
UNITED RENTALS INC	14,900	289.71	4,316,679.00	
CINTAS CORP	18,900	405.79	7,669,431.00	
COPART INC	44,400	116.40	5,168,160.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	44,600	142.79	6,368,434.00	
ROLLINS INC	47,000	33.74	1,585,780.00	
WASTE CONNECTIONS INC	51,800	140.55	7,280,490.00	
WASTE MANAGEMENT INC	84,400	168.45	14,217,180.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	25,900	115.36	2,987,824.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	34,800	101.68	3,538,464.00	
FEDEX CORPORATION	51,300	208.72	10,707,336.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	150,100	196.05	29,427,105.00	
DELTA AIR LINES INC	30,000	30.94	928,200.00	
SOUTHWEST AIRLINES	29,000	36.74	1,065,460.00	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV	17,000	34.33	583,610.00	
AMERCO	2,130	521.43	1,110,645.90	
CSX CORP	446,000	31.24	13,933,040.00	
GRAB HOLDINGS LTD-CL A	290,000	2.96	858,400.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	16,800	168.74	2,834,832.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	30,100	50.30	1,514,030.00	
LYFT INC-A	65,000	14.60	949,000.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	48,800	239.26	11,675,888.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	19,700	272.23	5,362,931.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	304,000	29.05	8,831,200.00	
UNION PAC CORP	128,800	223.94	28,843,472.00	
APTIV PLC	54,600	91.31	4,985,526.00	
BORGWARNER INC	50,000	37.02	1,851,000.00	
LEAR CORP	12,300	136.56	1,679,688.00	
FORD MOTOR COMPANY	812,000	15.16	12,309,920.00	
GENERAL MOTORS CO	285,000	38.47	10,963,950.00	
LUCID GROUP INC	80,000	15.16	1,212,800.00	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	66,000	32.07	2,116,620.00	
TESLA INC	539,800	270.21	145,859,358.00	

DR HORTON INC	68,600	71.38	4,896,668.00	
GARMIN LTD	30,600	88.51	2,708,406.00	
LENNAR CORP-A	52,300	77.87	4,072,601.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,900	108.85	1,186,465.00	
NEWELL BRANDS INC	85,000	17.52	1,489,200.00	
NVR INC	650	4,093.13	2,660,534.50	
PULTEGROUP INC	51,000	40.45	2,062,950.00	
WHIRLPOOL CORP	11,300	153.69	1,736,697.00	
HASBRO INC	28,100	78.71	2,211,751.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	23,700	314.17	7,445,829.00	
NIKE INC-B	258,200	105.74	27,302,068.00	
V F CORP	65,700	40.75	2,677,275.00	
AIRBNB INC-CLASS A	77,400	113.64	8,795,736.00	
ARAMARK	44,000	35.44	1,559,360.00	
BOOKING HOLDINGS INC	8,310	1,837.91	15,273,032.10	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	44,000	42.60	1,874,400.00	
CARNIVAL CORP	206,000	9.37	1,930,220.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	5,690	1,616.52	9,197,998.80	
DARDEN RESTAURANTS INC	25,000	125.17	3,129,250.00	
DOMINOS PIZZA INC	7,400	365.80	2,706,920.00	
EXPEDIA GROUP INC	30,100	102.10	3,073,210.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	56,700	127.49	7,228,683.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	69,000	36.21	2,498,490.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	56,200	154.23	8,667,726.00	
MCDONALD'S CORP	151,100	254.51	38,456,461.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	71,000	32.86	2,333,060.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	49,000	41.00	2,009,000.00	
STARBUCKS CORP	233,600	82.94	19,374,784.00	
VAIL RESORTS INC	8,200	222.00	1,820,400.00	
WYNN RESORTS LTD	22,800	59.18	1,349,304.00	
YUM BRANDS INC	58,100	112.74	6,550,194.00	
GENUINE PARTS CO	29,300	157.25	4,607,425.00	
LKQ CORP	56,300	53.45	3,009,235.00	
POOL CORP	8,300	339.90	2,821,170.00	
AMAZON.COM INC	1,871,100	127.51	238,583,961.00	

CHEWY INC - CLASS A	20,000	32.75	655,000.00	
DOORDASH INC-A	39,500	58.23	2,300,085.00	
EBAY INC	117,000	44.11	5,160,870.00	
ETSY INC	26,400	105.72	2,791,008.00	
MERCADOLIBRE INC	9,130	855.91	7,814,458.30	
WAYFAIR INC - CLASS A	14,600	49.68	725,328.00	
DOLLAR GENERAL CORP	47,200	242.60	11,450,720.00	
DOLLAR TREE INC	45,600	136.58	6,228,048.00	
TARGET CORP	95,200	164.60	15,669,920.00	
ADVANCE AUTO PARTS	12,000	171.73	2,060,760.00	
AUTOZONE	4,040	2,120.88	8,568,355.20	
BATH & BODY WORKS INC	50,400	38.47	1,938,888.00	
BEST BUY COMPANY INC	42,400	71.14	3,016,336.00	
BURLINGTON STORES INC	13,100	143.46	1,879,326.00	
CARMAX INC	33,300	87.56	2,915,748.00	
HOME DEPOT	210,000	291.90	61,299,000.00	
LOWES COS INC	130,600	195.51	25,533,606.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	13,450	702.70	9,451,315.00	
ROSS STORES INC	71,300	87.39	6,230,907.00	
TJX COS INC	242,600	63.52	15,409,952.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	22,500	187.60	4,221,000.00	
ULTA BEAUTY INC	11,100	423.08	4,696,188.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	90,520	519.11	46,989,837.20	
KROGER CO	141,800	48.43	6,867,374.00	
SYSCO CORP	105,000	80.78	8,481,900.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	148,000	35.27	5,219,960.00	
WALMART INC	308,600	133.00	41,043,800.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	64,400	71.64	4,613,616.00	
COCA COLA CO	841,500	61.15	51,457,725.00	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	43,000	47.59	2,046,370.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	33,000	244.85	8,080,050.00	
KEURIG DR PEPPER INC	157,000	37.83	5,939,310.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	37,300	51.70	1,928,410.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	82,100	88.39	7,256,819.00	
PEPSICO INC	282,500	170.66	48,211,450.00	

ARCHER DANIELS MIDLAND	115,900	87.61	10,153,999.00	
BUNGE LIMITED	31,800	99.01	3,148,518.00	
CAMPBELL SOUP CO	43,900	49.13	2,156,807.00	
CONAGRA BRANDS INC	98,000	34.22	3,353,560.00	
GENERAL MILLS	122,100	76.72	9,367,512.00	
HERSHEY CO/THE	30,200	224.05	6,766,310.00	
HORMEL FOODS CORP	62,800	46.39	2,913,292.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	22,700	140.00	3,178,000.00	
KELLOGG CO	52,000	72.70	3,780,400.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	148,000	37.31	5,521,880.00	
MCCORMICK & CO INC.	49,800	83.05	4,135,890.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	282,100	60.73	17,131,933.00	
TYSON FOODS INC-CL A	59,600	74.62	4,447,352.00	
ALTRIA GROUP INC	369,000	45.00	16,605,000.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	316,700	94.53	29,937,651.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	49,500	84.18	4,166,910.00	
CLOROX CO	25,200	142.85	3,599,820.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	162,500	78.17	12,702,625.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	68,200	126.48	8,625,936.00	
PROCTER & GAMBLE CO	490,300	137.16	67,249,548.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	47,300	248.32	11,745,536.00	
ABBOTT LABORATORIES	356,700	102.50	36,561,750.00	
ABIOMED INC	9,400	261.24	2,455,656.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	15,200	244.51	3,716,552.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	103,000	56.21	5,789,630.00	
BECTON,DICKINSON	57,900	252.84	14,639,436.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	294,000	40.49	11,904,060.00	
DENTSPLY SIRONA INC	42,200	31.80	1,341,960.00	
DEXCOM INC	81,100	82.00	6,650,200.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	126,800	88.69	11,245,892.00	
HOLOGIC INC	51,700	67.52	3,490,784.00	
IDEXX LABORATORIES INC	17,100	343.83	5,879,493.00	
INSULET CORP	14,200	254.35	3,611,770.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	73,700	203.67	15,010,479.00	
MASIMO CORP	10,600	144.27	1,529,262.00	

MEDTRONIC PLC	271,600	87.20	23,683,520.00	
NOVOCURE LTD	18,800	78.65	1,478,620.00	
RESMED INC	29,400	215.98	6,349,812.00	
STERIS PLC	20,000	199.17	3,983,400.00	
STRYKER CORP	69,100	203.76	14,079,816.00	
TELEFLEX INC	9,400	222.77	2,094,038.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	9,800	295.53	2,896,194.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	43,600	105.57	4,602,852.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	31,700	147.71	4,682,407.00	
CARDINAL HEALTH INC	55,300	70.99	3,925,747.00	
CENTENE CORP	120,400	90.05	10,842,020.00	
CIGNA CORP	65,200	287.70	18,758,040.00	
CVS HEALTH CORP	267,900	99.44	26,639,976.00	
DAVITA INC	12,500	87.80	1,097,500.00	
ELEVANCE HEALTH INC	49,260	481.99	23,742,827.40	
HCA HEALTHCARE INC	49,200	200.03	9,841,476.00	
HENRY SCHEIN INC	27,800	71.26	1,981,028.00	
HUMANA INC	26,000	484.40	12,594,400.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	19,100	225.74	4,311,634.00	
MCKESSON CORP	30,000	363.82	10,914,600.00	
MOLINA HEALTHCARE INC	11,900	338.22	4,024,818.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	23,700	125.13	2,965,581.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	191,700	516.35	98,984,295.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	14,300	96.96	1,386,528.00	
ABBVIE INC	361,100	136.28	49,210,708.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	24,400	205.45	5,012,980.00	
AMGEN INC	109,200	242.37	26,466,804.00	
BIOGEN INC	29,600	196.03	5,802,488.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	38,100	89.64	3,415,284.00	
EXACT SCIENCES CORP	36,600	36.09	1,320,894.00	
GILEAD SCIENCES INC	254,900	63.82	16,267,718.00	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	43,700	60.00	2,622,000.00	
INCYTE CORP	38,700	70.21	2,717,127.00	
MODERNA INC	69,200	138.57	9,589,044.00	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	19,100	103.01	1,967,491.00	

REGENERON PHARMACEUTICALS	22,210	580.62	12,895,570.20	
SEAGEN INC	28,300	152.34	4,311,222.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	52,500	281.04	14,754,600.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	435,000	68.61	29,845,350.00	
CATALENT INC	34,000	87.58	2,977,720.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	81,000	15.37	1,244,970.00	
ELI LILLY & CO.	165,000	301.33	49,719,450.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	12,000	154.88	1,858,560.00	
JOHNSON & JOHNSON	537,700	162.74	87,505,298.00	
MERCK & CO INC	516,700	86.23	44,555,041.00	
PFIZER INC	1,146,300	45.70	52,385,910.00	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	73,000	42.07	3,071,110.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	236,000	8.84	2,086,240.00	
VIATRIS INC	247,000	9.45	2,334,150.00	
ZOETIS INC	95,900	156.98	15,054,382.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,482,000	33.43	49,543,260.00	
CITIGROUP	400,000	48.84	19,536,000.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	99,000	36.18	3,581,820.00	
FIFTH THIRD BANCORP	138,000	33.67	4,646,460.00	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	2,510	799.31	2,006,268.10	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	36,000	149.24	5,372,640.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	286,000	13.32	3,809,520.00	
JPMORGAN CHASE & CO	600,100	113.71	68,237,371.00	
KEYCORP	189,000	17.55	3,316,950.00	
M & T BANK CORP	36,200	180.75	6,543,150.00	
PNC FINANCIAL	85,100	157.25	13,381,975.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	190,000	21.28	4,043,200.00	
SIGNATURE BANK	12,700	171.28	2,175,256.00	
SVB FINANCIAL GROUP	11,900	395.10	4,701,690.00	
TRUIST FINANCIAL CORP	270,000	46.49	12,552,300.00	
US BANCORP	287,000	45.55	13,072,850.00	
WEBSTER FINANCIAL CORP	37,000	45.81	1,694,970.00	
WELLS FARGO CO	776,000	43.38	33,662,880.00	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	81,700	55.00	4,493,500.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	262,700	277.67	72,943,909.00	

EQUITABLE HOLDINGS INC	79,000	29.36	2,319,440.00	
AFLAC INC	125,300	59.40	7,442,820.00	
ALLEGHANY CORP	2,810	840.02	2,360,456.20	
ALLSTATE CORP	56,500	121.48	6,863,620.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	13,900	127.22	1,768,358.00	
AMERICAN INTL GROUP	163,500	52.41	8,569,035.00	
AON PLC	43,200	278.34	12,024,288.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	75,000	45.50	3,412,500.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	43,400	180.47	7,832,398.00	
ASSURANT INC	11,300	158.90	1,795,570.00	
BROWN & BROWN INC	49,400	62.89	3,106,766.00	
CHUBB LTD	86,700	190.88	16,549,296.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	30,000	96.82	2,904,600.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	5,400	215.59	1,164,186.00	
EVEREST RE GROUP LTD	7,800	274.01	2,137,278.00	
FNF GROUP	54,000	39.64	2,140,560.00	
GLOBE LIFE INC	19,700	96.79	1,906,763.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	68,400	64.99	4,445,316.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	33,200	46.19	1,533,508.00	
LOEWS CORP	41,800	55.43	2,316,974.00	
MARKEL CORP	2,840	1,181.38	3,355,119.20	
MARSH & MCLENNAN COS	102,200	160.27	16,379,594.00	
METLIFE INC	140,700	65.06	9,153,942.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	53,600	74.44	3,989,984.00	
PROGRESSIVE CO	118,900	122.41	14,554,549.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	75,600	94.89	7,173,684.00	
TRAVELERS COS INC/THE	48,900	162.70	7,956,030.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	23,400	204.75	4,791,150.00	
WR BERKLEY CORP	42,600	64.77	2,759,202.00	
ACCENTURE PLC-CL A	129,400	284.07	36,758,658.00	
AFFIRM HOLDINGS INC	42,000	22.45	942,900.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	33,600	88.26	2,965,536.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	85,800	238.48	20,461,584.00	
BLOCK INC	107,100	66.33	7,103,943.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	24,400	166.48	4,062,112.00	

INC				
CLOUDFLARE INC - CLASS A	53,000	58.71	3,111,630.00	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	106,500	62.33	6,638,145.00	
EPAM SYSTEMS INC	11,700	412.14	4,822,038.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	124,100	89.97	11,165,277.00	
FISERV INC	125,200	101.44	12,700,288.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	15,800	209.12	3,304,096.00	
GARTNER INC	16,800	288.92	4,853,856.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	57,700	124.05	7,157,685.00	
GODADDY INC - CLASS A	34,900	75.07	2,619,943.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	183,800	127.79	23,487,802.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	15,000	191.19	2,867,850.00	
MASTERCARD INC	177,400	322.56	57,222,144.00	
MONGODB INC	14,100	244.87	3,452,667.00	
OKTA INC	30,300	64.63	1,958,289.00	
PAYCHEX INC	65,800	120.90	7,955,220.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	223,900	91.13	20,404,007.00	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	45,900	171.49	7,871,391.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	45,600	55.52	2,531,712.00	
TWILIO INC - A	34,500	67.01	2,311,845.00	
VERISIGN INC	19,700	181.45	3,574,565.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	336,300	197.76	66,506,688.00	
WESTERN UNION CO	75,000	14.56	1,092,000.00	
WIX.COM LTD	12,200	61.18	746,396.00	
ADOBE INC	96,550	368.14	35,543,917.00	
ANSYS INC	17,900	244.63	4,378,877.00	
APPLOVIN CORP-CLASS A	23,000	24.09	554,070.00	
AUTODESK INC.	44,600	198.69	8,861,574.00	
AVALARA INC	17,200	91.98	1,582,056.00	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	40,000	36.10	1,444,000.00	
BILL.COM HOLDINGS INC	19,600	149.64	2,932,944.00	
BLACK KNIGHT INC	33,000	66.36	2,189,880.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	56,200	168.17	9,451,154.00	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	26,800	58.09	1,556,812.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	20,100	117.61	2,363,961.00	

CITRIX SYSTEMS INC	25,800	102.83	2,653,014.00	
COUPA SOFTWARE INC	14,200	56.98	809,116.00	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	41,800	172.45	7,208,410.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	8,300	137.51	1,141,333.00	
DATADOG INC - CLASS A	49,900	96.94	4,837,306.00	
DOCUSIGN INC	42,200	54.45	2,297,790.00	
DROPBOX INC-CLASS A	57,000	21.17	1,206,690.00	
DYNATRACE INC	38,000	36.75	1,396,500.00	
FAIR ISAAC CORP	5,120	439.78	2,251,673.60	
FORTINET INC	137,200	48.60	6,667,920.00	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	15,800	68.51	1,082,458.00	
HUBSPOT INC	9,500	315.36	2,995,920.00	
INTUIT INC	54,800	420.06	23,019,288.00	
MICROSOFT CORP	1,451,800	256.06	371,747,908.00	
NORTONLIFELOCK INC	119,000	22.84	2,717,960.00	
ORACLE CORPORATION	327,100	74.68	24,427,828.00	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	330,000	7.40	2,442,000.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	20,500	539.20	11,053,600.00	
PAYCOM SOFTWARE INC	10,300	344.46	3,547,938.00	
PTC INC	22,000	115.05	2,531,100.00	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	14,500	42.78	620,310.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	21,400	400.92	8,579,688.00	
SALESFORCE INC	203,040	153.69	31,205,217.60	
SERVICENOW INC	41,100	434.51	17,858,361.00	
SPLUNK INC	32,400	87.33	2,829,492.00	
SYNOPSYS INC	31,500	330.56	10,412,640.00	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	90,000	61.27	5,514,300.00	
TYLER TECHNOLOGIES INC	8,600	363.67	3,127,562.00	
UNITY SOFTWARE INC	37,200	40.79	1,517,388.00	
VMWARE INC - CLASS A	43,100	115.66	4,984,946.00	
WORKDAY INC-CLASS A	40,200	158.54	6,373,308.00	
ZENDESK INC	25,300	76.77	1,942,281.00	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	47,200	80.79	3,813,288.00	
ZSCALER INC	17,800	145.12	2,583,136.00	
ARISTA NETWORKS INC	49,700	117.30	5,829,810.00	

CISCO SYSTEMS	845,900	44.59	37,718,681.00	
F5 INC	12,400	156.11	1,935,764.00	
JUNIPER NETWORKS INC	66,000	28.01	1,848,660.00	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33,800	243.77	8,239,426.00	
APPLE INC	3,307,100	155.81	515,279,251.00	
DELL TECHNOLOGIES-C	60,000	37.79	2,267,400.00	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	259,000	13.24	3,429,160.00	
HP INC	214,000	27.64	5,914,960.00	
NETAPP INC	46,100	71.28	3,286,008.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	41,700	65.47	2,730,099.00	
WESTERN DIGITAL CORP	61,800	41.65	2,573,970.00	
AMPHENOL CORP-CL A	123,100	72.58	8,934,598.00	
ARROW ELECTRS INC	13,700	102.70	1,406,990.00	
CDW CORPORATION	27,600	168.50	4,650,600.00	
COGNEX CORP	33,600	41.88	1,407,168.00	
CORNING INC	162,000	33.15	5,370,300.00	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	37,700	163.27	6,155,279.00	
TE CONNECTIVITY LTD	65,400	123.89	8,102,406.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	9,700	367.71	3,566,787.00	
TRIMBLE INC	49,900	62.12	3,099,788.00	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	10,900	297.60	3,243,840.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	330,648	80.24	26,531,195.52	
ANALOG DEVICES INC	106,300	148.63	15,799,369.00	
APPLIED MATERIALS	179,400	91.24	16,368,456.00	
BROADCOM INC	82,860	500.22	41,448,229.20	
ENPHASE ENERGY INC	27,900	279.07	7,786,053.00	
ENTEGRIS INC	30,600	92.08	2,817,648.00	
INTEL CORP	835,500	31.22	26,084,310.00	
KLA CORP	30,500	335.25	10,225,125.00	
LAM RESEARCH	28,370	430.21	12,205,057.70	
MARVELL TECHNOLOGY INC	175,000	45.76	8,008,000.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	112,900	64.50	7,282,050.00	
MICRON TECHNOLOGY	227,800	56.33	12,831,974.00	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	8,800	424.42	3,734,896.00	
NVIDIA CORP	511,640	136.47	69,823,510.80	

NXP SEMICONDUCTORS NV	54,100	162.39	8,785,299.00	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	88,300	67.51	5,961,133.00	
QORVO INC	22,500	90.14	2,028,150.00	
QUALCOMM INC	228,000	128.48	29,293,440.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	33,700	98.40	3,316,080.00	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	11,600	267.12	3,098,592.00	
TERADYNE INC	32,000	83.04	2,657,280.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	188,400	163.00	30,709,200.00	
AT & T INC	1,463,000	17.19	25,148,970.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	31,000	19.96	618,760.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	64,000	20.96	1,341,440.00	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	182,000	9.85	1,792,700.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	858,000	41.30	35,435,400.00	
T-MOBILE US INC	128,600	141.98	18,258,628.00	
ALLIANT ENERGY CORP	51,600	61.49	3,172,884.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	105,700	101.09	10,685,213.00	
CONSTELLATION ENERGY	66,100	81.07	5,358,727.00	
DUKE ENERGY CORP	156,400	107.00	16,734,800.00	
EDISON INTERNATIONAL	79,000	67.96	5,368,840.00	
ENTERGY CORP	41,100	116.22	4,776,642.00	
EVERGY INC	45,600	68.37	3,117,672.00	
EVERSOURCE ENERGY	69,400	89.55	6,214,770.00	
EXELON CORPORATION	202,000	44.08	8,904,160.00	
FIRSTENERGY CORP	110,000	39.91	4,390,100.00	
NEXTERA ENERGY INC	401,400	85.11	34,163,154.00	
NRG ENERGY INC	49,000	41.47	2,032,030.00	
PG&E CORP	311,000	12.55	3,903,050.00	
PPL CORPORATION	149,000	28.94	4,312,060.00	
SOUTHERN CO.	218,100	77.87	16,983,447.00	
XCEL ENERGY INC	112,300	74.41	8,356,243.00	
ATMOS ENERGY CORP	27,900	114.55	3,195,945.00	
UGI CORP	40,000	39.04	1,561,600.00	
AMEREN CORPORATION	52,100	92.93	4,841,653.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	128,000	31.78	4,067,840.00	
CMS ENERGY CORP	59,800	67.14	4,014,972.00	

CONSOLIDATED EDISON INC	71,200	98.48	7,011,776.00	
DOMINION ENERGY INC	164,900	81.83	13,493,767.00	
DTE ENERGY COMPANY	39,500	131.14	5,180,030.00	
NISOURCE INC	79,000	29.55	2,334,450.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	102,000	64.01	6,529,020.00	
SEMPRA ENERGY	64,700	166.80	10,791,960.00	
WEC ENERGY GROUP INC	64,100	103.01	6,602,941.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	37,700	148.12	5,584,124.00	
ESSENTIAL UTILITIES INC	52,500	49.16	2,580,900.00	
ALLY FINANCIAL INC	68,000	32.69	2,222,920.00	
AMERICAN EXPRESS CO	130,100	149.79	19,487,679.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	80,300	104.22	8,368,866.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	58,000	99.53	5,772,740.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	103,800	31.97	3,318,486.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	22,300	268.42	5,985,766.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	155,000	41.12	6,373,600.00	
BLACKROCK INC	30,960	658.06	20,373,537.60	
BLACKSTONE INC	142,500	93.82	13,369,350.00	
CARLYLE GROUP INC/THE	38,000	32.26	1,225,880.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	21,200	119.81	2,539,972.00	
CME GROUP INC	73,100	194.69	14,231,839.00	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	23,200	65.26	1,514,032.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	7,900	430.44	3,400,476.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	57,000	25.89	1,475,730.00	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	13,000	48.92	635,960.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	70,200	331.48	23,269,896.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	114,400	101.28	11,586,432.00	
INVESCO LTD	65,000	16.25	1,056,250.00	
KKR & CO INC-A	116,600	49.25	5,742,550.00	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	16,500	219.25	3,617,625.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	7,900	249.91	1,974,289.00	
MOODYS CORP	34,200	284.40	9,726,480.00	
MORGAN STANLEY	270,200	86.40	23,345,280.00	
MSCI INC	16,700	451.95	7,547,565.00	
NASDAQ INC	71,100	59.68	4,243,248.00	

NORTHERN TRUST CORP	40,400	93.38	3,772,552.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	38,900	103.50	4,026,150.00	
S&P GLOBAL INC	70,895	347.63	24,645,228.85	
SCHWAB(CHARLES)CORP	297,000	70.34	20,890,980.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	22,500	53.85	1,211,625.00	
STATE STREET CORP	76,100	67.68	5,150,448.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	46,000	118.34	5,443,640.00	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	21,300	66.78	1,422,414.00	
AES CORP	136,000	26.15	3,556,400.00	
VISTRA CORP	87,000	24.96	2,171,520.00	
TELADOC HEALTH INC	34,000	30.18	1,026,120.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	28,500	169.97	4,844,145.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	60,400	128.01	7,731,804.00	
AVANTOR INC	125,000	24.50	3,062,500.00	
BIO TECHNE CORP	8,000	330.03	2,640,240.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	4,670	478.32	2,233,754.40	
CHARLES RIVER LABORATORIES	10,500	200.24	2,102,520.00	
DANAHER CORP	141,100	269.42	38,015,162.00	
ILLUMINA INC	31,600	196.07	6,195,812.00	
IQVIA HOLDINGS INC	38,700	207.26	8,020,962.00	
METTLER-TOLEDO INTL	4,700	1,195.02	5,616,594.00	
PERKINELMER INC	25,900	134.59	3,485,881.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	79,990	543.55	43,478,564.50	
WATERS CORP	12,500	298.32	3,729,000.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	15,300	291.35	4,457,655.00	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	26,900	95.13	2,558,997.00	
CLARIVATE PLC	65,000	11.50	747,500.00	
COSTAR GROUP INC	79,800	70.89	5,657,022.00	
EQUIFAX INC	25,400	187.50	4,762,500.00	
JACOBS SOLUTIONS INC	25,900	118.80	3,076,920.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	27,500	93.71	2,577,025.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	22,200	76.06	1,688,532.00	
TRUNSUMION	40,300	73.80	2,974,140.00	
VERISK ANALYTICS INC	32,500	184.77	6,005,025.00	
CBRE GROUP INC	67,600	77.14	5,214,664.00	

HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	220,000	4.78	1,051,600.00	
ZILLOW GROUP INC - C	33,200	34.05	1,130,460.00	
CABLE ONE INC	1,120	1,127.55	1,262,856.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	24,600	407.14	10,015,644.00	
COMCAST CORP-CL A	915,100	35.76	32,723,976.00	
DISH NETWORK CORP-A	51,000	17.01	867,510.00	
FOX CORP-CLASS A	62,000	33.74	2,091,880.00	
FOX CORP-CLASS B	30,000	31.24	937,200.00	
INTERPUBRIC GROUP	79,000	27.23	2,151,170.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	27,100	99.73	2,702,683.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	34,000	41.19	1,400,460.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	17,000	41.33	702,610.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	75,000	16.96	1,272,000.00	
OMNICOM GROUP	43,100	66.26	2,855,806.00	
PARAMOUNT GLOBAL	120,000	23.12	2,774,400.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	171,000	6.07	1,037,970.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	158,600	77.53	12,296,258.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS PFD	105,000	4.97	521,850.00	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	105,000	8.88	932,400.00	
DISNEY (WALT) CO	372,200	111.20	41,388,640.00	
ELECTRONIC ARTS	56,500	125.33	7,081,145.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	40,400	63.80	2,577,520.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	35,800	89.64	3,209,112.00	
NETFLIX INC	91,100	226.11	20,598,621.00	
ROBLOX CORP -CLASS A	73,000	37.94	2,769,620.00	
ROKU INC	24,200	65.99	1,596,958.00	
SEA LTD-ADR	75,100	59.93	4,500,743.00	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	32,700	118.63	3,879,201.00	
WARNER BROS DISCOVERY INC	477,000	13.06	6,229,620.00	
ALPHABET INC-CL A	1,229,100	107.85	132,558,435.00	
ALPHABET INC-CL C	1,152,600	108.68	125,264,568.00	
IAC INC	15,000	63.67	955,050.00	
MATCH GROUP INC	58,300	55.18	3,216,994.00	
META PLATFORMS INC-CLASS A	468,600	160.32	75,125,952.00	
PINTEREST INC- CLASS A	121,000	22.07	2,670,470.00	

小計	銘柄数：602			6,948,499,902.57 (974,666,081,333)	
	組入時価比率：71.3%			74.1%	
カナダドル	SNAP INC-A	225,000	11.22	2,524,500.00	
	TWITTER INC	135,000	38.63	5,215,050.00	
	ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	54,000	41.35	2,232,900.00	
	ARC RESOURCES LTD	133,000	18.20	2,420,600.00	
	CAMECO CORP	79,000	37.89	2,993,310.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	239,600	72.27	17,315,892.00	
	CENOVUS ENERGY INC	282,000	24.86	7,010,520.00	
	ENBRIDGE INC	412,000	54.31	22,375,720.00	
	IMPERIAL OIL	46,000	64.27	2,956,420.00	
	KEYERA CORP	48,000	31.71	1,522,080.00	
	PARKLAND CORP	28,000	32.03	896,840.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	113,000	46.51	5,255,630.00	
	SUNCOR ENERGY INC	296,000	41.80	12,372,800.00	
	TC ENERGY CORP	198,500	63.11	12,527,335.00	
	TOURMALINE OIL CORP	64,500	77.79	5,017,455.00	
	NUTRIEN LTD	111,700	120.82	13,495,594.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	32,000	64.58	2,066,560.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	95,000	54.64	5,190,800.00	
	BARRICK GOLD	358,000	19.58	7,009,640.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	118,000	21.37	2,521,660.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	39,000	159.73	6,229,470.00	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	122,000	8.10	988,200.00	
	KINROSS GOLD CORP	250,000	4.32	1,080,000.00	
	LUNDIN MINING CORP	137,000	6.60	904,200.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	43,000	19.67	845,810.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	99,000	43.05	4,261,950.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	89,000	40.97	3,646,330.00	
	WEST FRASER TIMBER	14,200	111.59	1,584,578.00	
	CAE INC	67,000	23.31	1,561,770.00	
	WSP GLOBAL INC	26,000	154.14	4,007,640.00	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	17,000	101.33	1,722,610.00	
	GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	38,000	37.71	1,432,980.00	

RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	23,700	92.32	2,187,984.00	
AIR CANADA	32,000	17.61	563,520.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	121,000	153.76	18,604,960.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	189,100	97.32	18,403,212.00	
TFI INTERNATIONAL INC	17,000	135.77	2,308,090.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	58,700	74.15	4,352,605.00	
BRP INC/CA- SUB VOTING	7,400	89.49	662,226.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	37,000	39.38	1,457,060.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	59,100	77.83	4,599,753.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	11,500	157.65	1,812,975.00	
DOLLARAMA INC	55,600	80.29	4,464,124.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	170,000	59.46	10,108,200.00	
EMPIRE CO LTD A	32,000	38.01	1,216,320.00	
LOBLAW COMPANIES	33,400	117.33	3,918,822.00	
METRO INC	49,700	70.77	3,517,269.00	
WESTON(GEORGE)LTD	14,100	152.23	2,146,443.00	
SAPUTO INC	50,000	33.01	1,650,500.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	58,000	8.49	492,420.00	
BANK OF MONTREAL	138,000	121.78	16,805,640.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	247,200	71.41	17,652,552.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	186,000	61.67	11,470,620.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	68,400	87.32	5,972,688.00	
ROYAL BANK OF CANADA	289,600	123.04	35,632,384.00	
TORONTO DOMINION BANK	371,600	85.53	31,782,948.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,940	637.77	3,150,583.80	
GREAT-WEST LIFE CO INC	57,000	31.02	1,768,140.00	
IA FINANCIAL CORP INC	21,100	69.11	1,458,221.00	
INTACT FINANCIAL CORP	35,900	191.36	6,869,824.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	391,000	22.57	8,824,870.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	116,000	33.86	3,927,760.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	119,000	57.75	6,872,250.00	
CGI INC	44,400	102.51	4,551,444.00	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	14,000	38.72	542,080.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	236,000	39.54	9,331,440.00	

	BLACKBERRY LTD	125,000	7.53	941,250.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	4,050	1,966.25	7,963,312.50	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	29,000	23.37	677,730.00	
	OPEN TEXT CORP	56,000	39.11	2,190,160.00	
	BCE INC	14,400	63.57	915,408.00	
	TELUS CORP	98,600	29.71	2,929,406.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	70,300	55.95	3,933,285.00	
	EMERA INC	56,000	61.31	3,433,360.00	
	FORTIS INC	96,600	58.25	5,626,950.00	
	HYDRO ONE LTD	70,000	35.40	2,478,000.00	
	ALTAGAS LTD	60,000	28.64	1,718,400.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	139,000	18.00	2,502,000.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	27,000	40.24	1,086,480.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	287,000	62.52	17,943,240.00	
	IGM FINANCIAL INC	15,000	35.35	530,250.00	
	ONEX CORPORATION	13,200	63.93	843,876.00	
	TMX GROUP LTD	11,300	131.60	1,487,080.00	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	24,000	50.65	1,215,600.00	
	NORTHLAND POWER INC	46,000	44.58	2,050,680.00	
	THOMSON REUTERS CORP	34,600	143.50	4,965,100.00	
	FIRSTSERVICE CORP	8,500	158.58	1,347,930.00	
	QUEBECOR INC-CL B	34,000	28.15	957,100.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	97,000	34.01	3,298,970.00	
小計	銘柄数：86			471,329,889.30	
				(50,474,717,845)	
	組入時価比率：3.7%			3.8%	
ユーロ	TENARIS SA	101,000	14.28	1,442,785.00	
	ENI SPA	518,000	12.29	6,366,220.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	109,000	11.30	1,231,700.00	
	NESTE OYJ	87,000	48.34	4,205,580.00	
	OMV AG	28,100	41.93	1,178,233.00	
	REPSOL SA	302,000	13.68	4,132,870.00	
	TOTALENERGIES SE	506,600	53.18	26,940,988.00	
	AIR LIQUIDE SA	106,400	120.64	12,836,096.00	
	AKZO NOBEL	36,600	60.92	2,229,672.00	

ARKEMA	11,600	82.32	954,912.00	
BASF SE	190,000	41.27	7,841,300.00	
COVESTRO AG	38,000	29.82	1,133,160.00	
EVONIK INDUSTRIES AG	39,000	18.41	718,185.00	
KONINKLIJKE DSM NV	35,900	124.05	4,453,395.00	
OCI	21,000	37.38	784,980.00	
SOLVAY SA	14,200	79.04	1,122,368.00	
SYMRISE AG	27,100	102.60	2,780,460.00	
UMICORE	44,000	30.65	1,348,600.00	
CRH PLC	155,000	35.66	5,527,300.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	30,600	44.81	1,371,186.00	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	51,000	32.41	1,652,910.00	
ARCELORMITTAL	111,000	22.48	2,495,835.00	
VOESTALPINE AG	24,000	20.34	488,160.00	
STORA ENSO OYJ-R	108,000	14.13	1,526,040.00	
UPM-KYMMENE OYJ	109,000	32.84	3,579,560.00	
AIRBUS SE	120,000	96.86	11,623,200.00	
DASSAULT AVIATION SA	5,000	137.20	686,000.00	
MTU AERO ENGINES AG	11,000	171.10	1,882,100.00	
RHEINMETALL AG	9,400	156.60	1,472,040.00	
SAFRAN SA	70,600	100.76	7,113,656.00	
THALES SA	22,000	123.00	2,706,000.00	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	102,000	39.33	4,012,170.00	
KINGSPAN GROUP PLC	29,900	56.50	1,689,350.00	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	49,245	22.42	1,104,072.90	
BOUYGUES	46,000	29.29	1,347,340.00	
EIFFAGE SA	15,900	87.16	1,385,844.00	
FERROVIAL SA	96,091	24.87	2,389,783.17	
VINCI	108,000	92.95	10,038,600.00	
LEGRAND SA	54,200	72.50	3,929,500.00	
PRYSMIAN SPA	54,000	30.90	1,668,600.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	111,500	118.40	13,201,600.00	
SIEMENS ENERGY AG	89,000	14.15	1,259,795.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	45,000	17.98	809,100.00	
SIEMENS AG	157,100	102.06	16,033,626.00	

ALSTOM	61,000	19.85	1,211,155.00	
CNH INDUSTRIAL NV	210,000	12.17	2,556,750.00	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	91,000	24.70	2,248,155.00	
GEA GROUP AG	29,000	32.14	932,060.00	
KION GROUP AG	13,100	38.09	498,979.00	
KNORR-BREMSE AG	15,200	47.04	715,008.00	
KONE OYJ	71,000	38.80	2,754,800.00	
RATIONAL AG	1,050	495.00	519,750.00	
WARTSILA OYJ	101,000	7.96	804,566.00	
BRENNTAG SE	31,300	67.00	2,097,100.00	
IMCD NV	11,500	133.00	1,529,500.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	201,000	35.61	7,157,610.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	112,000	5.86	656,880.00	
ADP	6,100	133.60	814,960.00	
AENA SME SA	15,800	120.65	1,906,270.00	
ATLANTIA SPA	98,000	22.77	2,231,460.00	
GETLINK	93,000	18.36	1,707,480.00	
CONTINENTAL AG	23,200	54.86	1,272,752.00	
MICHELIN (CGDE)	139,000	23.60	3,281,095.00	
VALEO SA	45,000	17.69	796,275.00	
BAYER MOTOREN WERK	66,800	72.44	4,838,992.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	12,500	68.45	855,625.00	
FERRARI NV	26,200	190.65	4,995,030.00	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	165,300	53.64	8,866,692.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	31,900	69.44	2,215,136.00	
RENAULT SA	40,000	27.76	1,110,400.00	
STELLANTIS NV	442,000	12.82	5,669,976.00	
VOLKSWAGEN AG	6,300	182.60	1,150,380.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	38,500	143.50	5,524,750.00	
SEB SA	5,400	71.10	383,940.00	
ADIDAS AG	35,400	145.20	5,140,080.00	
ESSILORLUXOTTICA	59,300	148.40	8,800,120.00	
HERMES INTERNATIONAL	6,530	1,255.00	8,195,150.00	
KERING SA	15,440	494.25	7,631,220.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	56,730	635.00	36,023,550.00	

MONCLER SPA	42,000	43.60	1,831,200.00	
PUMA SE	21,200	60.50	1,282,600.00	
ACCOR SA	32,000	23.65	756,800.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	34,600	117.70	4,072,420.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	20,000	32.07	641,400.00	
SODEXO	18,200	77.68	1,413,776.00	
D'ITEREN GROUP	4,800	144.30	692,640.00	
DELIVERY HERO SE	34,000	41.23	1,401,820.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	32,900	15.87	522,123.00	
PROSUS NV	170,700	59.36	10,132,752.00	
ZALANDO SE	45,000	22.43	1,009,350.00	
INDITEX SA	220,000	21.25	4,675,000.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	130,000	16.36	2,126,800.00	
HELLOFRESH SE	31,800	23.88	759,384.00	
JERONIMO MARTINS	55,000	22.04	1,212,200.00	
KESKO OYJ-B SHS	58,000	20.62	1,195,960.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	213,000	27.14	5,780,820.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	177,200	48.97	8,678,370.00	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	107,000	9.42	1,008,796.00	
HEINEKEN HOLDING NV	22,000	70.40	1,548,800.00	
HEINEKEN NV	52,400	89.76	4,703,424.00	
PERNOD RICARD SA	42,500	184.85	7,856,125.00	
REMY COINTREAU	4,900	177.50	869,750.00	
DANONE	132,500	51.24	6,789,300.00	
JDE PEET'S BV	21,000	30.54	641,340.00	
KERRY GROUP PLC-A	32,700	99.54	3,254,958.00	
HENKEL AG & CO KGAA	20,300	60.15	1,221,045.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	35,700	62.30	2,224,110.00	
BEIERSDORF AG	21,400	100.35	2,147,490.00	
LOREAL-ORD	49,000	341.65	16,740,850.00	
BIOMERIEUX	8,800	89.86	790,768.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	8,600	122.40	1,052,640.00	
DIASORIN ITALIA SPA	4,800	132.60	636,480.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	185,000	17.07	3,159,060.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,100	418.00	2,131,800.00	

SIEMENS HEALTHINEERS AG	57,600	49.08	2,827,008.00	
AMPLIFON SPA	24,000	25.90	621,600.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	39,900	33.90	1,352,610.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	84,000	24.82	2,084,880.00	
ARGENX SE	11,500	383.50	4,410,250.00	
GRIFOLS SA	63,000	11.50	724,815.00	
BAYER AG-REG	200,100	51.81	10,367,181.00	
IPSEN	7,300	97.10	708,830.00	
MERCK KGAA	26,400	171.55	4,528,920.00	
ORION OYJ	21,000	44.55	935,550.00	
RECORDATI SPA	19,900	40.22	800,378.00	
SANOFI	233,600	80.76	18,865,536.00	
UCB SA	26,300	69.00	1,814,700.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	82,000	9.66	792,284.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,380,000	4.46	6,167,910.00	
BANCO SANTANDER SA	3,480,000	2.39	8,334,600.00	
BNP PARIBAS	229,000	46.46	10,639,340.00	
CAIXABANK	890,000	3.01	2,680,680.00	
COMMERZBANK AG	215,000	6.72	1,446,520.00	
CREDIT AGRICOLE SA	245,000	9.05	2,217,740.00	
ERSTE GROUP BANK AG	70,000	22.61	1,582,700.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	129,000	10.81	1,394,490.00	
ING GROEP NV	792,000	8.50	6,732,000.00	
INTESA SANPAOLO	3,390,000	1.69	5,752,830.00	
KBC GROEP NV	53,000	47.76	2,531,280.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	124,000	7.98	990,264.00	
SOCIETE GENERALE	159,000	22.54	3,583,860.00	
UNICREDIT SPA	428,000	9.72	4,161,444.00	
EURAZEO SE	7,800	58.60	457,080.00	
EXOR NV	22,000	61.68	1,356,960.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	21,400	74.66	1,597,724.00	
SOFINA SA	2,900	195.90	568,110.00	
WENDEL	6,000	76.45	458,700.00	
AEGON NV	370,000	4.44	1,644,280.00	
AGEAS	32,000	39.51	1,264,320.00	

ALLIANZ SE-REG	83,100	168.74	14,022,294.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	232,000	14.61	3,390,680.00	
AXA SA	392,000	23.57	9,239,440.00	
HANNOVER RUECK SE	12,000	150.90	1,810,800.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	28,500	244.90	6,979,650.00	
NN GROUP NV	59,000	40.51	2,390,090.00	
POSTE ITALIANE SPA	103,000	7.89	812,670.00	
SAMPO OYJ-A SHS	99,000	44.29	4,384,710.00	
ADYEN NV	4,480	1,504.80	6,741,504.00	
AMADEUS IT GROUP SA	92,500	51.80	4,791,500.00	
BECHTLE AG	15,700	37.36	586,552.00	
CAPGEMINI SA	33,300	174.75	5,819,175.00	
EDENRED	50,000	50.76	2,538,000.00	
NEXI SPA	104,000	8.24	857,584.00	
WORLDLINE SA	49,000	42.58	2,086,420.00	
DASSAULT SYSTEMES SE	136,000	38.62	5,252,320.00	
NEMETSCHKE SE	11,000	56.98	626,780.00	
SAP SE	214,300	84.51	18,110,493.00	
NOKIA OYJ	1,110,000	5.02	5,573,310.00	
ASM INTERNATIONAL NV	9,700	270.95	2,628,215.00	
ASML HOLDING NV	83,060	477.20	39,636,232.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	267,000	24.18	6,457,395.00	
STMICROELECTRONICS NV	140,000	34.73	4,862,200.00	
CELLNEX TELECOM SA	111,000	37.74	4,189,140.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	660,000	18.90	12,475,320.00	
ELISA OYJ	28,400	52.12	1,480,208.00	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	72,000	9.31	670,608.00	
KONINKLIJKE KPN NV	660,000	3.16	2,089,560.00	
ORANGE SA	415,000	10.13	4,204,780.00	
PROXIMUS	26,000	12.37	321,620.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,930,000	0.20	390,246.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	210,000	2.54	533,610.00	
TELEFONICA SA	1,093,000	4.09	4,470,370.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	22.04	370,272.00	
ACCIONA S.A.	4,800	193.80	930,240.00	

ELECTRICITE DE FRANCE	113,000	12.00	1,356,000.00	
ELIA GROUP SA/NV	6,626	146.60	971,371.60	
ENDESA S.A.	65,000	17.21	1,118,975.00	
ENEL SPA	1,680,000	4.70	7,896,000.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	554,000	4.80	2,659,754.00	
FORTUM OYJ	89,000	9.20	818,800.00	
IBERDROLA SA	1,212,000	10.61	12,859,320.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	79,000	18.44	1,457,155.00	
TERNA SPA	275,000	7.13	1,961,300.00	
VERBUND AG	14,500	87.00	1,261,500.00	
ENAGAS SA	48,000	18.26	876,720.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	32,000	27.63	884,160.00	
SNAM SPA	420,000	4.74	1,992,060.00	
E.ON SE	468,000	8.93	4,179,240.00	
ENGIE	370,000	12.23	4,526,580.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	133,000	21.93	2,916,690.00	
AMUNDI SA	12,800	50.55	647,040.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	427,000	8.18	3,493,287.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	39,300	167.55	6,584,715.00	
EURONEXT NV	18,000	72.50	1,305,000.00	
EDP RENOVAVEIS SA	58,000	24.11	1,398,380.00	
RWE AG	130,000	39.00	5,070,000.00	
UNIPER SE	15,100	5.02	75,802.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	27,700	66.40	1,839,280.00	
QIAGEN N.V.	47,900	45.56	2,182,324.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	5,500	367.20	2,019,600.00	
BUREAU VERITAS SA	61,000	24.42	1,489,620.00	
RANDSTAD NV	25,500	45.87	1,169,685.00	
TELEPERFORMANCE	11,900	286.80	3,412,920.00	
WOLTERS KLUWER	53,000	98.98	5,245,940.00	
AROUNDTOWN SA	206,000	2.81	579,890.00	
LEG IMMOBILIEN SE	14,000	74.24	1,039,360.00	
VONOVIA SE	149,000	26.21	3,905,290.00	
PUBLICIS GROUPE	46,900	48.73	2,285,437.00	
VIVENDI SE	145,000	8.85	1,283,250.00	

英ポンド	BOLLORE SE	168,000	4.76	800,016.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	17,300	43.28	748,744.00	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	143,000	19.30	2,760,186.00	
	SCOUT24 SE	15,200	57.64	876,128.00	
	小計 銘柄数：223			820,819,550.67	
				(114,684,907,619)	
	組入時価比率：8.4%			8.7%	
	BP PLC	3,963,000	4.63	18,362,560.50	
	SHELL PLC-NEW	1,520,000	23.48	35,689,600.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	28,700	66.24	1,901,088.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	40,000	19.31	772,600.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	262,000	27.69	7,254,780.00	
	ANTOFAGASTA PLC	79,000	11.21	885,590.00	
	GLENCORE PLC	2,001,000	4.71	9,434,715.00	
	RIO TINTO PLC-REG	228,600	47.32	10,818,495.00	
	MONDI PLC	101,000	14.37	1,451,370.00	
	BAE SYSTEMS PLC	639,000	7.87	5,031,486.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,680,000	0.74	1,245,216.00	
	DCC PLC	21,200	49.10	1,040,920.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	870,000	1.32	1,150,575.00	
	SMITHS GROUP PLC	80,000	14.85	1,188,000.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	15,500	102.75	1,592,625.00	
	ASHTED GROUP PLC	91,000	43.12	3,923,920.00	
	BUNZLE	71,000	28.16	1,999,360.00	
	FERGUSON PLC	44,900	98.72	4,432,528.00	
英ポンド	RENTOKIL INTIAL PLC	373,000	5.24	1,954,520.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	207,000	4.08	845,802.00	
	PERSIMMON PLC	64,000	14.52	929,280.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	710,000	1.04	738,400.00	
	THE BERKELEY GRP HOLDINGS	24,300	34.47	837,621.00	
	BURBERRY GROUP PLC	82,000	17.03	1,396,870.00	
	COMPASS GROUP PLC	362,000	18.44	6,677,090.00	
英ポンド	ENTAIN PLC	121,000	11.99	1,451,395.00	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	38,600	46.15	1,781,390.00	
	WHITBREAD PLC	41,000	25.37	1,040,170.00	

NEXT PLC	26,000	60.36	1,569,360.00	
JD SPORTS FASHION PLC	465,000	1.22	571,020.00	
KINGFISHER PLC	390,000	2.39	934,440.00	
OCADO GROUP PLC	122,000	7.19	877,912.00	
SAINSBURY	340,000	2.05	697,000.00	
TESCO PLC	1,540,000	2.49	3,843,840.00	
COCA-COLA HBC AG-DI	39,000	19.31	753,285.00	
DIAGEO PLC	470,000	37.37	17,566,250.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	68,000	14.77	1,004,360.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	439,000	34.71	15,239,885.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	188,000	19.24	3,617,120.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	147,100	64.40	9,473,240.00	
HALEON PLC	1,021,000	2.46	2,513,191.50	
UNILEVER PLC	521,000	38.80	20,214,800.00	
SMITH & NEPHEW PLC	182,000	10.89	1,981,980.00	
NMC HEALTH PLC	13,300	0.00	6.65	
ASTRAZENECA PLC	316,580	106.48	33,709,438.40	
GSK PLC	827,000	13.57	11,229,006.00	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	37,000	12.79	473,230.00	
BARCLAYS PLC	3,410,000	1.66	5,677,650.00	
HSBC HOLDINGS PLC	4,097,000	5.36	21,992,696.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,400,000	0.43	6,256,800.00	
NATWEST GROUP PLC	1,120,000	2.50	2,804,480.00	
STANDARD CHARTERED PLC	534,000	6.00	3,204,000.00	
M&G PLC	500,000	1.98	992,750.00	
ADMIRAL GROUP PLC	35,000	21.02	735,700.00	
AVIVA PLC	568,000	4.25	2,415,704.00	
LEGAL & GENERAL	1,210,000	2.53	3,067,350.00	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	144,000	6.10	879,552.00	
PRUDENTIAL PLC	569,000	9.19	5,230,248.00	
AVEVA GROUP PLC	26,000	28.55	742,300.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	197,000	7.02	1,384,122.00	
HALMA PLC	76,000	20.47	1,555,720.00	
BT GROUP PLC	1,390,000	1.44	2,010,635.00	
VODAFONE GROUP PLC	5,410,000	1.12	6,077,594.00	

	SSE PLC	222,000	16.97	3,767,340.00	
	NATIONAL GRID PLC	751,000	10.90	8,189,655.00	
	SEVERN TRENT PLC	53,000	27.98	1,482,940.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	135,000	10.67	1,440,450.00	
	3I GROUP PLC	202,000	11.61	2,345,220.00	
	ABRDN PLC	420,000	1.47	619,500.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	65,000	7.98	518,700.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	66,900	79.56	5,322,564.00	
	SCHRODERS PLC	24,000	26.46	635,040.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	104,000	10.70	1,113,320.00	
	EXPERIAN PLC	186,000	26.05	4,845,300.00	
	INTERTEK GROUP PLC	31,000	39.20	1,215,200.00	
	RELX PLC	394,000	22.36	8,809,840.00	
	INFORMA PLC	300,000	5.44	1,633,800.00	
	PEARSON	143,000	8.98	1,284,998.00	
	WPP PLC	235,000	7.31	1,717,850.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	195,000	6.32	1,233,180.00	
小計	銘柄数：80			363,299,529.05	
				(59,050,705,451)	
	組入時価比率：4.3%			4.5%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	41,000	17.92	734,720.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,370	664.50	910,365.00	
	GIVAUDAN-REG	1,910	3,071.00	5,865,610.00	
	SIKA AG-REG	29,800	217.00	6,466,600.00	
	HOLCIM LTD	114,000	43.76	4,988,640.00	
	SIG GROUP AG	66,000	22.52	1,486,320.00	
	GEBERIT AG-REG	7,290	442.60	3,226,554.00	
	ABB LTD	333,000	26.73	8,901,090.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	4,900	163.40	800,660.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,500	168.75	1,434,375.00	
	VAT GROUP AG	5,300	233.60	1,238,080.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	10,900	216.60	2,360,940.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	107,300	105.95	11,368,435.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	6,200	225.30	1,396,860.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	10,500	42.10	442,050.00	
		710	1,959.00	1,390,890.00	

	BARRY CALLEBAUT AG				
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	227	10,260.00	2,329,020.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	22	104,600.00	2,301,200.00	
	NESTLE SA-REG	575,200	113.00	64,997,600.00	
	ALCON INC	101,400	65.62	6,653,868.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	10,900	253.30	2,760,970.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	22,100	108.70	2,402,270.00	
	NOVARTIS AG-REG	443,200	79.82	35,376,224.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	143,600	319.20	45,837,120.00	
	ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	5,400	385.20	2,080,080.00	
	BALOISE HOLDING AG	9,900	138.00	1,366,200.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	6,430	507.80	3,265,154.00	
	SWISS RE LTD	62,700	78.74	4,936,998.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	30,600	430.00	13,158,000.00	
	TEMENOS AG-REG	13,700	78.02	1,068,874.00	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	34,200	47.63	1,628,946.00	
	SWISSCOM AG-REG	5,290	503.00	2,660,870.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	540,000	4.99	2,699,460.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	46,300	47.25	2,187,675.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	4,640	933.20	4,330,048.00	
	UBS GROUP AG	717,000	15.43	11,063,310.00	
	BACHEM HOLDING AG-REG B	7,900	63.25	499,675.00	
	LONZA AG-REG	15,090	514.60	7,765,314.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	33,000	30.30	999,900.00	
	SGS SA-REG	1,270	2,171.00	2,757,170.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	15,300	83.80	1,282,140.00	
小計	銘柄数：41			279,420,275.00	
				(40,121,957,287)	
	組入時価比率：2.9%			3.1%	
スウェーデン ローナ	BOLIDEN AB	53,000	334.90	17,749,700.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	19,000	441.70	8,392,300.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B	123,000	149.05	18,333,150.00	
	ASSA ABLOY AB-B	209,000	214.40	44,809,600.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	318,000	104.40	33,199,200.00	
	SKANSKA AB-B SHS	66,000	155.05	10,233,300.00	

INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	33,000	204.00	6,732,000.00	
LIFCO AB-B SHS	52,000	166.75	8,671,000.00	
ALFA LAVAL AB	63,000	281.90	17,759,700.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	542,000	108.64	58,882,880.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	314,000	97.60	30,646,400.00	
EPIROC AB - A	129,000	161.75	20,865,750.00	
EPIROC AB - B	79,000	145.85	11,522,150.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	94,000	68.70	6,457,800.00	
INDUTRADE AB	55,000	189.25	10,408,750.00	
SANDVIK AB	216,000	161.80	34,948,800.00	
SKF AB-B SHARES	78,000	155.25	12,109,500.00	
VOLVO AB-A SHS	40,000	172.30	6,892,000.00	
VOLVO AB-B SHS	308,000	165.60	51,004,800.00	
SECURITAS AB-B SHS	54,000	90.58	4,891,320.00	
VOLVO CAR AB-B	120,000	57.82	6,938,400.00	
ELECTROLUX AB-B	41,000	127.16	5,213,560.00	
EVOLUTION AB	36,300	849.50	30,836,850.00	
HENNES&MAURITZ AB-B	146,000	112.00	16,352,000.00	
SWEDISH MATCH AB	325,000	109.05	35,441,250.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	124,000	229.70	28,482,800.00	
GETINGE AB-B SHS	45,000	203.40	9,153,000.00	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	36,000	230.00	8,280,000.00	
NORDEA BANK ABP	705,000	98.94	69,752,700.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	331,000	105.75	35,003,250.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	301,000	86.16	25,934,160.00	
SWEDBANK AB	186,000	139.60	25,965,600.00	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	24,092	233.30	5,620,663.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	32,000	231.00	7,392,000.00	
INVESTOR AB-A SHS	105,000	179.15	18,810,750.00	
INVESTOR AB-B SHS	367,000	170.20	62,463,400.00	
KINNEVIK AB - B	44,000	151.40	6,661,600.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	15,500	427.50	6,626,250.00	
ERICSSON LM-B	590,000	77.31	45,612,900.00	
HEXAGON AB-B SHS	394,000	108.55	42,768,700.00	
TELIA CO AB	530,000	37.24	19,737,200.00	

小計	TELE 2 AB-B SHS	116,000	112.40	13,038,400.00	
	EQT AB	59,000	236.10	13,929,900.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	141,000	57.17	8,060,970.00	
	SAGAX AB-B	40,000	222.90	8,916,000.00	
	EMBRACER GROUP AB	134,000	64.00	8,576,000.00	
	銘柄数：46			980,078,403.60	
				(12,770,421,598)	
	組入時価比率：0.9%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	64,986	369.60	24,018,825.60	
	EQUINOR ASA	200,000	400.65	80,130,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	33,100	403.00	13,339,300.00	
	NORSK HYDRO	266,000	64.90	17,263,400.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	17,000	346.20	5,885,400.00	
	MOWI ASA	84,000	198.30	16,657,200.00	
	ORKLA ASA	153,000	82.96	12,692,880.00	
	SALMAR ASA	11,400	645.00	7,353,000.00	
	DNB BANK ASA	194,000	186.70	36,219,800.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	40,000	204.20	8,168,000.00	
	TELENOR ASA	146,000	106.45	15,541,700.00	
	ADEVINTA ASA	63,000	79.60	5,014,800.00	
	銘柄数：12			242,284,305.60	
				(3,428,322,924)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	20,400	430.10	8,774,040.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	40,200	415.30	16,695,060.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	1,700	1,402.00	2,383,400.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	201,000	183.94	36,971,940.00	
	DSV A/S	39,300	1,049.00	41,225,700.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	620	16,160.00	10,019,200.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,090	16,610.00	18,104,900.00	
	PANDORA A/S	20,000	429.60	8,592,000.00	
	CARLSBERG B	20,600	938.20	19,326,920.00	
	COLOPLAST-B	24,300	847.80	20,601,540.00	
	DEMANT A/S	20,100	227.30	4,568,730.00	

豪ドル	GN STORE NORD A/S	24,100	205.90	4,962,190.00	
	GENMAB A/S	13,300	2,690.00	35,777,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	338,300	782.80	264,821,240.00	
	DANSKE BANK AS	132,000	99.20	13,094,400.00	
	TRYG A/S	76,000	166.95	12,688,200.00	
	ORSTED A/S	38,700	726.00	28,096,200.00	
	小計 銘柄数：17			546,702,660.00	
				(10,272,542,981)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
	AMPOL LTD	49,000	32.98	1,616,020.00	
	SANTOS LTD.	672,000	7.97	5,355,840.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	48,000	26.23	1,259,040.00	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	391,000	35.08	13,716,280.00	
	ORICA LTD	99,000	15.34	1,518,660.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	92,000	33.71	3,101,320.00	
	BHP GROUP LIMITED	1,034,000	37.91	39,198,940.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	104,000	16.45	1,710,800.00	
	EVOLUTION MINING LTD	340,000	2.25	765,000.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	343,000	16.41	5,628,630.00	
	MINERAL RESOURCES LTD	34,000	59.94	2,037,960.00	
	NEWCREST MINING	175,000	17.17	3,004,750.00	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	222,000	7.47	1,658,340.00	
	RIO TINTO LTD	75,700	91.77	6,946,989.00	
	SOUTH32 LTD	930,000	4.15	3,859,500.00	
	REECE LTD	49,000	15.28	748,720.00	
	BRAMBLES LTD	295,000	12.26	3,616,700.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	170,000	5.11	868,700.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	380,000	3.71	1,409,800.00	
	TRANSURBAN GROUP	618,000	13.81	8,534,580.00	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	126,000	34.64	4,364,640.00	
	DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	13,600	60.10	817,360.00	
	LOTTERY CORP LTD/THE	480,000	4.40	2,112,000.00	
	WESFARMERS LIMITED	230,000	46.39	10,669,700.00	
	COLES GROUP LTD	274,000	17.63	4,830,620.00	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	284,000	7.53	2,138,520.00	

	WOOLWORTHS GROUP LTD	246,000	36.94	9,087,240.00	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	156,000	13.18	2,056,080.00	
	COCHLEAR LTD	12,800	211.13	2,702,464.00	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	36,500	70.00	2,555,000.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	90,000	33.62	3,025,800.00	
	CSL LIMITED	98,400	294.80	29,008,320.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	610,000	22.63	13,804,300.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	348,700	96.51	33,653,037.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	658,000	30.34	19,963,720.00	
	WESTPAC BANKING CORP	714,000	21.35	15,243,900.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	480,000	4.60	2,208,000.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	590,000	3.63	2,141,700.00	
	QBE INSURANCE	312,000	11.88	3,706,560.00	
	SUNCORP GROUP LTD	268,000	10.74	2,878,320.00	
	COMPUTERSHARE LTD	113,000	23.88	2,698,440.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	28,000	57.25	1,603,000.00	
	XERO LIMITED	28,300	83.77	2,370,691.00	
	TELSTRA CORP LTD	850,000	3.89	3,306,500.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	370,000	6.13	2,268,100.00	
	APA GROUP	229,000	10.65	2,438,850.00	
	ASX LTD	37,800	77.11	2,914,758.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	75,100	179.35	13,469,185.00	
	IDP EDUCATION LTD	46,000	27.79	1,278,340.00	
	REA GROUP LTD	10,400	122.62	1,275,248.00	
	SEEK LTD	70,000	20.51	1,435,700.00	
小計	銘柄数：51			308,582,662.00	
				(29,559,133,192)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	270,000	7.61	2,054,700.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	109,000	19.35	2,109,150.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	380,000	5.43	2,063,400.00	
	MERCURY NZ LTD	137,000	6.08	833,645.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	250,000	5.00	1,250,000.00	
小計	銘柄数：5			8,310,895.00	

				(714,404,534)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	330,000	13.88	4,580,400.00	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	550,040	48.95	26,924,458.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	276,000	90.55	24,991,800.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	280,000	17.86	5,000,800.00	
	MTR CORP	307,000	39.65	12,172,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	441,000	42.15	18,588,150.00	
	SANDS CHINA LTD	512,000	16.70	8,550,400.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	410,000	14.70	6,027,000.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	350,000	21.70	7,595,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,759,806	5.26	9,256,579.56	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	780,000	26.75	20,865,000.00	
	HANG SENG BANK	161,000	121.10	19,497,100.00	
	AIA GROUP LTD	2,469,000	75.15	185,545,350.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	719,600	10.50	7,555,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	134,000	45.25	6,063,500.00	
	CLP HLDGS	339,000	65.70	22,272,300.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	277,000	45.05	12,478,850.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	2,220,383	7.44	16,519,649.52	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	245,000	306.40	75,068,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	409,040	52.80	21,597,312.00	
	ESR GROUP LTD	380,000	21.30	8,094,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	460,000	13.00	5,980,000.00	
	HENDERSON LAND	310,443	25.30	7,854,207.90	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	309,916	25.05	7,763,395.80	
	SINO LAND CO.LTD	730,000	11.68	8,526,400.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	295,000	92.90	27,405,500.00	
	SWIRE PACIFIC-A	104,000	54.80	5,699,200.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	230,000	18.24	4,195,200.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	350,000	36.75	12,862,500.00	
小計	銘柄数：29			599,530,402.78	
				(10,713,608,297)	

		組入時価比率：0.8%			0.8%	
シンガポール ドル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	310,000	3.76	1,165,600.00		
	KEPPEL CORP.	313,000	7.41	2,319,330.00		
	SINGAPORE AIRLINES LTD	280,000	5.29	1,481,200.00		
	GENTING SINGAPORE LTD	1,130,000	0.77	875,750.00		
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	380,000	4.03	1,531,400.00		
	DBS GROUP HLDGS	367,000	32.64	11,978,880.00		
	OCBC-ORD	694,000	12.00	8,328,000.00		
	UNITED OVERSEAS BANK	239,000	27.16	6,491,240.00		
	VENTURE CORP LTD	58,000	17.70	1,026,600.00		
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,710,000	2.63	4,497,300.00		
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	173,000	9.45	1,634,850.00		
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	530,000	3.67	1,945,100.00		
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	8.29	580,300.00		
	UOL GROUP LIMITED	87,000	7.03	611,610.00		
	小計 銘柄数：14			44,467,160.00		
				(4,453,830,745)		
		組入時価比率：0.3%			0.3%	
新シェケル	ICL GROUP LTD	139,000	32.60	4,531,400.00		
	ELBIT SYSTEMS LTD	5,000	689.90	3,449,500.00		
	BANK HAPOLIM BM	254,000	34.55	8,775,700.00		
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	315,000	35.17	11,078,550.00		
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	251,000	20.30	5,095,300.00		
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	33,000	138.30	4,563,900.00		
	NICE LTD	12,900	719.90	9,286,710.00		
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	22,000	154.20	3,392,400.00		
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	470,000	5.81	2,733,050.00		
	AZRIELI GROUP	8,600	274.50	2,360,700.00		
	小計 銘柄数：10			55,267,210.00		
				(2,278,749,969)		
		組入時価比率：0.2%			0.2%	
合計				1,313,189,383,775		
				(1,313,189,383,775)		

(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9月6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	4,662,090.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	61,000	2,136,830.00	
		AMERICAN TOWER CORP	93,200	23,379,220.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	361,000	2,303,180.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,500	5,771,535.00	
		BOSTON PROPERTIES	30,700	2,472,578.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	19,800	2,508,462.00	
		CROWN CASTLE INC	87,900	14,746,104.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	58,800	6,954,864.00	
		DUKE REALTY CORP	77,500	4,472,525.00	
		EQUINIX INC	18,470	11,657,525.20	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34,600	2,420,270.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	72,800	5,372,640.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,400	3,564,132.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	27,100	5,409,160.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	52,000	2,502,760.00	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	76,000	1,821,720.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	106,000	2,741,160.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	147,000	2,537,220.00	
		INVITATION HOMES INC	124,000	4,522,280.00	
		IRON MOUNTAIN INC	57,700	3,007,901.00	
		KIMCO REALTY CORP	123,000	2,611,290.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	119,000	1,704,080.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,600	3,875,592.00	
		PROLOGIS INC	151,900	18,515,091.00	
		PUBLIC STORAGE	32,500	10,822,175.00	
		REALTY INCOME CORP	124,100	8,400,329.00	
		REGENCY CENTERS CORP	31,900	1,929,312.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	21,900	6,968,799.00	

小計	SIMON PROPERTY GROUP INC	67,200	6,755,616.00	
	SUN COMMUNITIES INC	25,400	3,841,496.00	
	UDR INC	64,000	2,900,480.00	
	VENTAS INC	81,700	3,868,495.00	
	VICI PROPERTIES INC	194,000	6,337,980.00	
	VORNADO REALTY TRUST	32,000	836,160.00	
	WELLTOWER INC	93,800	7,112,854.00	
	WEYERHAEUSER CO	152,000	5,148,240.00	
	WP CAREY INC	38,800	3,247,560.00	
	銘柄数：38	2,955,270	209,839,705.20	
カナダドル			(29,434,215,448)	
	組入時価比率：2.2%		87.1%	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	663,944.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,000	558,880.00	
小計	銘柄数：2	42,900	1,222,824.00	
			(130,952,222)	
	組入時価比率：0.0%		0.4%	
ユーロ	COVIVIO	8,100	442,260.00	
	GECINA SA	9,600	869,280.00	
	KLEPIERRE	40,000	802,000.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,900	1,195,717.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,000	849,700.00	
	銘柄数：5	110,600	4,158,957.00	
			(581,089,472)	
	組入時価比率：0.0%		1.7%	
英ポンド	BRITISH LAND	183,000	755,241.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	152,000	961,856.00	
	SEGRO PLC	245,000	2,248,120.00	
	銘柄数：3	580,000	3,965,217.00	
			(644,506,371)	
豪ドル	DEXUS/AU	219,000	1,846,170.00	
	GOODMAN GROUP	346,000	6,522,100.00	
	GPT GROUP	380,000	1,592,200.00	
	LENDLEASE GROUP	135,000	1,351,350.00	
	MIRVAC GROUP	750,000	1,545,000.00	

	小計	SCENTRE GROUP	1,100,000	3,168,000.00	
		STOCKLAND TRUST GROUP	460,000	1,628,400.00	
		VICINITY CENTRES	800,000	1,516,000.00	
		銘柄数：8	4,190,000	19,169,220.00	
		組入時価比率：0.1%		(1,836,219,583)	5.4%
	香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	2,970,400.00	
		LINK REIT	437,000	27,028,450.00	
	小計	銘柄数：2	907,000	29,998,850.00	
		組入時価比率：0.0%		(536,079,449)	1.6%
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	710,040	2,023,614.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,044,221	2,130,210.84	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	710,029	1,207,049.30	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	490,000	906,500.00	
		銘柄数：4	2,954,290	6,267,374.14	
	小計	組入時価比率：0.0%		(627,740,193)	1.9%
		合計		33,790,802,738	
				(33,790,802,738)	

(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 9月 6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	19,289,304,321	-	18,597,068,739	692,235,582
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

買建	2,371,096,914	-	2,370,704,130	392,784
米ドル	1,985,726,825	-	1,984,618,995	1,107,830
カナダドル	95,946,849	-	96,372,270	425,421
ユーロ	167,832,636	-	167,661,960	170,676
スイスフラン	121,590,604	-	122,050,905	460,301
合計	-	-	-	692,628,366

（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。

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。

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 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,603,064,000
コール・ローン	273,063,037
株式	70,277,637,937
投資信託受益証券	3,164,143,330
投資証券	81,159,462
派生商品評価勘定	533,026
未収入金	390,388
未収配当金	159,138,622
差入委託証拠金	903,424,251
流動資産合計	77,462,554,053
資産合計	77,462,554,053
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	99,612,983

(2022年 9月 6日現在)

未払解約金	5,027,231
未払利息	280
その他未払費用	4,315,200
流動負債合計	108,955,694
負債合計	108,955,694
純資産の部	
元本等	
元本	48,484,354,580
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	28,869,243,779
元本等合計	77,353,598,359
純資産合計	77,353,598,359
負債純資産合計	77,462,554,053

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 9月 6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	1.5954円
(10,000口当たり純資産額)	(15,954円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2022年 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2021年 9月 7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	42,620,989,329円
同期中における追加設定元本額	10,745,230,933円
同期中における一部解約元本額	4,881,865,682円
期末元本額	48,484,354,580円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド2015	19,180,408円
野村資産設計ファンド2020	20,623,830円
野村資産設計ファンド2025	33,510,094円
野村資産設計ファンド2030	52,003,226円
野村資産設計ファンド2035	46,822,864円
野村資産設計ファンド2040	86,740,536円
野村資産設計ファンド2045	17,827,956円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,681,482,199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	508,960,546円
野村資産設計ファンド2050	21,867,769円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	6,040,878円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	3,596,840円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,853,683円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,474,743円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	969,372円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	899,793円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,108,868円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,180,412円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	10,040,913円
野村つみたて外国株投信	4,823,561,304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）	1,053,212,462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）	1,972,842,609円

世界６資産分散ファンド	111,038,033円
野村資産設計ファンド２０６０	16,110,362円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIE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	1,306,934,449円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,299,045,016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）	4,184,358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）	463,634,330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）	777,460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）	32,708,746,618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	17,835,382円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	16,916,709円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	13,122,277円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	9,376,218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）	57,818,168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9月6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	10.35	210,105.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL CO LTD	85,000	1.71	145,605.00	
		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	
		PHOSAGRO PJSC	4,007	0.00	0.00	
		PHOSAGRO PJSC-GDR	78	0.00	0.00	
		PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1	0.00	0.00	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	11,579	101.29	1,172,836.91	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	21,600	5.68	122,688.00	
		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	45.69	287,847.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	34,600	26.33	911,018.00
LI AUTO INC - ADR	45,600	26.58	1,212,048.00
NIO INC ADR	114,300	17.73	2,026,539.00
XPENG INC ADR	35,300	16.74	590,922.00
H WORLD GROUP LTD-ADR	15,900	35.32	561,588.00
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	45,200	25.29	1,143,108.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	35,500	47.80	1,696,900.00
OZON HOLDINGS PLC - ADR	5,300	0.00	0.00
PINDUODUO INC ADR	42,180	72.19	3,044,974.20
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	41,400	10.70	442,980.00
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	11.40	80,940.00
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	56,300	1.34	75,442.00
BEIGENE, LTD ADR	3,830	166.88	639,150.40
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	4,500	46.13	207,585.00
ZAI LAB LTD - ADR	7,090	46.21	327,628.90
HUTCHMED CHINA-ADR	7,800	12.90	100,620.00
BANCO DE CHILE-ADR	18,100	20.13	364,353.00
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	13,800	16.74	231,012.00
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	10,030	28.23	283,146.90
CREDICORP LTD	6,350	126.85	805,497.50
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	811,000	0.00	0.00
STATE BANK OF INDIA-GDR	14,890	67.60	1,006,564.00
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	3.12	117,925.60
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	4,800	64.43	309,264.00
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	28,650	0.00	0.00
ENEL CHILE SA-ADR	42,900	1.78	76,362.00

	INTER RAO UES PJSC	3,660,000	0.00	0.00	
	360 DIGITECH INC-ADR	6,000	14.12	84,720.00	
	LUFAX HOLDING LTD	67,100	4.15	278,465.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	133,000	0.00	0.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	29,730	5.50	163,515.00	
	KE HOLDINGS INC ADR	55,600	16.42	912,952.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.83	73,536.67	
	IQIYI INC-ADR	21,400	3.53	75,542.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	59,400	5.06	300,564.00	
	AUTOHOME INC-ADR	7,500	34.00	255,000.00	
	JOYY INC	4,250	29.02	123,335.00	
	KANZHUN LTD	15,100	22.71	342,921.00	
	VK CO LTD GDR	7,000	0.00	0.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	4,500	19.04	85,680.00	
	YANDEX NV-A	23,640	0.00	0.00	
小計	銘柄数：64			20,890,881.08	
				(2,930,363,889)	
	組入時価比率：3.8%			4.2%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	93,958	38.69	3,635,235.02	
	CEMEX SAB - CPO	1,234,985	7.71	9,521,734.35	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	254,983	76.13	19,411,855.79	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	160.87	1,352,916.70	
	ALFA S.A.B. -A	218,000	13.06	2,847,080.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	69.46	2,424,154.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	18,900	433.31	8,189,559.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	30,400	293.00	8,907,200.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	16,400	145.39	2,384,396.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	441,000	70.48	31,081,680.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,000	137.40	6,045,600.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	52,000	120.74	6,278,480.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	170,300	130.25	22,181,575.00	
	GRUMA S.A.B. -B	15,600	220.84	3,445,104.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	107,000	70.48	7,541,360.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	110,000	27.87	3,065,700.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	213,200	123.86	26,406,952.00	

小計	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	169,000	33.18	5,607,420.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,351,000	17.38	40,860,380.00	
	GRUPO TELEvisa SAB - SER CPO	201,000	25.45	5,115,450.00	
	銘柄数：20			216,303,831.86	
	組入時価比率：2.0%			(1,522,086,804)	2.2%
リアル	COSAN SA	99,000	19.56	1,936,440.00	
	PETRO RIO SA	65,300	29.54	1,928,962.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	302,000	37.21	11,237,420.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	397,000	33.33	13,232,010.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	13.76	660,480.00	
	BRASKEM SA-PREF A	13,200	32.43	428,076.00	
	KLABIN SA-UNIT	61,000	18.84	1,149,240.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	13.69	632,478.00	
	GERDAU SA PFD NPV	95,000	24.42	2,319,900.00	
	VALE SA	333,652	65.22	21,760,783.44	
	SUZANO SA	62,960	44.73	2,816,200.80	
	WEG SA	134,748	30.90	4,163,713.20	
	LOCALIZA RENT A CAR	61,660	63.50	3,915,410.00	
	RUMO SA	96,000	20.57	1,974,720.00	
	CCR SA	121,000	14.28	1,727,880.00	
	AMERICANAS SA	60,039	15.45	927,602.55	
	MAGAZINE LUIZA SA	230,000	4.32	993,600.00	
	LOJAS RENNER S.A.	80,974	26.97	2,183,868.78	
	VIBRA ENERGIA SA	83,600	19.00	1,588,400.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	54,000	20.34	1,098,360.00	
	RAIA DROGASIL SA	102,000	22.65	2,310,300.00	
	AMBEV SA	389,956	15.55	6,063,815.80	
	BRF SA	63,000	16.30	1,026,900.00	
	JBS SA	74,600	29.00	2,163,400.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	62,500	15.40	962,500.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	420,987	7.84	3,300,538.08	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	29,800	34.97	1,042,106.00	
	HYPERA SA	33,000	43.65	1,440,450.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	122,153	16.06	1,961,777.18	

	BANCO BRADESCO SA - PREF	435,042	19.35	8,418,062.70	
	BANCO DO BRASIL SA	72,800	41.63	3,030,664.00	
	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	29.90	729,560.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	414,991	26.98	11,196,457.18	
	ITAUSA SA	378,017	9.41	3,557,139.97	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	67,000	28.68	1,921,560.00	
	TOTVS SA	40,000	29.09	1,163,600.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	41,605	41.78	1,738,256.90	
	TIM SA	82,952	11.89	986,299.28	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	47.96	863,280.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	93,800	46.45	4,357,010.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	135,987	12.11	1,646,802.57	
	CPFL ENERGIA SA	18,400	36.23	666,632.00	
	ENERGISA SA-UNITS	20,800	44.20	919,360.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	91,000	25.23	2,295,930.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	33,600	50.47	1,695,792.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	499,999	12.85	6,424,987.15	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	90,000	26.45	2,380,500.00	
	ENGIE BRASIL SA	16,600	40.69	675,454.00	
小計	銘柄数：48			151,614,679.58	
				(4,125,859,952)	
	組入時価比率：5.3%			5.9%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	8,051.00	208,520,900.00	
	EMPRESAS CMPC SA	119,000	1,800.00	214,200,000.00	
	CIA SUD AMERICANA VAPORES	1,226,200	85.15	104,410,930.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,325.00	116,715,000.00	
	CENCOSUD SA	126,000	1,380.00	173,880,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	6,282	28,720.00	180,419,040.00	
	ENEL AMERICAS SA	1,495,000	101.98	152,460,100.00	
小計	銘柄数：7			1,150,605,970.00	
				(183,049,903)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
コロンビアペソ	BANCOLOMBIA SA	15,900	34,400.00	546,960,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	18,170.00	614,146,000.00	
小計	銘柄数：2			1,161,106,000.00	

				(36,390,223)	
	組入時価比率：0.0%			0.1%	
ユーロ	MYTILINEOS S.A.	8,000	14.40	115,200.00	
	FF GROUP	2,030	0.00	0.00	
	OPAP SA	20,200	13.00	262,600.00	
	JUMBO SA	6,732	13.74	92,497.68	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	206,500	0.88	182,752.50	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	180,800	0.88	160,188.80	
	NATIONAL BANK OF GREECE	43,700	3.05	133,285.00	
	HELLENIC TELECOM	18,000	15.30	275,400.00	
	PUBLIC POWER CORP	20,000	5.42	108,400.00	
	小計 銘柄数：9			1,330,323.98	
				(185,872,866)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	12,700	337.50	4,286,250.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	116,000	30.98	3,593,680.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	41,460	28.78	1,193,218.80	
	KOC HLDGS	53,000	50.15	2,657,950.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	88,000	25.74	2,265,120.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	44,000	75.15	3,306,600.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	6,200	336.00	2,083,200.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	45,000	113.90	5,125,500.00	
	AKBANK T.A.S	205,000	14.19	2,908,950.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	81,000	27.86	2,256,660.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	203,995	9.64	1,966,511.80	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	117,000	22.98	2,688,660.00	
	小計 銘柄数：12			34,332,300.60	
				(264,472,011)	
	組入時価比率：0.3%			0.4%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	571.50	2,886,075.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	73.30	3,078,600.00	
	CEZ AS	12,500	911.00	11,387,500.00	
小計	銘柄数：3			17,352,175.00	
				(98,638,438)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	

フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	37,500	2,694.00	101,025,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	11,700	7,875.00	92,137,500.00	
	OTP BANK NYRT	18,300	8,450.00	154,635,000.00	
	小計 銘柄数：3			347,797,500.00	
	組入時価比率：0.2%			(120,413,059)	0.2%
ズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	34,000	59.62	2,027,080.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	175,000	5.55	971,600.00	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	13,800	88.66	1,223,508.00	
	LPP SA	94	8,330.00	783,020.00	
	ALLEGRO.EU SA	29,400	23.74	697,956.00	
	DINO POLSKA SA	3,820	339.30	1,296,126.00	
	BANK PEKAO SA	15,700	62.44	980,308.00	
	MBANK	1,100	217.00	238,700.00	
	PKO BANK POLSKI SA	71,400	22.84	1,630,776.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,100	209.00	647,900.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	50,500	27.55	1,391,275.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	5.79	226,678.50	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	73,000	7.06	515,964.00	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	19.30	364,770.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,960	81.66	405,033.60	
	小計 銘柄数：15			13,400,695.10	
	組入時価比率：0.5%			(397,348,030)	0.6%
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	130,000	8.60	1,118,000.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	150,000	7.69	1,153,500.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,080,900	3.70	7,699,330.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	283,000	25.75	7,287,250.00	
	CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	129,000	3.55	457,950.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,700,000	3.74	6,358,000.00	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO-H	138,000	35.45	4,892,100.00	
	DONGYUE GROUP LTD	108,000	8.34	900,720.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	107,000	29.70	3,177,900.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	309,000	7.50	2,317,500.00	

CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	176,000	4.73	832,480.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	280,000	2.84	795,200.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	160,000	7.26	1,161,600.00	
CMOC GROUP LTD-H	240,000	3.42	820,800.00	
GANFENG LITHIUM CO LTD	31,640	62.95	1,991,738.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	9.44	925,120.00	
MMG LTD	312,000	2.07	645,840.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	60,000	13.10	786,000.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	94,000	5.99	563,060.00	
ZIJIN MINING GROUP CO-H	489,000	8.43	4,122,270.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	118,000	6.17	728,060.00	
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	3.67	741,340.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	92,000	9.14	840,880.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	3.33	580,752.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	134,000	15.68	2,101,120.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	420,000	4.53	1,902,600.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	9.38	1,437,485.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	55,984	11.22	628,140.48	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	55,200	36.15	1,995,480.00	
CITIC LTD	473,000	8.13	3,845,490.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	225,940	5.42	1,224,594.80	
CRRC CORP LTD-H	320,000	2.88	921,600.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	57,000	18.12	1,032,840.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	77,000	8.37	644,490.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	50,000	7.46	373,000.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	149,800	10.26	1,536,948.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	116,000	3.47	402,520.00	
BOC AVIATION LTD	15,000	59.80	897,000.00	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	281,000	3.60	1,011,600.00	
AIR CHINA LIMITED-H	148,000	5.90	873,200.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	4.04	428,240.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	273,000	10.52	2,871,960.00	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	10,500	149.90	1,573,950.00	

LTD				
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	204,000	4.72	962,880.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	106,000	11.46	1,214,760.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	182,000	5.34	971,880.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	6.67	453,560.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	6.50	513,500.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	5.93	676,020.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	43,600	35.45	1,545,620.00	
MINTH GROUP LTD	54,000	21.00	1,134,000.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	2.74	597,320.00	
BYD CO LTD-H	68,500	215.00	14,727,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	232,000	4.85	1,125,200.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	490,000	14.08	6,899,200.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	248,000	11.14	2,762,720.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	285,890	6.65	1,901,168.50	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	86,000	14.22	1,222,920.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	192,000	24.75	4,752,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	101,600	88.55	8,996,680.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	350,000	4.01	1,403,500.00	
LI NING CO LTD	196,500	67.35	13,234,275.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	67,400	72.55	4,889,870.00	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	105,000	10.40	1,092,000.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	111,000	17.72	1,966,920.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS	57,000	14.42	821,940.00	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	125,600	15.84	1,989,504.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	1,266,180	88.50	112,056,930.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	386,000	4.43	1,709,980.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	97,000	52.95	5,136,150.00	
JD.COM, INC.	179,767	236.80	42,568,825.60	
MEITUAN-CLASS B	367,300	173.60	63,763,280.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	36,600	21.20	775,920.00	

CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LIMITED	42,000	15.10	634,200.00	
POP MART INTERNATIONAL GROUP	44,600	19.02	848,292.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	202,000	6.14	1,240,280.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	55,000	34.95	1,922,250.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	7,000	117.51	822,570.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	135,333	51.30	6,942,582.90	
NONGFU SPRING LTD	147,000	45.05	6,622,350.00	
TSING TAO BREWERY CO-H	50,000	70.85	3,542,500.00	
CHINA FEIHE LTD	292,000	5.87	1,714,040.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	261,000	33.05	8,626,050.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	3.57	398,055.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	168,000	13.52	2,271,360.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	125,000	6.43	803,750.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	388,000	5.39	2,091,320.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	31,000	17.54	543,740.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	147,000	12.68	1,863,960.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	23,000	21.50	494,500.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	60,000	36.85	2,211,000.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	47,000	15.56	731,320.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	248,000	10.30	2,554,400.00	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO	25,200	41.85	1,054,620.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	163,000	4.70	766,100.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	11.40	580,260.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	132,400	16.80	2,224,320.00	
3SBIO, INC	119,000	5.27	627,130.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	104,000	29.90	3,109,600.00	
CANSINO BIOLOGICS INC	5,800	53.50	310,300.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	98,000	11.02	1,079,960.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	248,000	3.32	823,360.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	791,520	7.85	6,213,432.00	
HANSON PHARMACEUTICAL GROUP	84,000	13.60	1,142,400.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	21.85	753,825.00	

SINO BIOPHARMACEUTICAL	868,500	3.99	3,465,315.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,510,000	2.52	6,325,200.00	
BANK OF CHINA LTD-H	6,630,000	2.72	18,033,600.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	745,790	4.45	3,318,765.50	
CHINA CITIC BANK-H	810,000	3.39	2,745,900.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,021,000	4.77	38,260,170.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	2.40	616,800.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	334,192	39.65	13,250,712.80	
CHINA MINSHENG BANKING-H	589,800	2.47	1,456,806.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,710,000	3.90	18,369,000.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	681,000	4.64	3,159,840.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	5.62	865,480.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	607,000	11.06	6,713,420.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	215,000	16.14	3,470,100.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	7.97	824,671.84	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	72,000	18.24	1,313,280.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	850,000	2.42	2,057,000.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	550,420	8.72	4,799,662.40	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	528,000	45.45	23,997,600.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	58,000	22.05	1,278,900.00	
CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED	280,000	5.87	1,643,600.00	
GDS HOLDINGS LIMITED	84,200	23.90	2,012,380.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	13.66	901,560.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	219,000	13.40	2,934,600.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS	57,000	6.15	350,550.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	51,500	21.60	1,112,400.00	
ZTE CORP-H	76,052	16.14	1,227,479.28	
LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
LENOVO GROUP LTD	604,000	6.21	3,750,840.00	
XIAOMI CORPORATION	1,304,000	10.86	14,161,440.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,000	14.28	742,560.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	60,000	25.00	1,500,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	65,000	7.44	483,600.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP	61,500	101.50	6,242,250.00	

CO LTD				
FLAT GLASS GROUP CO LTD	28,000	22.75	637,000.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	46,000	22.05	1,014,300.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	398,000	9.98	3,972,040.00	
CHINA TOWER CORP LTD	3,610,000	0.96	3,465,600.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	25.45	916,200.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	247,000	10.58	2,613,260.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	76,000	29.70	2,257,200.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	64,500	116.90	7,540,050.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	316,000	6.72	2,123,520.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	405,000	1.95	789,750.00	
GUANGDONG INVESTMENT	240,000	7.00	1,680,000.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.04	644,800.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.22	1,122,520.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	124,400	13.70	1,704,280.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	190,050	15.56	2,957,178.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	10.30	850,780.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	268,000	5.06	1,356,080.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	126,000	10.20	1,285,200.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY	149,000	21.10	3,143,900.00	
CGN POWER CO LTD-H	980,000	1.87	1,832,600.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	284,000	12.18	3,459,120.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	490,000	4.44	2,175,600.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	15.46	2,319,000.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	410,000	4.10	1,681,000.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	98,000	23.80	2,332,400.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	72.35	578,800.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD	14,400	49.30	709,920.00	
WUXI APPTTEC CO LTD	30,500	81.15	2,475,075.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	299,000	64.00	19,136,000.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	70,000	7.60	532,000.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	410,000	1.79	733,900.00	

	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	320,000	21.35	6,832,000.00	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	85,000	8.36	710,600.00	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	268,444	31.15	8,362,030.60	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	52,200	34.40	1,795,680.00	
	CHINA VANKE CO LTD-H	128,000	15.32	1,960,960.00	
	CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	335,712	1.97	661,352.64	
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	718,380	2.15	1,544,517.00	
	COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	173,000	13.74	2,377,020.00	
	GREENTOWN CHINA HOLDINGS	56,000	14.46	809,760.00	
	GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.	128,000	5.40	691,200.00	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	58,080	9.63	559,310.40	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	154,000	24.95	3,842,300.00	
	SEAZEN GROUP LTD	168,000	2.51	421,680.00	
	WHARF(HOLDING)	117,000	28.95	3,387,150.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	100,000	9.97	997,000.00	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	30.25	859,100.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	0.61	530,700.00	
	BILIBILI INC	15,020	186.30	2,798,226.00	
	CHINA RUYI HOLDINGS LTD	368,000	1.88	691,840.00	
	KINGSOFT CORP LTD	91,000	23.85	2,170,350.00	
	NETEASE, INC.	172,950	138.20	23,901,690.00	
	BAIDU INC-CLASS A	186,360	137.10	25,549,956.00	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	142,300	65.65	9,341,995.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	520,700	319.00	166,103,300.00	
小計	銘柄数：196			980,353,771.74	
				(17,518,921,900)	
	組入時価比率：22.6%			24.8%	
リング	DIALOG GROUP BHD	313,044	2.24	701,218.56	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	30,000	21.10	633,000.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	190,000	8.82	1,675,800.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	296,000	4.72	1,397,120.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	6.98	235,924.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.33	512,600.00	
	MISC BHD	99,960	7.01	700,719.60	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	121,460	5.91	717,828.60	

	GENTING BHD	187,000	4.58	856,460.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.95	675,550.00	
	MR DIY GROUP M BHD	187,500	2.10	393,750.00	
	IOI CORP	247,000	4.11	1,015,170.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	42,400	22.30	945,520.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	7,300	134.90	984,770.00	
	PPB GROUP BERHAD	51,740	17.36	898,206.40	
	QL RESOURCES BHD	119,000	5.12	609,280.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	4.25	613,275.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,000	1.59	186,030.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	428,000	0.82	350,960.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	6.20	967,200.00	
	AMMB HOLDING	125,000	4.02	502,500.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	596,000	5.48	3,266,080.00	
	HONG LEONG BANK	60,960	20.90	1,274,064.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	19.10	256,360.20	
	MALAYAN BANKING	379,000	8.94	3,388,260.00	
	PUBLIC BANK BHD	1,177,000	4.67	5,496,590.00	
	RHB BANK BHD	125,023	5.78	722,632.94	
	INARI AMERTRON BHD	271,000	2.66	720,860.00	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	5.80	359,600.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	2.94	573,300.00	
	DIGI.COM BERHAD	286,000	3.58	1,023,880.00	
	MAXIS BHD	146,200	3.69	539,478.00	
	TENAGA NASIONAL	210,000	8.61	1,808,100.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	63,000	17.06	1,074,780.00	
小計	銘柄数：34			36,076,867.30	
				(1,127,701,541)	
	組入時価比率：1.5%			1.6%	
パーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	113,000	167.00	18,871,000.00	
	PTT PCL-NVDR	886,000	37.00	32,782,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	59.00	4,897,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR-RIGHTS	7,052	0.00	0.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	41.00	4,549,647.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	227,994	44.75	10,202,731.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	68,300	356.00	24,314,800.00	

SCG PACKAGING PLC-NVDR	89,700	54.50	4,888,650.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	8.50	4,046,000.00	
AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	361,000	72.25	26,082,250.00	
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	810,000	8.75	7,087,500.00	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	700,000	5.50	3,850,000.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	270,978	31.00	8,400,318.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	155,025	39.75	6,162,243.75	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	579,997	13.70	7,945,958.90	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	258,000	26.50	6,837,000.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	33.50	2,468,950.00	
CP ALL PCL-NVDR	482,000	59.75	28,799,500.00	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	20,900	99.25	2,074,325.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	112,000	30.50	3,416,000.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	25.50	7,114,500.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	17.20	3,436,560.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	912,000	29.25	26,676,000.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	215.00	6,923,000.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	49,000	152.50	7,472,500.00	
KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	16.80	4,486,440.00	
SCB X PCL-NVDR	81,000	111.50	9,031,500.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	26,300	524.00	13,781,200.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	4.62	4,250,400.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	94,600	191.50	18,115,900.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	71.75	10,045,000.00	
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	51,000	76.50	3,901,500.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	68,000	58.75	3,995,000.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	43.25	2,119,250.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	63,000	48.50	3,055,500.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET-NVDR	154,000	18.20	2,802,800.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	35.75	1,215,500.00	
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	181.50	3,139,950.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	134,000	82.75	11,088,500.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	59,000	66.25	3,908,750.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	261,000	51.00	13,311,000.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	115,000	43.50	5,002,500.00	

小計	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	185,000	69.00	12,765,000.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	8.70	5,394,000.00	
	銘柄数：44			390,708,124.15	
	組入時価比率：1.9%			(1,504,226,277)	2.1%
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	58.00	8,468,000.00	
	AYALA CORPORATION	21,102	718.50	15,161,787.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	495.60	2,708,454.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	255,005	53.00	13,515,265.00	
	SM INVESTMENTS CORP	22,100	870.00	19,227,000.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	93,000	183.00	17,019,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	43,000	248.80	10,698,400.00	
	MONDE NISSIN CORP	680,000	16.08	10,934,400.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	125.40	8,401,800.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	145,999	96.95	14,154,603.05	
	BDO UNIBANK INC	168,998	130.00	21,969,740.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	52.90	6,755,065.50	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.77	2,819,206.00	
	CONVERGE ICT SOLUTIONS INC	180,000	17.80	3,204,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,184.00	4,520,880.00	
	PLDT INC	7,000	1,690.00	11,830,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	320.00	5,408,000.00	
	ACEN CORP	617,479	7.28	4,495,247.12	
	AYALA LAND LTD	608,000	29.00	17,632,000.00	
	SM PRIME HLDGS	919,975	36.05	33,165,098.75	
	銘柄数：20			232,087,946.42	
	組入時価比率：0.7%			(571,470,150)	0.8%
ルピア	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,170,000	4,030.00	4,715,100,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	147,050	34,350.00	5,051,167,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,880,000	855.00	2,462,400,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	6,525.00	1,148,400,000.00	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK	650,000	1,665.00	1,082,250,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	760,000	1,970.00	1,497,200,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,115,813	4,090.00	4,563,675,170.00	

	VALE INDONESIA TBK	198,000	5,950.00	1,178,100,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	240,000	8,725.00	2,094,000,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,660,000	6,875.00	11,412,500,000.00	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	1,320,000	2,100.00	2,772,000,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	8,700.00	1,548,600,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	420,000	6,375.00	2,677,500,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	700,000	5,875.00	4,112,500,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	23,950.00	699,340,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	4,530.00	2,371,455,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,640.00	2,525,600,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	4,730,000	8,275.00	39,140,750,000.00	
	BANK JAGO TBK PT	368,000	8,175.00	3,008,400,000.00	
	BANK MANDIRI	1,570,000	8,950.00	14,051,500,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	610,000	8,850.00	5,398,500,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	5,860,028	4,590.00	26,897,528,520.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	1,479,000	1,275.00	1,885,725,000.00	
	TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,040,000	4,620.00	18,664,800,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	553,000	2,890.00	1,598,170,000.00	
小計	銘柄数：25			162,557,161,190.00	
				(1,528,037,315)	
	組入時価比率：2.0%			2.2%	
ウォン	HD HYUNDAI CO LTD	2,985	61,600.00	183,876,000.00	
	S-OIL CORPORATION	3,930	101,500.00	398,895,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	4,520	186,000.00	840,720,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	10,300	50,900.00	524,270,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	1,490	126,000.00	187,740,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	630	289,500.00	182,385,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	4,123	616,000.00	2,539,768,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,610	170,000.00	273,700,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	900	106,000.00	95,400,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,490	77,500.00	192,975,000.00	
	SKC CO LTD	1,450	112,000.00	162,400,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	2,241	164,500.00	368,644,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	7,399	32,400.00	239,727,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	850	612,000.00	520,200,000.00	

POSCO HOLDINGS INC	6,550	252,500.00	1,653,875,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7,000	61,800.00	432,600,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	29,500.00	124,490,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	6,900	44,950.00	310,155,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	14,400	23,200.00	334,080,000.00	
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	31,900	18,900.00	602,910,000.00	
ECOPRO BM CO LTD	3,960	102,900.00	407,484,000.00	
LG ENERGY SOLUTION	1,920	483,000.00	927,360,000.00	
CJ CORP	1,100	76,100.00	83,710,000.00	
GS HOLDINGS CORP	3,600	45,550.00	163,980,000.00	
LG CORP	7,700	79,300.00	610,610,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	6,720	115,000.00	772,800,000.00	
SK INC	3,370	225,000.00	758,250,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	33,500.00	112,225,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,410	137,000.00	193,170,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	3,210	91,700.00	294,357,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	63,000	5,730.00	360,990,000.00	
S-1 CORPORATION	1,450	56,700.00	82,215,000.00	
CJ LOGISTICS	780	116,500.00	90,870,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,810	170,500.00	308,605,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	12,600	25,550.00	321,930,000.00	
HMM COMPANY LIMITED	20,600	20,600.00	424,360,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	4,940.00	73,556,600.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	39,600.00	210,672,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	10,350.00	120,577,500.00	
HYUNDAI MOBIS	5,510	214,500.00	1,181,895,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	11,360	200,000.00	2,272,000,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	94,100.00	248,424,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	92,600.00	136,122,000.00	
KIA CORP	21,490	81,000.00	1,740,690,000.00	
COWAY CO LTD	4,970	60,900.00	302,673,000.00	
LG ELECTRONICS INC	8,870	97,200.00	862,164,000.00	
HLB INC	7,400	46,900.00	347,060,000.00	
F&F CO LTD / NEW	1,600	136,000.00	217,600,000.00	
KANGWON LAND INC	7,900	26,150.00	206,585,000.00	

LOTTE SHOPPING CO	800	97,000.00	77,600,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	71,700.00	140,532,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	154,500.00	74,932,500.00	
E-MART CO	1,710	97,100.00	166,041,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	820	397,500.00	325,950,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	95,600.00	172,080,000.00	
KT & G CORP	9,410	82,900.00	780,089,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,460	117,500.00	289,050,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	33,850.00	51,452,000.00	
LG H&H	806	672,000.00	541,632,000.00	
LG H&H-PREF	104	361,500.00	37,596,000.00	
SD BIOSENSOR INC	3,500	32,350.00	113,225,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	7,570	69,200.00	523,844,000.00	
ALTEOGEN INC	2,130	60,300.00	128,439,000.00	
CELLTRION INC	8,220	180,500.00	1,483,710,000.00	
GREEN CROSS CORP	410	153,000.00	62,730,000.00	
SEEGENE, INC.	2,720	30,100.00	81,872,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,950	106,000.00	206,700,000.00	
CELLTRION PHARM INC	1,081	73,700.00	79,669,700.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	499	297,500.00	148,452,500.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	3,320	69,300.00	230,076,000.00	
YUHAN CORPORATION	3,991	56,200.00	224,294,200.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	23,700	38,050.00	901,785,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	26,100	9,490.00	247,689,000.00	
KAKAOBANK CORP	9,500	25,600.00	243,200,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	32,200	48,100.00	1,548,820,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	37,900	34,750.00	1,317,025,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	42,300	11,600.00	490,680,000.00	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	3,360	27,900.00	93,744,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	3,800	60,100.00	228,380,000.00	
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	4,230	36,800.00	155,664,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	2,510	193,000.00	484,430,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	6,500	63,900.00	415,350,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,570	124,000.00	318,680,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	398,240	57,100.00	22,739,504,000.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	68,700	52,300.00	3,593,010,000.00	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	2,150	66,900.00	143,835,000.00	
	L&F CO LTD	2,180	212,100.00	462,378,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	1,260	338,000.00	425,880,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	23,500	16,000.00	376,000,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	4,800	136,000.00	652,800,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	4,700	566,000.00	2,660,200,000.00	
	SK HYNIX INC	45,530	91,100.00	4,147,783,000.00	
	SK SQUARE CO LTD	8,699	39,050.00	339,695,950.00	
	LG UPLUS CORP	17,400	11,350.00	197,490,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	19,600	19,850.00	389,060,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	56,100.00	176,154,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	4,640.00	113,680,000.00	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	24,737	6,540.00	161,779,980.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	9,830.00	75,985,900.00	
	SAMSUNG SECURITIES	6,800	33,650.00	228,820,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,559	815,000.00	1,270,585,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	22,550.00	133,045,000.00	
	CJ ENM CO LTD	657	95,900.00	63,006,300.00	
	HYBE CO LTD	1,220	167,500.00	204,350,000.00	
	KAKAO GAMES CORP	2,810	50,000.00	140,500,000.00	
	KRAFTON INC	2,240	236,000.00	528,640,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,296	377,500.00	489,240,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	61,000.00	89,670,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	2,860	55,100.00	157,586,000.00	
	KAKAO CORP	26,050	70,000.00	1,823,500,000.00	
	NAVER CORP	10,950	236,000.00	2,584,200,000.00	
小計	銘柄数：111			80,755,538,230.00	
				(8,301,669,330)	
	組入時価比率：10.7%			11.8%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	81.80	7,227,848.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	289,998	67.70	19,632,864.60	
	FORMOSA PLASTIC	351,424	89.30	31,382,163.20	
	NAN YA PLASTICS CORP	399,726	67.10	26,821,614.60	
	ASIA CEMENT	208,980	42.65	8,912,997.00	

TAIWAN CEMENT	534,888	39.10	20,914,120.80
CHINA STEEL	1,006,544	29.00	29,189,776.00
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	5,000	1,640.00	8,200,000.00
WALSIN LIHWA CORP	205,429	38.15	7,837,116.35
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	313,454	31.75	9,952,164.50
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	12,464	787.00	9,809,168.00
CHINA AIRLINES LTD	219,000	21.40	4,686,600.00
EVA AIRWAYS CORP	202,000	32.60	6,585,200.00
EVERGREEN MARINE	202,375	80.00	16,190,000.00
WAN HAI LINES LIMITED	49,335	76.20	3,759,327.00
YANG MING MARINE TRANSPORT	143,000	70.80	10,124,400.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	28.40	4,061,200.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	142,036	34.65	4,921,547.40
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	14,000	276.00	3,864,000.00
GIANT MANUFACTURING	23,752	230.50	5,474,836.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	14,443	448.50	6,477,685.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	32,815	163.50	5,365,252.50
POU CHEN CORP	175,468	28.40	4,983,291.20
MOMO.COM INC	3,600	673.00	2,422,800.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	26,000	587.00	15,262,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	47,816	278.00	13,292,848.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	402,836	65.70	26,466,325.20
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	362,603	17.45	6,327,422.35
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,514,212	23.25	35,205,429.00
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	1,045,044	27.55	28,790,962.20
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	895,501	26.45	23,686,001.45
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	709,710	22.95	16,287,844.50
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	974,139	35.30	34,387,106.70
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	918,644	17.65	16,214,066.60
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	914,168	15.05	13,758,228.40
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	875,520	27.15	23,770,368.00
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	291,574	49.00	14,287,126.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	117,699	190.00	22,362,810.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	911,706	20.30	18,507,631.80

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	647,035	44.05	28,501,891.75	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	1,269,789	13.10	16,634,235.90	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	587,775	56.60	33,268,065.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	1,030,113	8.51	8,766,261.63	
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	41,000	263.50	10,803,500.00	
ACER INC	256,767	21.55	5,533,328.85	
ADVANTECH CO.,LTD.	34,750	310.50	10,789,875.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	57,805	258.00	14,913,690.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	54,840	169.50	9,295,380.00	
COMPAL ELECTRONICS	354,590	22.55	7,996,004.50	
INVENTEC CO.,LTD	251,911	22.95	5,781,357.45	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	189,897	67.50	12,818,047.50	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	112.50	5,850,000.00	
PEGATRON CORP	159,692	64.50	10,300,134.00	
QUANTA COMPUTER INC	224,684	79.20	17,794,972.80	
WIWYNN CORP	7,000	728.00	5,096,000.00	
AUO CORP	717,008	17.40	12,475,939.20	
DELTA ELECTRONICS INC	158,681	255.50	40,542,995.50	
E INK HOLDINGS INC	66,000	243.00	16,038,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,040,649	108.00	112,390,092.00	
INNOLUX CORP	837,322	12.10	10,131,596.20	
LARGAN PRECISION CO LTD	8,040	1,925.00	15,477,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION	16,000	247.50	3,960,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	122,566	54.90	6,728,873.40	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	100,000	138.00	13,800,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	50.70	6,103,620.90	
YAGEO CORPORATION	34,377	308.50	10,605,304.50	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	64,410	109.50	7,052,895.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	292,658	82.30	24,085,753.40	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	840.00	1,680,000.00	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,000	1,330.00	6,650,000.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	17,000	453.00	7,701,000.00	
MEDIATEK INC	126,538	631.00	79,845,478.00	
NANYA TECHNOLOGY CO	100,000	51.10	5,110,000.00	

		NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	47,058	252.50	11,882,145.00	
		PARADE TECHNOLOGIES LTD	6,000	781.00	4,686,000.00	
		POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	211,000	30.55	6,446,050.00	
		REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	38,417	331.00	12,716,027.00	
		SILERGY CORP	28,000	490.50	13,734,000.00	
		TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,055,000	486.00	998,730,000.00	
		UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,025,500	39.80	40,814,900.00	
		VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	71.50	4,933,500.00	
		WIN SEMICONDUCTORS CORP	24,000	161.00	3,864,000.00	
		WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	21.00	5,082,000.00	
		CHUNGHWA TELECOM CO LTD	312,065	122.00	38,071,930.00	
		FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	144,000	73.00	10,512,000.00	
		TAIWAN MOBILE CO LTD	154,200	98.50	15,188,700.00	
		RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	113,112	59.90	6,775,408.80	
	小計	銘柄数：87			2,325,360,096.13	
					(10,606,199,934)	
		組入時価比率：13.7%			15.0%	
インドルピー		BHARAT PETROLEUM CORP LTD	70,000	324.75	22,732,500.00	
		COAL INDIA LTD	142,000	231.60	32,887,200.00	
		HINDUSTAN PETROLEUM CORP	64,380	238.65	15,364,287.00	
		INDIAN OIL CORPORATION LTD	268,500	70.95	19,050,075.00	
		OIL&NATURAL GAS CORP LTD	219,000	133.40	29,214,600.00	
		PETRONET LNG LTD	77,000	215.95	16,628,150.00	
		RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	253,900	2,569.80	652,472,220.00	
		ASIAN PAINTS LTD	33,300	3,424.80	114,045,840.00	
		BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	660.50	12,549,500.00	
		PI INDUSTRIES LTD	7,000	3,327.80	23,294,600.00	
		PIDILITE INDUSTRIES LTD	12,400	2,832.75	35,126,100.00	
		SRF LTD	11,000	2,601.20	28,613,200.00	
		UPL LTD	43,200	746.85	32,263,920.00	
		ACC LIMITED	6,000	2,288.15	13,728,900.00	
		AMBUJA CEMENTS LTD	57,000	417.95	23,823,150.00	
		GRASIM INDUSTRIES LIMITED	23,300	1,710.75	39,860,475.00	
		SHREE CEMENT LIMITED	880	21,293.65	18,738,412.00	
		ULTRATECH CEMENT LTD	8,130	6,521.95	53,023,453.50	

HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	117,000	429.30	50,228,100.00	
JINDAL STEEL&POWER LTD	32,000	425.65	13,620,800.00	
JSW STEEL LTD	66,000	681.95	45,008,700.00	
TATA STEEL LIMITED	611,000	106.90	65,315,900.00	
VEDANTA LTD	59,000	260.40	15,363,600.00	
BHARAT ELECTRONICS LTD	84,800	327.90	27,805,920.00	
LARSEN&TOUBRO LIMITED	59,600	1,968.35	117,313,660.00	
HAVELLS INDIA LTD	17,700	1,379.80	24,422,460.00	
SIEMENS LIMITED	7,000	2,935.40	20,547,800.00	
ADANI ENTERPRISES LTD	23,600	3,346.55	78,978,580.00	
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	22,200	710.90	15,781,980.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,400	2,019.90	18,987,060.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	22,400	669.15	14,988,960.00	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	850.90	36,248,340.00	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,000	1,974.50	13,821,500.00	
BHARAT FORGE LIMITED	20,900	767.70	16,044,930.00	
MRF LTD	200	84,254.05	16,850,810.00	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNATIONAL LTD	106,000	125.35	13,287,100.00	
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,956.65	22,117,673.50	
EICHER MOTORS LTD	11,600	3,400.50	39,445,800.00	
HERO MOTOCORP LTD	9,300	2,842.05	26,431,065.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	73,700	1,320.55	97,324,535.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,620	8,950.05	86,099,481.00	
TATA MOTORS LTD	134,000	459.00	61,506,000.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	530	49,786.20	26,386,686.00	
TITAN CO LTD	29,600	2,627.35	77,769,560.00	
JUBILANT FOODWORKS LIMITED	36,000	598.90	21,560,400.00	
ZOMATO LTD	143,000	59.65	8,529,950.00	
TRENT LTD	15,000	1,398.25	20,973,750.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	13,690	4,577.45	62,665,290.50	
UNITED SPIRITS LTD	22,600	818.55	18,499,230.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,800	3,662.60	32,230,880.00	
MARICO LIMITED	46,000	520.85	23,959,100.00	
NESTLE INDIA LIMITED	2,890	19,259.70	55,660,533.00	

TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	45,300	837.45	37,936,485.00
ITC LTD	255,000	328.85	83,856,750.00
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	10,200	1,659.20	16,923,840.00
DABUR INDIA LTD	45,900	570.10	26,167,590.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33,400	893.50	29,842,900.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	67,100	2,600.60	174,500,260.00
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	8,770	4,282.55	37,557,963.50
BIOCON LTD	31,000	292.80	9,076,800.00
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	539.55	10,089,585.00
CIPLA LIMITED	39,500	1,025.65	40,513,175.00
DR.REDDYS LABORATORIES	9,140	4,214.25	38,518,245.00
LUPIN LTD	14,900	653.15	9,731,935.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	82,900	884.60	73,333,340.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	6,540	1,520.75	9,945,705.00
AU SMALL FINANCE BANK LTD	12,600	651.95	8,214,570.00
AXIS BANK LIMITED	185,100	756.10	139,954,110.00
BANDHAN BANK LTD	56,000	283.85	15,895,600.00
ICICI BANK LTD	428,800	882.45	378,394,560.00
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	46,300	1,937.90	89,724,770.00
YES BANK LTD	839,000	16.65	13,969,350.00
BAJAJ FINSERV LTD	3,160	17,376.10	54,908,476.00
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	143,600	2,456.25	352,717,500.00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	76,300	573.65	43,769,495.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	23,100	1,261.85	29,148,735.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	33,200	585.05	19,423,660.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	36,500	1,293.40	47,209,100.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	84,900	936.00	79,466,400.00
INFOSYS LTD	280,600	1,461.30	410,040,780.00
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	4,000	4,496.50	17,986,000.00
MINDTREE LIMITED	4,880	3,203.65	15,633,812.00
MPHASIS LTD	6,200	2,092.40	12,972,880.00
TATA CONSULTANCY SVS LTD	77,200	3,133.40	241,898,480.00
TECH MAHINDRA LTD	49,700	1,065.05	52,932,985.00
WIPRO LTD	106,000	405.50	42,983,000.00

	TATA ELXSI LTD	2,700	8,872.85	23,956,695.00	
	INDUS TOWERS LTD	61,000	199.60	12,175,600.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	188,900	740.40	139,861,560.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	23,600	3,881.25	91,597,500.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	261,966	223.40	58,523,204.40	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	106,000	236.45	25,063,700.00	
	ADANI TOTAL GAS LTD	23,400	3,530.60	82,616,040.00	
	GAIL INDIA LTD	127,000	136.75	17,367,250.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	34,200	415.30	14,203,260.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	22,810	7,196.20	164,145,322.00	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	28,600	799.75	22,872,850.00	
	MUTHOOT FINANCE LTD	10,000	1,030.60	10,306,000.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	24,000	936.35	22,472,400.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	15,700	1,320.80	20,736,560.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	24,900	2,353.80	58,609,620.00	
	ADANI POWER LIMITED	61,000	389.85	23,780,850.00	
	NTPC LIMITED	309,000	164.50	50,830,500.00	
	DIVIS LABORATORIES LTD	11,070	3,592.75	39,771,742.50	
	DLF LIMITED	58,000	394.10	22,857,800.00	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,300	1,428.60	13,285,980.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	6,670	4,255.45	28,383,851.50	
	小計銘柄数：107			6,077,849,838.40	
				(10,757,794,213)	
	組入時価比率：13.9%			15.2%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	19.17	665,199.00	
	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	220,000	3.83	844,360.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.49	759,450.00	
	INDUSTRIES QATAR	143,000	17.95	2,566,850.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	294,000	7.01	2,060,940.00	
	MASRAF AL RAYAN	455,000	4.36	1,987,895.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	11.63	546,610.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	132,000	24.50	3,234,000.00	
	QATAR NATIONAL BANK	394,000	19.60	7,722,400.00	
	QOOREDOO QSC	65,000	8.80	572,000.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	18.51	636,744.00	

	BARWA REAL ESTATE CO	195,000	3.55	692,640.00	
小計	銘柄数：12			22,289,088.00	
				(850,774,488)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
エジプト債券	EASTERN TOBACCO	51,525	10.25	528,131.25	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	121,733	38.30	4,662,373.90	
	EFG-HERMES HOLDING SAE	60,000	13.01	780,600.00	
小計	銘柄数：3			5,971,105.15	
				(43,597,427)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	19,600	221.00	4,331,600.00	
	SASOL LTD	46,200	338.12	15,621,144.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,000	245.71	1,719,970.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,110	1,194.23	4,908,285.30	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	35,000	239.93	8,397,550.00	
	GOLD FIELDS LTD	71,600	141.00	10,095,600.00	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	40,800	42.30	1,725,840.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	70,700	183.05	12,941,635.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,900	387.82	1,512,498.00	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	26,700	159.60	4,261,320.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	229,000	38.46	8,807,340.00	
	BIDVEST GROUP LTD	25,500	219.93	5,608,215.00	
	NASPERS LTD-N SHS	18,160	2,397.35	43,535,876.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	94,000	60.53	5,689,820.00	
	MR PRICE GROUP LTD	25,000	193.27	4,831,750.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	173,000	20.93	3,620,890.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,000	130.38	4,172,160.00	
	BID CORP LTD	27,300	330.81	9,031,113.00	
	CLICKS GROUP LTD	18,300	297.52	5,444,616.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	39,600	235.25	9,315,900.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	155.33	2,376,549.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	31,500	147.36	4,641,840.00	
	ABSA GROUP LTD	68,400	184.29	12,605,436.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	7,290	2,126.28	15,500,581.20	
	NEDBANK GROUP LTD	35,779	208.13	7,446,683.27	
	STANDARD BANK GROUP LTD	117,300	156.21	18,323,433.00	

	FIRSTRAND LTD	410,000	65.78	26,969,800.00	
	REMGRO LTD	47,300	130.64	6,179,272.00	
	DISCOVERY LTD	46,907	123.56	5,795,828.92	
	OLD MUTUAL LTD	434,000	10.69	4,639,460.00	
	SANLAM LIMITED	149,000	54.33	8,095,170.00	
	MTN GROUP LTD	141,400	128.41	18,157,174.00	
	VODACOM GROUP	51,700	128.50	6,643,450.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	14,200	284.95	4,046,290.00	
	NEPI ROCKCASTLE S.A.	41,900	88.22	3,696,418.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	118.00	3,145,880.00	
小計	銘柄数：36			313,836,387.69	
				(2,579,735,106)	
	組入時価比率：3.3%			3.7%	
U A E ディールハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	298,000	4.32	1,287,360.00	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	237,870	9.08	2,159,859.60	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	128,000	8.54	1,093,120.00	
	DUBAI ISLAMIC BANK	214,029	5.74	1,228,526.46	
	EMIRATES NBD PJSC	165,000	12.75	2,103,750.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	357,125	18.34	6,549,672.50	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	296,900	24.50	7,274,050.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	4.68	1,296,360.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	349,000	6.04	2,107,960.00	
小計	銘柄数：9			25,100,658.56	
				(960,100,189)	
	組入時価比率：1.2%			1.4%	
クウェートディ ナール	AGILITY	134,400	0.80	107,788.80	
	BOUBYAN BANK K.S.C	127,951	0.82	104,919.82	
	GULF BANK	128,000	0.34	43,520.00	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	421,300	0.89	375,378.30	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	585,000	1.02	597,285.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	189,000	0.59	112,077.00	
	MABANEE CO SAKC	40,449	0.82	33,168.18	
小計	銘柄数：7			1,374,137.10	
				(625,809,518)	

	組入時価比率：0.8%			0.9%	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	22,951	16.80	385,576.80	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	206,400	37.50	7,740,000.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	10,833	49.55	536,775.15	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	28,000	15.42	431,760.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	19,300	177.00	3,416,100.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	49.15	1,440,095.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	75,200	100.00	7,520,000.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	29,368	25.30	743,010.40	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	67,000	14.48	970,160.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	19,900	50.70	1,008,930.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	70,200	74.70	5,243,940.00	
	JARIR MARKETING CO	3,730	171.40	639,322.00	
	ALMARAI CO	18,000	52.20	939,600.00	
	SAVOLA	27,400	32.20	882,280.00	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	7,800	199.40	1,555,320.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,400	241.60	821,440.00	
	AL RAJHI BANK	162,000	87.80	14,223,600.00	
	ALINMA BANK	81,000	37.20	3,013,200.00	
	ARAB NATIONAL BANK	47,800	29.95	1,431,610.00	
	BANK AL - JAZIRA	34,100	22.70	774,070.00	
	BANK ALBILAD	42,666	49.70	2,120,500.20	
	BANQUE SAUDI FRANSI	49,200	49.75	2,447,700.00	
	RIYAD BANK	111,800	34.75	3,885,050.00	
	SAUDI BRITISH BANK	73,600	39.40	2,899,840.00	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	39,000	19.44	758,160.00	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	181,800	67.20	12,216,960.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	6,200	167.40	1,037,880.00	
	ELM CO	1,900	342.80	651,320.00	
	SAUDI TELECOM CO	129,500	40.45	5,238,275.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	34,300	38.30	1,313,690.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY	29,000	11.52	334,080.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	77,000	25.10	1,932,700.00	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	2,900	230.00	667,000.00	

		ACWA POWER CO	6,400	160.80	1,029,120.00	
		DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	53,000	14.22	753,660.00	
		EMAAR ECONOMIC CITY	35,000	10.18	356,300.00	
		SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	2,800	211.20	591,360.00	
	小計	銘柄数：37			91,950,384.55	
					(3,437,105,374)	
		組入時価比率：4.4%			4.9%	
	合計				70,277,637,937	
					(70,277,637,937)	

(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9月6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	4,570,000	22,557,520.00	
	小計	銘柄数：1	4,570,000	22,557,520.00	
				(3,164,143,330)	
		組入時価比率：4.1%		97.5%	
	合計			3,164,143,330	
				(3,164,143,330)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	234,000	4,836,780.00	
		OPERADORA DE SITES MEX- A-1	111,000	2,211,120.00	
		銘柄数：2	345,000	7,047,900.00	
				(49,594,662)	
		組入時価比率：0.1%		1.5%	
	ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	300,000	3,840,000.00	
		銘柄数：1	300,000	3,840,000.00	
				(31,564,800)	
		組入時価比率：0.0%		1.0%	
	合計			81,159,462	
				(81,159,462)	
	合計			3,245,302,792	
				(3,245,302,792)	

(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 9月 6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	3,854,850,344	-	3,755,792,371	99,057,973
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	224,435,904	-	224,413,920	21,984
米ドル	224,435,904	-	224,413,920	21,984
合計	-	-	-	99,079,957

（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。

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。

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2022年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,590,193,757
コール・ローン	528,425,603
国債証券	676,812,967,048
派生商品評価勘定	581,453
未収入金	8,719,772,838
未収利息	5,626,224,830
前払費用	381,447,423
その他未収収益	31,875,878
流動資産合計	694,691,488,830
資産合計	694,691,488,830
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	215,396
前受収益	58,633
未払金	10,787,313,171
未払解約金	113,684,465
未払利息	541
その他未払費用	12,718,313
流動負債合計	10,913,990,519
負債合計	10,913,990,519
純資産の部	
元本等	
元本	260,941,309,106
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	422,836,189,205
元本等合計	683,777,498,311
純資産合計	683,777,498,311
負債純資産合計	694,691,488,830

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 9月 6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	2.6204円
(10,000口当たり純資産額)	(26,204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	
	266,768,414,120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	280,961,696,328円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2021年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	239,458,881,234円
同期中における追加設定元本額	47,734,754,590円
同期中における一部解約元本額	26,252,326,718円
期末元本額	260,941,309,106円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	79,357,440円
バランスセレクト５０	81,091,387円
バランスセレクト７０	80,911,370円
野村外国債券インデックスファンド	272,847,777円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,555,646,524円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	23,125,731,830円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	2,015,105,931円
野村資産設計ファンド２０１５	21,706,872円
野村資産設計ファンド２０２０	23,363,960円
野村資産設計ファンド２０２５	38,332,577円
野村資産設計ファンド２０３０	49,261,247円
野村資産設計ファンド２０３５	37,368,925円
野村資産設計ファンド２０４０	61,624,114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）	73,830,347,209円
のむラップ・ファンド（保守型）	6,644,460,220円
のむラップ・ファンド（普通型）	24,439,251,497円
のむラップ・ファンド（積極型）	6,822,066,869円
野村外国債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	602,956,736円
野村資産設計ファンド２０４５	10,923,917円
野村インデックスファンド・外国債券	983,666,499円
マイ・ロード	8,576,607,728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	314,184,267円
野村外国債券インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	8,079,172,965円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,383,611,951円
野村資産設計ファンド２０５０	10,621,104円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６ - ２０２８年目標型	4,633,085円

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,751,298円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,792,774円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,428,318円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	915,573,249円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	1,092,616,497円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,610,208円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,605,595円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	11,029,031円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,164,957円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	11,496,983円
野村6資産均等バランス	2,637,204,015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）	6,362,140,872円
世界6資産分散ファンド	68,595,216円
野村資産設計ファンド2060	5,252,240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	11,462,662,928円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	7,708,563,808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）	6,247,298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）	1,018,651,715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）	174,293,650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）	1,029,254,889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）	441,210,191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）	1,833,428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）	7,999,081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）	231,751円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,665,230,118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）	5,705,222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）	29,600,030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）	7,754,362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）	163,327,567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）	144,831,932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）	1,873,470,976円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	69,159,825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）	793,142,384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）	773,585,237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）	5,763,919円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,528,522円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,770,219円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	5,810,958円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	606,526,491円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	5,437,471,654円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	6,861,402,189円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	5,365,542,045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）	21,854,417,971円
マイバランスDC30	2,162,414,746円
マイバランスDC50	1,599,530,612円
マイバランスDC70	1,182,907,976円

野村ＤＣ外国債券インデックスファンド	8,800,601,945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）	303,052,008円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	603,949,798円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	277,923,165円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	21,685,406円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	50,577,162円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	23,576,390円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０	16,905,237円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０	12,022,038円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０	6,377,891円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	201,742,852円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	122,008,053円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	68,629,010円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	90,243,648円
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０	3,056,252円
マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）	26,531,349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）	59,568,232円
みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）	222,876,206円
野村ＤＣバランスファンド（年金運用戦略タイプ）	98,525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9月6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9月6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	58,700,000.00	57,577,591.43	
		US TREASURY BOND	66,600,000.00	72,110,111.04	
		US TREASURY BOND	32,900,000.00	37,192,423.52	
		US TREASURY BOND	128,400,000.00	142,012,403.04	
		US TREASURY BOND	100,000.00	113,515.63	
		US TREASURY BOND	2,300,000.00	2,030,289.12	
		US TREASURY BOND	1,200,000.00	1,216,968.72	
		US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,685,618.80	

US TREASURY N/B	1,000,000.00	993,281.30	
US TREASURY N/B	500,000.00	483,867.20	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,371.10	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	34,443,749.12	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	994,394.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	290,021.49	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,894.54	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,390,070.18	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	994,257.80	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,839.84	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	42,285,492.72	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,107.42	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,060,921.76	
US TREASURY N/B	29,300,000.00	29,118,020.63	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,074.22	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,953.13	
US TREASURY N/B	45,900,000.00	45,224,049.06	
US TREASURY N/B	800,000.00	792,265.60	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,160.16	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,435,195.35	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,874,062.40	
US TREASURY N/B	15,800,000.00	15,600,032.04	
US TREASURY N/B	200,000.00	193,027.34	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,179,503.92	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,622,205.11	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,177,898.40	
US TREASURY N/B	400,000.00	394,085.92	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,263.67	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,326.17	
US TREASURY N/B	50,850,000.00	49,868,752.63	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,222.66	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,271.48	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,640,304.62	
US TREASURY N/B	700,000.00	687,134.77	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,759,148.56	

US TREASURY N/B	82,000,000.00	80,813,238.60	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,184,095.79	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,354,460.54	
US TREASURY N/B	300,000.00	295,447.26	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,621.09	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	23,612,961.24	
US TREASURY N/B	500,000.00	485,654.30	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,832.02	
US TREASURY N/B	300,000.00	283,863.27	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,200,898.33	
US TREASURY N/B	500,000.00	485,048.85	
US TREASURY N/B	200,000.00	188,730.46	
US TREASURY N/B	300,000.00	291,357.42	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,055,248.04	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,781,671.96	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,134.77	
US TREASURY N/B	53,200,000.00	51,880,389.96	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,058,835.91	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,417.97	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,344,031.28	
US TREASURY N/B	500,000.00	480,644.55	
US TREASURY N/B	57,850,000.00	56,478,324.43	
US TREASURY N/B	200,000.00	188,859.38	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,237,199.19	
US TREASURY N/B	500,000.00	479,824.20	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,554.68	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,851,609.47	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,363.28	
US TREASURY N/B	200,000.00	189,695.32	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	978,984.40	
US TREASURY N/B	300,000.00	286,007.82	
US TREASURY N/B	25,100,000.00	24,276,406.25	
US TREASURY N/B	200,000.00	191,031.26	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,870,089.82	
US TREASURY N/B	17,300,000.00	16,365,395.18	

US TREASURY N/B	100,000.00	96,003.91	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	32,071,548.51	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,886.72	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,003.91	
US TREASURY N/B	48,800,000.00	48,111,841.92	
US TREASURY N/B	100,000.00	92,320.31	
US TREASURY N/B	8,050,000.00	7,782,086.34	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,238.28	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	985,429.70	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,484.38	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,515.63	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,946,093.90	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,101.56	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,449.23	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,121,390.56	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,515.62	
US TREASURY N/B	35,150,000.00	33,749,493.94	
US TREASURY N/B	700,000.00	686,519.54	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,007.82	
US TREASURY N/B	43,750,000.00	43,204,835.62	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,632.82	
US TREASURY N/B	100,000.00	98,746.09	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,093.76	
US TREASURY N/B	51,300,000.00	49,454,400.42	
US TREASURY N/B	13,200,000.00	12,977,766.12	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,335.94	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,753,125.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	180,929.68	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,179,812.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,210.94	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,882,734.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	969,843.80	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,417.97	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,808,203.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	182,140.62	

US TREASURY N/B	42,300,000.00	40,854,198.69	
US TREASURY N/B	300,000.00	272,707.02	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,689,679.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	286,675.77	
US TREASURY N/B	300,000.00	272,144.52	
US TREASURY N/B	800,000.00	757,500.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	273,023.43	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	6,807,937.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,933.59	
US TREASURY N/B	42,350,000.00	39,402,041.91	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,109,843.60	
US TREASURY N/B	100,000.00	90,203.13	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	13,551,269.35	
US TREASURY N/B	300,000.00	271,593.75	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,223,093.68	
US TREASURY N/B	300,000.00	273,972.66	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	13,529,141.34	
US TREASURY N/B	81,000,000.00	75,532,500.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	458,496.10	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,660.16	
US TREASURY N/B	200,000.00	183,117.18	
US TREASURY N/B	200,000.00	184,898.44	
US TREASURY N/B	36,950,000.00	35,254,054.12	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,272,359.34	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,953.13	
US TREASURY N/B	300,000.00	265,781.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,460.94	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	14,939,414.70	
US TREASURY N/B	37,350,000.00	36,410,415.93	
US TREASURY N/B	67,500,000.00	64,636,521.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	613,839.87	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,996.09	
US TREASURY N/B	300,000.00	262,523.43	
US TREASURY N/B	300,000.00	298,968.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,859.38	

US TREASURY N/B	33,500,000.00	31,866,875.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,156.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,351.56	
US TREASURY N/B	300,000.00	260,144.52	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	948,710.90	
US TREASURY N/B	300,000.00	261,257.82	
US TREASURY N/B	500,000.00	434,414.05	
US TREASURY N/B	500,000.00	436,562.50	
US TREASURY N/B	27,700,000.00	26,881,985.76	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,058.59	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,341,503.85	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,292.97	
US TREASURY N/B	53,600,000.00	52,295,595.76	
US TREASURY N/B	500,000.00	445,917.95	
US TREASURY N/B	16,400,000.00	14,596,641.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	87,570.31	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	11,889,757.66	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,082.03	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,593.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	267,492.18	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,186,125.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,718.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,042.97	
US TREASURY N/B	200,000.00	181,992.18	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,055,656.25	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,173,438.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	94,375.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,304.69	
US TREASURY N/B	29,700,000.00	28,031,694.57	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,027,976.51	
US TREASURY N/B	300,000.00	298,945.32	
US TREASURY N/B	100,000.00	95,914.06	
US TREASURY N/B	300,000.00	269,976.57	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,906,570.26	
US TREASURY N/B	600,000.00	501,046.86	

US TREASURY N/B	11,700,000.00	10,378,266.21	
US TREASURY N/B	48,100,000.00	57,889,100.36	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	13,685,921.46	
US TREASURY N/B	100,000.00	82,007.81	
US TREASURY N/B	155,050,000.00	179,506,718.72	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	849,453.10	
US TREASURY N/B	100,000.00	88,226.56	
US TREASURY N/B	32,900,000.00	27,959,861.02	
US TREASURY N/B	32,850,000.00	28,099,581.21	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,356,875.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	97,296.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,257.81	
US TREASURY N/B	20,350,000.00	23,362,754.41	
US TREASURY N/B	8,650,000.00	10,439,468.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	114,968.75	
US TREASURY N/B	800,000.00	814,937.52	
US TREASURY N/B	100,000.00	111,562.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	114,812.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	113,000.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	116,328.13	
US TREASURY N/B	100,000.00	112,554.69	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,282,945.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	105,085.94	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	1,404,703.23	
US TREASURY N/B	100,000.00	110,265.63	
US TREASURY N/B	100,000.00	69,742.19	
US TREASURY N/B	300,000.00	352,687.50	
US TREASURY N/B	200,000.00	151,906.26	
US TREASURY N/B	100,000.00	111,820.31	
US TREASURY N/B	200,000.00	161,578.12	
US TREASURY N/B	12,100,000.00	12,384,538.76	
US TREASURY N/B	200,000.00	147,093.76	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,289.06	
US TREASURY N/B	200,000.00	153,765.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	93,140.63	

US TREASURY N/B	200,000.00	164,156.26	
US TREASURY N/B	100,000.00	91,062.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	473,515.65	
US TREASURY N/B	200,000.00	174,062.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	96,625.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	86,859.38	
US TREASURY N/B	290,000.00	267,003.89	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,546.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	99,335.94	
US TREASURY N/B	8,900,000.00	8,500,891.07	
US TREASURY N/B	39,950,000.00	36,572,978.56	
US TREASURY N/B	43,200,000.00	38,677,500.00	
US TREASURY N/B	43,700,000.00	35,758,892.81	
US TREASURY N/B	24,400,000.00	21,818,938.72	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	15,308,398.00	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	2,863,750.08	
US TREASURY N/B	49,700,000.00	40,505,500.00	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	22,978,595.16	
US TREASURY N/B	36,500,000.00	28,258,986.20	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	12,441,640.98	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,793,437.60	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,526,679.73	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	9,787,969.32	
US TREASURY N/B	9,300,000.00	7,997,273.67	
US TREASURY N/B	9,500,000.00	8,593,789.30	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	4,740,609.63	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	9,551,718.75	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,967,992.34	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,268,540.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	89,812.50	
US TREASURY N/B	11,250,000.00	8,893,652.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	243,937.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	746,250.00	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	13,338,468.75	
US TREASURY N/B	16,100,000.00	10,143,000.00	

小計	US TREASURY N/B	10,900,000.00	7,349,836.21	
	US TREASURY N/B	20,300,000.00	14,600,141.64	
	US TREASURY N/B	65,150,000.00	52,898,744.46	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	740,781.30	
	US TREASURY N/B	100,000.00	71,781.25	
	US TREASURY N/B	100,000.00	78,796.88	
	US TREASURY N/B	100,000.00	90,898.44	
	銘柄数：260	2,615,210,000.00	2,519,749,626.65	
	組入時価比率：51.7%		(353,445,280,130)	52.2%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	3,070,000.00	3,019,406.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	490,370.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,876,730.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	34,400,000.00	32,556,504.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	95,069.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	3,584,560.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	98,603.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	350,000.00	314,601.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	281,364.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	15,300,000.00	14,013,117.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	91,880.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	181,270.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	293,961.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	753,232.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	15,880,000.00	18,447,796.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	950,120.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	284,205.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	436,800.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,950,000.00	5,224,516.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	87,253.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	90,913.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	16,900,000.00	20,905,300.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,240,000.00	2,728,096.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	562,265.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	10,038,824.00	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,230,749.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	9,674,555.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	222,618.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	837,864.00	
	銘柄数：29	133,690,000.00	134,372,541.90	
	組入時価比率：2.1%		(14,389,955,512)	2.1%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	78,500,000.00	76,099,540.65	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	65,000,000.00	65,512,044.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	13,512,166.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	119,000,000.00	106,524,718.30	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,000,000.00	868,924.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	110,800,000.00	104,358,553.36	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	77,300,000.00	75,494,720.34	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	85,600,000.00	79,290,355.52	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	400,000.00	363,968.72	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	58,016,255.83	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	38,800,000.00	37,204,606.08	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,200,000.00	60,422,321.96	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	54,000,000.00	49,152,997.80	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	64,800,000.00	63,252,323.28	
	銘柄数：14	831,700,000.00	790,073,496.54	
	組入時価比率：0.8%		(5,559,589,180)	0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	900,000.00	892,845.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,104,400.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	985,104.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,675,871.90	
	BELGIUM KINGDOM	7,800,000.00	8,628,828.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,243,662.40	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	1,926,294.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	951,047.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,500,000.00	6,124,917.50	
	BELGIUM KINGDOM	11,400,000.00	10,490,462.40	
	BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,140,316.00	
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	91,160.00	

BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,466,872.37	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	91,123.20	
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,274,123.00	
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,693,260.00	
BELGIUM KINGDOM	5,750,000.00	4,608,717.00	
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,164,541.94	
BELGIUM KINGDOM	3,600,000.00	3,219,969.60	
BELGIUM KINGDOM	2,200,000.00	1,899,165.40	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	13,850,416.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,500,000.00	13,360,231.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,750,000.00	14,452,831.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,600,000.00	14,154,608.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,700,000.00	6,894,132.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,100,000.00	2,102,730.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,650,000.00	21,379,317.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,600,000.00	6,712,219.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,018,072.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	34,650,000.00	40,077,749.25	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	784,363.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	98,055.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	94,435.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,300,000.00	10,979,645.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,800,000.00	2,699,342.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	4,809,750.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,550,000.00	18,181,837.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	95,380.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	90,725.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	2,906,193.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	5,167,800.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	887,941.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	2,379,569.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	5,167,944.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,000,000.00	14,541,753.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	3,063,033.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,500,000.00	9,597,197.40	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,600,000.00	5,549,269.60	
BUNDESOBLIGATION	2,600,000.00	2,544,490.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	608,826.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,600,000.00	2,627,482.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	5,305,512.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,663,793.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	11,668,410.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	20,400,000.00	19,960,992.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	954,690.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	670,775.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,300,000.00	26,387,931.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	192,576.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,300,000.00	23,474,397.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	573,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,700,000.00	12,695,871.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	93,681.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	93,182.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	18,700,000.00	25,000,591.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	26,250,000.00	34,584,900.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	17,800,000.00	23,916,898.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	16,700,000.00	21,578,871.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	89,905.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,700,000.00	5,064,734.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,800,000.00	4,096,327.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,130,000.00	1,427,968.57	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,958,112.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,700,000.00	13,570,596.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	24,200,000.00	22,001,914.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,700,000.00	6,159,021.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	25,000,000.00	25,910,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	298,896.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,185,216.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	7,523,234.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	6,298,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,006,000.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,002,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	33,200,000.00	35,324,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	776,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	5,361,631.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	392,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	95,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,750,000.00	11,704,175.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,942,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	92,935.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,600,000.00	19,753,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	96,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,952,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	26,600,000.00	31,366,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	93,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	91,910.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	193,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	191,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	35,000,000.00	40,939,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	189,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,000,000.00	16,215,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	97,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	782,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	37,600,000.00	42,206,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	100,570.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	861,045.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,000,000.00	23,546,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	751,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	77,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	88,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,800,000.00	11,373,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,214,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	22,300,000.00	24,527,770.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,000,000.00	14,052,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	82,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	7,351,830.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	452,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	436,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	5,058,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	176,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	13,548,370.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,800,000.00	9,684,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,500,000.00	4,880,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,542,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,800,000.00	7,480,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	5,823,090.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,100,000.00	3,104,950.50	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	711,634.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	1,721,120.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	98,655.55	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,934,856.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	3,491,195.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,188,906.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,176,299.80	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	177,360.80	
FINNISH GOVERNMENT	4,000,000.00	2,990,952.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	411,031.60	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	825,725.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	98,460.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,200,000.00	3,262,400.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,739,196.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,000,000.00	12,700,376.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,736,782.20	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	12,601,723.40	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	7,779,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,900,000.00	6,542,994.00	
FRANCE (GOVT OF)	15,100,000.00	14,230,209.80	
FRANCE (GOVT OF)	3,300,000.00	3,037,521.30	
FRANCE (GOVT OF)	11,400,000.00	11,978,276.40	
FRANCE (GOVT OF)	15,000,000.00	13,320,855.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	86,120.00	

FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	90,528.30	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	9,431,784.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	1,592,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	310,000.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,018,446.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	100,000.00	103,886.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,700,000.00	5,761,155.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,650,000.00	12,245,370.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	5,920,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	285,538.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	36,400,000.00	38,968,020.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,200,000.00	9,703,240.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	35,200,000.00	43,376,256.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,100,000.00	12,684,337.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,650,000.00	32,724,181.45	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	36,200,000.00	45,523,889.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	359,657.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,350,000.00	6,891,757.65	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,450,000.00	27,219,353.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,650,000.00	9,891,258.75	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,540,000.00	17,889,359.42	
IRISH GOVERNMENT	6,130,000.00	6,747,100.97	
IRISH GOVERNMENT	6,900,000.00	6,583,579.80	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	572,623.20	
IRISH TSY 1.3% 2033	5,100,000.00	4,652,207.25	
IRISH TSY 1.35% 2031	3,300,000.00	3,155,893.29	
IRISH TSY 1.5% 2050	2,900,000.00	2,254,634.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	3,100,000.00	2,821,167.40	
IRISH TSY 1% 2026	10,800,000.00	10,623,377.88	
IRISH TSY 2.4% 2030	7,500,000.00	7,799,970.00	
IRISH TSY 2% 2045	1,600,000.00	1,441,088.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	12,800,000.00	13,252,633.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	98,650.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,800,000.00	1,832,589.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,457,820.00	

小計	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,900,000.00	1,835,210.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,381,500.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	12,300,000.00	14,730,480.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	953,050.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	727,351.52	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	11,750,000.00	12,395,100.85	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	6,050,000.00	7,487,927.70	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	387,609.75	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	5,444,445.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	10,200,000.00	11,594,391.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	665,288.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	151,393.95	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,272,661.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	706,328.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,900,000.00	1,893,287.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,900,000.00	8,823,510.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,941,068.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	9,270,282.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	11,600,000.00	10,620,380.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	9,550,000.00	9,632,569.30	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	485,937.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,400,000.00	4,961,506.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,000,000.00	5,806,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,310,028.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,245,370.20	
	SPANISH GOVERNMENT	32,300,000.00	39,715,146.53	
	SPANISH GOVERNMENT	28,950,000.00	36,885,195.00	
	SPANISH GOVERNMENT	7,750,000.00	8,881,965.00	
	銘柄数：215	1,468,050,000.00	1,607,365,875.11	
			(224,581,160,070)	
	組入時価比率：32.8%		33.2%	
英債券	UK TREASURY	350,000.00	346,757.88	
	UK TREASURY	300,000.00	287,115.00	
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,255,435.48	
	UK TREASURY	4,350,000.00	4,315,121.70	

	UK TREASURY	16,720,000.00	17,480,298.52	
	UK TREASURY	200,000.00	187,770.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,166,944.80	
	UK TREASURY	8,110,000.00	7,688,820.12	
	UK TREASURY	500,000.00	449,879.00	
	UK TREASURY	400,000.00	370,199.20	
	UK TREASURY	12,250,000.00	13,016,041.50	
	UK TREASURY	200,000.00	186,580.00	
	UK TREASURY	6,650,000.00	7,828,316.16	
	UK TREASURY	200,000.00	172,310.32	
	UK TREASURY	200,000.00	174,884.00	
	UK TREASURY	6,650,000.00	7,586,210.94	
	UK TREASURY	9,610,000.00	10,683,167.92	
	UK TREASURY	17,350,000.00	19,709,037.86	
	UK TREASURY	750,000.00	542,212.50	
	UK TREASURY	8,980,000.00	9,994,829.80	
	UK TREASURY	100,000.00	118,976.00	
	UK TREASURY	350,000.00	393,925.00	
	UK TREASURY	500,000.00	566,053.00	
	UK TREASURY	320,000.00	376,833.92	
	UK TREASURY	18,440,000.00	18,961,829.87	
	UK TREASURY	5,900,000.00	6,823,455.02	
	UK TREASURY	8,200,000.00	5,750,594.40	
	UK TREASURY	16,100,000.00	11,898,222.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	6,315,436.39	
	UK TREASURY	1,100,000.00	698,542.24	
	UK TREASURY	6,750,000.00	7,476,705.00	
	UK TREASURY	1,400,000.00	971,530.00	
	UK TREASURY	700,000.00	501,130.00	
	UK TREASURY	9,300,000.00	11,231,935.50	
	UK TREASURY	100,000.00	88,564.20	
	UK TREASURY	200,000.00	225,907.84	
	UK TSY 3 1/4% 2044	6,100,000.00	6,036,581.96	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	7,170,000.00	8,808,524.25	
小計	銘柄数：38	184,350,000.00	190,686,679.29	

			(30,994,212,851)	
	組入時価比率：4.5%		4.6%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	9,200,000.00	9,127,960.32	
	SWEDISH GOVERNMENT	36,350,000.00	36,455,415.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,000,000.00	15,241,865.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,300,000.00	16,079,180.52	
	SWEDISH GOVERNMENT	18,900,000.00	17,299,859.85	
	SWEDISH GOVERNMENT	13,100,000.00	11,208,493.62	
	SWEDISH GOVERNMENT	21,300,000.00	26,301,666.00	
小計	銘柄数：7	132,150,000.00	131,714,440.91	
			(1,716,239,165)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	22,800,000.00	22,704,116.88	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	12,023,062.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	6,669,456.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	10,200,000.00	9,539,040.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,400,000.00	8,771,140.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	28,000,000.00	25,291,324.80	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	6,415,874.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,302,800.00	
小計	銘柄数：8	104,400,000.00	97,716,814.18	
			(1,382,692,920)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	870,000.00	876,090.00	
	KINGDOM OF DENMARK	25,200,000.00	25,419,240.00	
	KINGDOM OF DENMARK	18,400,000.00	17,336,833.28	
	KINGDOM OF DENMARK	37,250,000.00	34,024,150.00	
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	51,665,924.10	
	KINGDOM OF DENMARK	3,500,000.00	2,129,505.00	
	銘柄数：6	123,320,000.00	131,451,742.38	
小計			(2,469,978,239)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	38,800,000.00	35,524,116.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,300,000.00	6,318,150.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	50,054,400.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,105,740.00	

小計	POLAND GOVERNMENT BOND	7,400,000.00	5,146,330.00	
	銘柄数：5	116,100,000.00	99,148,736.00	
			(2,939,888,915)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,487,375.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	7,701,580.81	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,680,000.00	18,236,050.14	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,565,941.98	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,162,725.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	288,180.99	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,675,747.46	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	9,300,000.00	8,821,980.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	22,200,000.00	20,620,700.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	4,643,939.34	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	2,776,609.44	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	238,080.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	483,336.48	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,100,000.00	2,599,395.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	12,769,020.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	280,962.45	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,450,000.00	2,192,190.17	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,250,000.00	8,143,046.17	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	637,980.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,258,899.75	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	4,807,380.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	1,864,500.00	
小計	銘柄数：22	115,580,000.00	110,255,623.00	
			(10,561,386,127)	
	組入時価比率：1.5%		1.6%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,450,000.00	1,434,370.01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,308,717.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,087,570.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,500,000.00	1,461,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	467,950.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,850,000.00	5,982,795.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	491,000.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	297,750.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	5,150,000.00	5,098,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	3,064,930.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,220,000.00	2,931,584.60	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,950,000.00	1,864,268.25	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,793,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	1,641,150.00	
	銘柄数：14	30,800,000.00	29,925,184.86	
	組入時価比率：0.4%		(2,997,306,515)	0.4%
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	405,881.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,696,575.96	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,700,000.00	2,595,498.39	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	420,964.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,509,015.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,886,747.12	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,436,754.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	16,600,000.00	17,085,222.98	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,634,057.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,200,000.00	9,105,515.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,186,696.82	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	278,049.74	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	15,400,000.00	15,844,169.88	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,446,934.64	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	9,505,174.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	11,067,400.41	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,319,903.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	10,500,000.00	10,831,476.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	317,102.88	
	銘柄数：19	111,880,000.00	113,573,142.83	
	組入時価比率：0.5%		(3,550,103,370)	0.5%
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	141,900,000.00	143,118,921.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	144,100,000.00	144,579,853.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	49,900,000.00	50,037,474.50	
	CHINA GOVERNMENT BOND	89,500,000.00	90,720,645.75	

	小計	CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	32,986,087.20	
		CHINA GOVERNMENT BOND	84,800,000.00	85,128,176.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,112,200.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	70,000,000.00	71,356,523.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	60,000,000.00	60,734,970.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	44,000,000.00	44,414,717.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND	33,000,000.00	33,863,610.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,316,984.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,113,900.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	31,500,000.00	31,854,375.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	20,000,000.00	20,134,300.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,696,351.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND	36,000,000.00	38,928,240.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND	44,000,000.00	46,015,772.00	
		銘柄数：18	956,700,000.00	971,113,100.55	
				(19,646,103,580)	
		組入時価比率：2.9%		2.9%	
	新シェケル	ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,939,966.00	
		ISRAEL FIXED BOND	6,200,000.00	6,305,799.28	
		ISRAEL FIXED BOND	12,200,000.00	11,835,370.06	
		ISRAEL FIXED BOND	6,500,000.00	7,343,165.70	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,806,438.50	
		ISRAEL FIXED BOND	5,000,000.00	4,812,397.50	
		ISRAEL FIXED BOND	4,500,000.00	3,911,597.10	
		ISRAEL FIXED BOND	5,900,000.00	4,736,948.34	
		ISRAEL FIXED BOND	6,000,000.00	7,881,904.20	
		ISRAEL FIXED BOND	5,700,000.00	5,977,387.08	
		銘柄数：10	62,000,000.00	62,550,973.76	
				(2,579,070,474)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	小計				
合計				676,812,967,048	
				(676,812,967,048)	

(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 9月 6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 N/B	85,000	
		US TREASURY BOND	43,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	13,000,000	
		US TREASURY N/B	18,300,000	
		US TREASURY N/B	15,000,000	
		US TREASURY N/B	26,000,000	
		US TREASURY N/B	27,000,000	
		US TREASURY N/B	35,500,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	5,000,000	
		US TREASURY BOND	11,000,000	
		US TREASURY 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	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	26,000,000	
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	1,000,000	
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	3,000,000	
US TREASURY N/B	37,000,000	
US TREASURY N/B	1,445,000	
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	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	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	7,500,000	
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,295,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,240,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000	
	BUNDES OBLIGATION	1,700,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	595,000	
	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 (GOVT OF)	12,700,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000	
	BELGIUM KINGDOM	9,690,000	
	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	1,200,000	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,600,000	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	2,100,000	
	FINNISH GOVERNMENT	1,700,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	21,250,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,800,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	15,800,000	
	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,000,000	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2022年 9月 6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	349,727,933	-	350,093,990	366,057
米ドル	209,924,005	-	210,376,650	452,645
ユーロ	139,803,928	-	139,717,340	86,588
合計	349,727,933	-	350,093,990	366,057

（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。

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。

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 9月 6日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	49,137,316
コール・ローン	11,620,461
国債証券	7,062,508,326
派生商品評価勘定	208,087
未収入金	103,226,634
未収利息	94,478,206
前払費用	10,473,274
流動資産合計	7,331,652,304
資産合計	7,331,652,304
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	480,073
未払金	106,645,123
未払解約金	1,157,523
未払利息	11
その他未払費用	712,000
流動負債合計	108,994,730
負債合計	108,994,730
純資産の部	
元本等	
元本	4,948,433,877
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,274,223,697
元本等合計	7,222,657,574
純資産合計	7,222,657,574
負債純資産合計	7,331,652,304

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 9月 6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	1.4596円
(10,000口当たり純資産額)	(14,596円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2021年 9月 7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	6,988,030,163円
同期中における追加設定元本額	1,067,206,675円
同期中における一部解約元本額	3,106,802,961円
期末元本額	4,948,433,877円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド2015	11,710,576円
野村資産設計ファンド2020	12,596,401円
野村資産設計ファンド2025	20,763,744円
野村資産設計ファンド2030	27,059,492円
野村資産設計ファンド2035	20,530,827円
野村資産設計ファンド2040	33,852,128円
野村資産設計ファンド2045	5,999,952円
野村インデックスファンド・新興国債券	722,826,079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	567,449,476円
野村資産設計ファンド2050	5,956,270円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	2,551,170円

野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	1,525,612円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	985,460円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	785,123円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		978,427円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		3,187,038円
世界6資産分散ファンド		123,816,241円
野村資産設計ファンド2060		2,831,203円
ノムラF O F s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）		2,731,889,115円
野村F O F s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）		867,044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D C新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド		432,793,966円
野村D C運用戦略ファンド		111,086,393円
野村D C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（D C・つみたてN I S A）2030		9,284,976円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2040		6,603,303円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2050		3,575,849円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2060		1,647,522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9月6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9月6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	5,800,000.00	5,622,641.22	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,100,000.00	14,211,074.16	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,500,000.00	12,979,902.65	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,344,621.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	3,450,000.00	3,249,431.49	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,800,000.00	10,547,774.64	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,300,000.00	12,319,646.36	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,200,000.00	3,821,671.56	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	2,938,909.77	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,600,000.00	4,410,855.36	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,700,000.00	7,707,832.86	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,600,000.00	9,648,551.42	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,500,000.00	9,273,102.95	
	銘柄数：13	107,250,000.00	101,076,015.44	
	組入時価比率：9.8%		(711,251,705)	10.1%
リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	5,200,000.00	4,683,713.32	
	LETRA TESOURO NACIONAL	6,300,000.00	5,377,489.11	
	LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000.00	2,835,621.95	
	LETRA TESOURO NACIONAL	4,100,000.00	3,002,918.31	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	481,000.00	4,714,559.49	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	230,000.00	2,214,292.57	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000.00	2,357,944.25	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	160,000.00	1,481,186.40	
	銘柄数：8	20,221,000.00	26,667,725.40	
	組入時価比率：10.0%		(725,703,477)	10.3%
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	180,000,000.00	158,547,186.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	190,000,000.00	172,332,679.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	295,000,000.00	262,940,314.50	
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	210,586,776.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	115,000,000.00	110,567,601.00	
	銘柄数：5	1,020,000,000.00	914,974,556.50	
	組入時価比率：2.0%		(145,563,302)	2.1%
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,790,000,000.00	1,629,884,500.00	
	TITULOS DE TESORERIA	950,000,000.00	928,927,860.00	
	TITULOS DE TESORERIA	490,000,000.00	420,641,088.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	688,375,350.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,460,000,000.00	1,108,173,434.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,330,000,000.00	1,039,262,266.00	
	TITULOS DE TESORERIA	800,000,000.00	587,278,320.00	
	TITULOS DE TESORERIA	780,000,000.00	553,444,710.00	
	TITULOS DE TESORERIA	1,850,000,000.00	1,281,979,885.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	544,543,110.00	
	TITULOS DE TESORERIA	560,000,000.00	337,464,568.00	

小計	銘柄数：11	11,810,000,000.00	9,119,975,091.00 (285,829,139)	4.0%
	組入時価比率：4.0%			
ソル	BONOS DE TESORERIA	200,000.00	197,377.32	
	BONOS DE TESORERIA	480,000.00	434,722.03	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	521,122.56	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	551,675.46	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	509,302.29	
	PERU BONO SOBERANO	700,000.00	731,181.57	
	PERU BONO SOBERANO	500,000.00	468,005.20	
	PERU BONO SOBERANO	320,000.00	281,899.52	
	REPUBLIC OF PERU	1,100,000.00	1,030,288.93	
小計	銘柄数：9	5,300,000.00	4,725,574.88 (170,649,960)	2.4%
	組入時価比率：2.4%			
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,579,200.00	
小計	銘柄数：1	4,000,000.00	3,579,200.00 (12,324,975)	0.2%
	組入時価比率：0.2%			
セルビアディナール	SERBIA TREASURY BONDS	22,000,000.00	17,435,000.00	
小計	銘柄数：1	22,000,000.00	17,435,000.00 (20,771,814)	0.3%
	組入時価比率：0.3%			
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	600,000.00	608,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	502,840.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,110,000.00	1,065,877.50	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	946,305.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,849,500.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	400,000.00	396,800.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	500,000.00	497,250.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	655,900.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	984,500.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,530,000.00	
小計	銘柄数：10	9,150,000.00	9,037,372.50 (69,617,591)	

	組入時価比率：1.0%		1.0%	
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	14,000,000.00	13,067,460.00	
	CZECH REPUBLIC	4,000,000.00	4,082,000.00	
	CZECH REPUBLIC	6,400,000.00	5,483,360.00	
	CZECH REPUBLIC	11,500,000.00	9,311,550.00	
	CZECH REPUBLIC	2,300,000.00	2,019,795.60	
	CZECH REPUBLIC	13,200,000.00	9,983,516.40	
	CZECH REPUBLIC	5,800,000.00	4,378,594.00	
	CZECH REPUBLIC	11,300,000.00	8,710,605.00	
	CZECH REPUBLIC	5,200,000.00	4,951,752.00	
小計	銘柄数：9	73,700,000.00	61,988,633.00	
			(352,374,384)	
	組入時価比率：4.9%		5.0%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	51,000,000.00	46,861,350.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	27,000,000.00	25,293,600.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	68,000,000.00	58,666,320.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	53,871,300.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	66,000,000.00	47,906,100.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	107,000,000.00	77,050,700.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	48,980,670.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	102,000,000.00	67,789,200.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	130,000,000.00	84,987,500.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	88,000,000.00	44,950,400.00	
小計	銘柄数：10	759,000,000.00	556,357,140.00	
			(192,619,743)	
	組入時価比率：2.7%		2.7%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,403,400.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,100,000.00	2,838,267.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	1,904,100.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,700,000.00	2,094,390.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,500,000.00	3,644,550.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000.00	2,343,620.00	
小計	銘柄数：6	19,400,000.00	16,228,327.00	
			(481,190,992)	
	組入時価比率：6.7%		6.8%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	12,000,000.00	0.00	

小計	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	
	銘柄数：18	427,400,000.00	0.00	
			(0)	
	組入時価比率：0.0%		0.0%	
レイ	ROMANIA	550,000.00	545,160.00	
	ROMANIA	400,000.00	388,860.00	
	ROMANIA	500,000.00	482,978.55	
	ROMANIA	1,000,000.00	936,175.00	
	ROMANIA	800,000.00	738,715.92	
	ROMANIA	920,000.00	855,646.00	
	ROMANIA	500,000.00	446,100.00	
	ROMANIA	500,000.00	454,180.00	
	ROMANIA	700,000.00	598,697.54	
	ROMANIA	760,000.00	697,474.80	
	ROMANIA	1,150,000.00	985,670.75	
	ROMANIA	1,900,000.00	1,390,600.50	
小計	銘柄数：12	9,680,000.00	8,520,259.06	
			(246,839,573)	
	組入時価比率：3.4%		3.5%	
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	811,763.60	

小計	MALAYSIA GOVERNMENT	1,800,000.00	1,811,194.38	
	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	769,036.56	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,800,000.00	1,894,339.98	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,005,573.80	
	MALAYSIA GOVERNMENT	700,000.00	705,421.78	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,200,000.00	1,204,327.32	
	MALAYSIA GOVERNMENT	600,000.00	608,973.84	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,200,000.00	2,233,691.90	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,300,000.00	1,315,423.98	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,400,000.00	2,422,275.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,500,000.00	2,484,882.75	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,200,000.00	1,073,140.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,000,000.00	1,929,219.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,200,000.00	1,106,534.88	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,570,000.00	1,444,719.80	
	銘柄数：16	23,070,000.00	22,820,519.97	
			(713,330,659)	
	組入時価比率：9.9%		10.1%	
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,700,000.00	11,931,402.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,371,694.26	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	14,789,368.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,188,929.16	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	12,224,676.25	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,300,000.00	12,014,857.21	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,300,000.00	13,367,699.66	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,400,000.00	9,731,313.34	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	11,770,408.32	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,800,000.00	13,008,716.28	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,800,000.00	13,884,779.52	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,100,000.00	11,549,783.96	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,360,416.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,600,000.00	3,021,664.32	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,100,000.00	8,387,775.28	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,100,000.00	9,259,347.37	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,900,000.00	5,796,062.65	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,700,000.00	14,148,855.70	

小計	銘柄数：18	184,900,000.00	183,807,750.78 (707,659,840)	
	組入時価比率：9.8%		10.0%	
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	3,500,000,000.00	3,521,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,030,000,000.00	4,190,434,300.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,800,000,000.00	3,954,698,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,300,000,000.00	4,339,947,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,580,000,000.00	1,788,275,600.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,000,000,000.00	3,760,900,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,450,000,000.00	4,506,915,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	4,857,150,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,230,000,000.00	3,570,571,200.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,333,920,300.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,600,000,000.00	4,580,864,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,500,000,000.00	4,338,045,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,764,032,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,600,000,000.00	1,732,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,800,000,000.00	1,848,546,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,735,997,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,180,000,000.00	1,284,524,400.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,151,150,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,000,000,000.00	5,397,600,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,600,000,000.00	2,664,168,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000.00	2,369,184,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,800,000,000.00	1,799,811,000.00	
小計	銘柄数：22	72,680,000,000.00	74,489,733,300.00 (700,203,493)	
	組入時価比率：9.7%		9.9%	
人民元	CHINA GOVERNMENT BOND	9,100,000.00	9,178,169.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,800,000.00	7,906,380.30	
	CHINA GOVERNMENT BOND	400,000.00	402,244.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,339,528.08	
	CHINA GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,214,699.40	
	CHINA GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	6,157,020.00	
	CHINA GOVERNMENT BOND	500,000.00	505,625.00	

	小計	CHINA GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,226,180.20		
		CHINA GOVERNMENT BOND	100,000.00	104,581.30		
		銘柄数：9	34,300,000.00	35,034,427.28		
		組入時価比率：9.8%		(708,763,981)	10.0%	
	エジプトポンド	EGYPT GOVERNMENT BOND	6,000,000.00	5,529,232.20		
		EGYPT GOVERNMENT BOND	6,300,000.00	5,680,626.84		
		EGYPT GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	2,915,530.88		
		小計	銘柄数：3	15,500,000.00	14,125,389.92	
		組入時価比率：1.4%		(103,135,121)	1.5%	
	ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,200,000.00	15,002,873.68		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,600,000.00	11,995,452.96		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,660,000.00	6,118,042.00		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,000,000.00	7,667,084.70		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	8,480,961.72		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	3,206,653.92		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	8,012,070.00		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	5,891,902.34		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	2,839,093.77		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,000,000.00	6,399,029.60		
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,200,000.00	11,330,701.14		
		小計	銘柄数：11	102,810,000.00	86,943,865.83	
			組入時価比率：9.9%		(714,678,577)	10.1%
	合計				7,062,508,326	
					(7,062,508,326)	

(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 9月 6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	69,275,259	-	69,395,719	120,460
米ドル	19,416,592	-	19,459,917	43,325
チリペソ	4,204,550	-	4,201,752	2,798
フォリント	6,991,703	-	6,921,980	69,723
ズロチ	8,901,987	-	8,893,050	8,937
レイ	11,530,722	-	11,585,720	54,998
人民元	10,106,329	-	10,114,600	8,271
ランド	8,123,376	-	8,218,700	95,324
売建	63,661,477	-	64,053,923	392,446
米ドル	49,858,667	-	50,094,363	235,696
メキシコペソ	6,902,600	-	7,034,600	132,000
トルコリラ	6,900,210	-	6,924,960	24,750
合計	-	-	-	271,986

（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。

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。

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。

海外 R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2022年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,051,097,695
コール・ローン	105,669,549
投資証券	57,903,672,283
派生商品評価勘定	2,570,171
未収入金	4,909,749

(2022年 9月 6日現在)

未収配当金	71,030,990
差入委託証拠金	187,231,698
流動資産合計	59,326,182,135
資産合計	59,326,182,135
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	60,229,625
未払金	273,342,830
未払解約金	1,798,712
未払利息	108
その他未払費用	441,800
流動負債合計	335,813,075
負債合計	335,813,075
純資産の部	
元本等	
元本	17,857,665,891
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	41,132,703,169
元本等合計	58,990,369,060
純資産合計	58,990,369,060
負債純資産合計	59,326,182,135

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 9月 6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	3.3034円
(10,000口当たり純資産額)	(33,034円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2021年 9月 7日 至 2022年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2021年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	14,846,273,818円
同期中における追加設定元本額	6,424,045,321円
同期中における一部解約元本額	3,412,653,248円
期末元本額	17,857,665,891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）	1,394,039,622円
野村世界 6 資産分散投信（分配コース）	1,813,141,256円
野村世界 6 資産分散投信（成長コース）	789,958,148円
野村資産設計ファンド 2 0 1 5	11,062,436円
野村資産設計ファンド 2 0 2 0	11,896,470円
野村資産設計ファンド 2 0 2 5	15,028,164円
野村資産設計ファンド 2 0 3 0	16,795,714円
野村資産設計ファンド 2 0 3 5	16,565,869円
野村資産設計ファンド 2 0 4 0	31,517,739円
野村資産設計ファンド 2 0 4 5	4,468,692円
野村インデックスファンド・外国 R E I T	1,630,212,247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	493,159,171円
野村世界 6 資産分散投信（配分変更コース）	662,857,984円
野村資産設計ファンド 2 0 5 0	4,043,665円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,185,071円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,319,797円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	8,690,127円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,772,056円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	10,417,295円
野村 6 資産均等バランス	2,067,663,512円
野村資産設計ファンド 2 0 6 0	2,673,994円
N E X T F U N D S 外国 R E I T ・ S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	4,857,084,814円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア） R E I T	2,800,682,208円
ノムラ海外 R E I T インデックス・ファンド V A（適格機関投資家専用）	804,976,337円
ノムラ F O F s 用インデックスファンド・外国 R E I T（適格機関投資家専用）	59,575,807円

野村F O F s 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）	376,551円
野村D C 運用戦略ファンド	261,817,411円
野村D C 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（D C）安定コース	8,501,075円
野村世界6資産分散投信（D C）インカムコース	3,966,018円
野村世界6資産分散投信（D C）成長コース	9,243,655円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2030	5,762,744円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2040	6,147,622円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2050	2,427,426円
野村資産設計ファンド（D C・つみたてN I S A）2060	1,556,052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）	18,681,464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9月6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9月6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	29,500	468,165.00	
		AGREE REALTY CORP	23,200	1,719,120.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	22,900	427,772.00	
		ALEXANDERS INC	620	141,651.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	46,210	6,949,521.90	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	2,700	49,113.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,400	449,524.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	91,600	3,208,748.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	83,900	2,432,261.00	
		APARTMENT INCOME REIT CO	49,000	2,013,900.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	46,000	402,960.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	66,000	1,018,380.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	20,000	255,000.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,000	117,480.00	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	43,420	8,792,984.20	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	8,800	235,488.00	
BOSTON PROPERTIES	44,200	3,559,868.00	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,000	101,800.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	53,000	422,940.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	93,500	2,020,535.00	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	52,400	979,356.00	
BRT APARTMENTS CORP	3,500	81,445.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	33,000	4,180,770.00	
CARETRUST REIT INC	29,800	632,058.00	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	8,200	233,700.00	
CENTERSPACE	4,800	363,024.00	
CHATHAM LODGING TRUST	14,700	176,841.00	
CITY OFFICE REIT INC	12,400	140,864.00	
CLIPPER REALTY INC	4,000	33,560.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	7,200	258,912.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	34,900	886,460.00	
COUSINS PROPERTIES INC	46,600	1,249,346.00	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY TRUST CORP	5,200	36,660.00	
CTO REALTY GROWTH INC	5,600	116,816.00	
CUBESMART	69,600	3,198,816.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	65,000	558,350.00	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	100,000	78,500.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	88,400	10,455,952.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	68,000	97,920.00	
DOUGLAS EMMETT INC	55,200	1,103,448.00	
DUKE REALTY CORP	119,600	6,902,116.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	0.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	28,100	497,932.00	
EASTGROUP PROPERTIES	13,000	2,128,100.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	42,000	301,560.00	
EPR PROPERTIES	23,000	970,830.00	
EQUINIX INC	28,290	17,855,516.40	
EQUITY COMMONWEALTH	34,900	920,313.00	

EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	53,600	3,749,320.00	
EQUITY RESIDENTIAL	106,300	7,844,940.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	43,600	965,740.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	20,340	5,410,033.20	
EXTRA SPACE STORAGE INC	41,700	8,323,320.00	
FARMLAND PARTNERS INC	9,200	130,824.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	22,200	2,237,094.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	41,200	2,055,880.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	24,500	646,555.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	75,000.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	72,900	3,508,677.00	
GETTY REALTY CORP	12,700	379,730.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,300	210,971.00	
GLADSTONE LAND CORP	9,800	225,204.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	20,000	211,800.00	
GLOBAL NET LEASE INC	31,500	418,950.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	118,600	2,842,842.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	167,200	4,323,792.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	9,600	91,104.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	32,700	983,943.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	221,500	3,823,090.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	45,800	599,980.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	69,100	1,321,192.00	
INDUS REALTY TRUST INC	2,000	119,860.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	19,700	137,309.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,800	794,288.00	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20,600	533,128.00	
INVITATION HOMES INC	189,900	6,925,653.00	
IRON MOUNTAIN INC	90,000	4,691,700.00	
JBG SMITH PROPERTIES	34,200	741,798.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	250,000	162,500.00	
KILROY REALTY CORP	32,400	1,577,232.00	
KIMCO REALTY CORP	191,500	4,065,545.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	68,300	1,308,628.00	

LIFE STORAGE INC	26,160	3,340,893.60	
LTC PROPERTIES INC	12,500	547,125.00	
LXP INDUSTRIAL TRUST	90,000	909,900.00	
MACERICH CO /THE	68,000	639,880.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	549,515	269,262.35	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	186,900	2,676,408.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	35,930	5,900,424.60	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	54,800	2,444,080.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	26,300	1,335,514.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	14,400	923,616.00	
NETSTREIT CORP	14,800	289,784.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,200	380,016.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	14,300	251,108.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	73,300	2,366,124.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,800	114,768.00	
ORION OFFICE REIT INC	18,000	178,200.00	
PARAMOUNT GROUP INC	51,000	354,960.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	73,000	1,017,620.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	41,300	704,991.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	1,000	4,070.00	
PHILLIPS EDISON & CO INC	35,700	1,172,388.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	69,600	1,147,704.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	37,500	445,875.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	12,600	253,386.00	
POSTAL REALTY TRUST INC-A	5,500	80,135.00	
PRIME US REIT	170,000	105,400.00	
PROLOGIS INC	230,000	28,034,700.00	
PUBLIC STORAGE	47,470	15,807,035.30	
REALTY INCOME CORP	186,700	12,637,723.00	
REGENCY CENTERS CORP	48,100	2,909,088.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	37,900	629,898.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	51,200	3,132,928.00	
RLJ LODGING TRUST	52,000	616,200.00	
RPT REALTY	26,000	247,780.00	

	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	17,000	1,366,970.00	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	71,600	1,056,816.00	
	SAFEHOLD INC	4,500	164,295.00	
	SAUL CENTERS INC	3,900	174,798.00	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	50,000	338,500.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	101,900	10,244,007.00	
	SITE CENTERS CORP	56,600	725,046.00	
	SL GREEN REALTY CORP	20,200	896,072.00	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41,800	1,678,688.00	
	STAG INDUSTRIAL INC	55,800	1,687,950.00	
	STORE CAPITAL CORP	78,800	2,104,748.00	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	34,000	259,760.00	
	SUN COMMUNITIES INC	37,850	5,724,434.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	66,000	712,800.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	32,800	500,528.00	
	TERRENO REALTY CORP	23,600	1,419,068.00	
	THE NECESSITY RETAIL REIT WHERE AMERICA	42,000	305,760.00	
	UDR INC	92,700	4,201,164.00	
	UMH PROPERTIES INC	16,300	288,673.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,200	208,488.00	
	URBAN EDGE PROPERTIES	33,800	533,364.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	9,600	158,592.00	
	VENTAS INC	124,400	5,890,340.00	
	VERIS RESIDENTIAL INC	24,700	333,203.00	
	VICI PROPERTIES INC	299,000	9,768,330.00	
	VORNADO REALTY TRUST	49,200	1,285,596.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	27,000	534,870.00	
	WELLTOWER INC	140,900	10,684,447.00	
	WHITESTONE REIT	13,000	128,830.00	
	WP CAREY INC	60,100	5,030,370.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	35,300	552,798.00	
小計	銘柄数：147	8,030,105	321,492,288.95	
			(45,095,723,371)	
	組入時価比率：76.4%		78.0%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	19,400	600,430.00	

小計	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	18,000	195,300.00	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	6,000	79,320.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,800	329,664.00	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	15,000	53,850.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	26,700	1,189,752.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	50,000	678,000.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	15,400	238,546.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	17,000	274,890.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	39,000	458,250.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,700	120,198.00	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	11,000	37,400.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	33,000	496,980.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	9,900	725,670.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	43,000	543,520.00	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	4,000	17,560.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	20,800	252,720.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	17,800	298,150.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	6,400	95,552.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	5,800	95,584.00	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	8,000	78,320.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	36,000	451,080.00	
	PLAZA RETAIL REIT	18,000	74,340.00	
	PRIMARIS REIT	15,925	212,598.75	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	47,100	940,116.00	
	SLATE GROCERY REIT	8,000	112,000.00	
	SLATE OFFICE REIT	12,000	53,160.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	22,500	625,275.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	29,700	549,747.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	14,000	84,560.00	
	銘柄数：30	582,925	9,962,532.75	
			(1,066,887,632)	
	組入時価比率：1.8%		1.8%	
一口	AEDIFICA	12,300	1,153,125.00	

小計	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,000	33,920.00	
	ALTAREA	1,320	172,128.00	
	BEFIMMO S.C.A.	1,400	66,360.00	
	CARE PROPERTY INVEST	8,000	168,400.00	
	CARMILA	14,400	227,808.00	
	COFINIMMO	9,100	914,550.00	
	COVIVIO	14,800	808,080.00	
	CROMWELL REIT EUR	94,000	188,940.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,800	259,584.00	
	GECINA SA	16,800	1,521,240.00	
	HAMBORNER REIT AG	22,000	179,520.00	
	ICADE	9,800	434,336.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	18,000	59,850.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	84,000	493,500.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	7,600	182,780.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	135,000	162,540.00	
	KLEPIERRE	60,900	1,221,045.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	20,000	92,200.00	
	MERCIALYS	16,000	126,000.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	103,000	943,480.00	
	MONTEA	3,200	280,640.00	
	NSI NV	5,400	157,680.00	
	RETAIL ESTATES	3,600	222,480.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	36,200	1,811,086.00	
	VASTNED RETAIL NV	5,200	111,800.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	43,600	1,277,480.00	
	WERELDHAVE NV	12,600	166,194.00	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	6,200	239,320.00	
	銘柄数：29	781,220	13,676,066.00	
			(1,910,819,941)	
	組入時価比率：3.2%		3.3%	
英債券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	140,000	102,060.00	
	AEW UK REIT PLC	48,000	50,496.00	
	ASSURA PLC	900,000	575,550.00	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY	250,000	252,000.00	

	TRUST LTD			
	BIG YELLOW GROUP PLC	53,700	657,288.00	
	BRITISH LAND	292,000	1,205,084.00	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	264,000	306,504.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	190,000	133,190.00	
	CUSTODIAN REIT PLC	139,000	140,946.00	
	DERWENT LONDON PLC	35,100	843,804.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	200,000	190,400.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	80,000	404,800.00	
	HAMMERSON PLC	1,140,000	240,198.00	
	HOME REIT PLC	242,000	275,396.00	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	124,000	143,096.00	
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	0.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	232,000	1,468,096.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	300,000	615,000.00	
	LXI REIT PLC	593,000	877,640.00	
	NEWRIVER REIT PLC	100,000	78,400.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	170,000	148,070.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	406,000	549,724.00	
	PRS REIT PLC/THE	170,000	170,000.00	
	REGIONAL REIT LTD	120,000	81,600.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	65,400	676,890.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	160,000	79,040.00	
	SEGRO PLC	373,000	3,422,648.00	
	SHAFTESBURY PLC	92,000	368,736.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	378,000	459,270.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	120,000	99,000.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	578,000	932,892.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	270,000	183,600.00	
	UNITE GROUP PLC	124,000	1,302,000.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	44,000	224,400.00	
小計	銘柄数：34	8,577,200	17,257,818.00	
			(2,805,085,737)	
	組入時価比率：4.8%		4.8%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	130,000	348,400.00	

小計	ARENA REIT	106,000	438,840.00	
	BWP TRUST	153,000	604,350.00	
	CENTURIA CAPITAL GROUP	190,000	342,000.00	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	166,000	506,300.00	
	CENTURIA OFFICE REIT	139,000	225,180.00	
	CHARTER HALL GROUP	147,000	1,887,480.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	192,000	854,400.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	163,000	663,410.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	104,000	375,440.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	460,000	358,800.00	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	70,000	187,600.00	
	DEXUS/AU	336,000	2,832,480.00	
	GDI PROPERTY GROUP	160,000	145,600.00	
	GOODMAN GROUP	528,100	9,954,685.00	
	GPT GROUP	599,000	2,509,810.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	89,000	310,610.00	
	HEALTHCO REIT	73,000	127,750.00	
	HOME CONSORTIUM LTD	57,000	275,880.00	
	HOME CO DAILY NEEDS REIT	460,000	600,300.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	56,000	185,360.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	114,000	475,380.00	
	MIRVAC GROUP	1,227,000	2,527,620.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	337,000	815,540.00	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	100,000	83,000.00	
	RURAL FUNDS GROUP	116,000	295,800.00	
	SCENTRE GROUP	1,610,000	4,636,800.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	340,000	918,000.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	743,000	2,630,220.00	
	VICINITY CENTRES	1,205,000	2,283,475.00	
	WAYPOINT REIT	228,000	585,960.00	
	銘柄数：31	10,398,100	38,986,470.00	
			(3,734,513,961)	
	組入時価比率：6.3%		6.5%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	260,000	343,200.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	330,000	716,100.00	

小計	KIWI PROPERTY GROUP LTD	480,000	487,200.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	390,000	518,700.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	150,000	411,750.00	
	銘柄数：5	1,610,000	2,476,950.00	
	組入時価比率：0.4%		(212,918,622)	0.4%
香港ドル	CHAMPION REIT	600,000	2,016,000.00	
	FORTUNE REIT	460,000	2,916,400.00	
	LINK REIT	653,000	40,388,050.00	
	PROSPERITY REIT	360,000	806,400.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	340,000	1,237,600.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	689,800	1,662,418.00	
	銘柄数：6	3,102,800	49,026,868.00	
	組入時価比率：1.5%		(876,110,131)	1.5%
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	130,000	178,100.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,047,762	2,986,121.70	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	599,956	641,952.92	
	CAPITALAND CHINA TRUST	350,279	381,804.11	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,589,694	3,242,975.76	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	260,000	325,000.00	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	100,000	68,500.00	
	EC WORLD REIT	60,000	32,700.00	
	ESR-LOGOS REIT	1,629,692	651,876.80	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	330,000	204,600.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	356,400	98,010.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	335,838	762,352.26	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	909,746	1,237,254.56	
	I REIT GLOBAL	141,212	79,078.72	
	KEPPEL DC REIT	411,211	777,188.79	
	KEPPEL REIT	630,000	674,100.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	570,000	467,400.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	610,900	1,563,904.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	979,980	1,665,966.00	

小計	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	686,716	1,270,424.60	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	780,216	288,679.92	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	123,000	586,710.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	180,000	139,500.00	
	SPH REIT	290,000	271,150.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	420,000	241,500.00	
	SUNTEC REIT	670,000	1,058,600.00	
	銘柄数：26	14,192,602	19,895,450.14	
			(1,992,728,286)	
	組入時価比率：3.4%		3.4%	
ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,000	72,480,000.00	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	48,000	259,680,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	10,000	47,850,000.00	
	JR REIT XXVII	40,524	182,763,240.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11,445	59,857,350.00	
	LOTTE REIT CO LTD	40,000	201,200,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	30,000	133,500,000.00	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	8,000	35,120,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	18,000	142,560,000.00	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	8,000	36,960,000.00	
	SK REITS CO LTD	22,822	129,172,520.00	
	銘柄数：11	252,791	1,301,143,110.00	
			(133,757,511)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
新シケル	REIT 1 LTD	56,000	1,169,280.00	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	64,000	652,800.00	
小計	銘柄数：2	120,000	1,822,080.00	
			(75,127,091)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計			57,903,672,283	
			(57,903,672,283)	

(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 9月 6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	1,077,958,117	-	1,020,326,785	57,631,332
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	78,980,229	-	78,952,107	28,122
米ドル	75,782,271	-	75,739,698	42,573
カナダドル	3,197,958	-	3,212,409	14,451
合計	-	-	-	57,659,454

（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。

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。

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村インデックスファンド・海外5資産バランス

2022年9月30日現在

資産総額	4,677,720,221円
負債総額	9,766,865円
純資産総額（ - ）	4,667,953,356円
発行済口数	2,669,370,207口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7487円

（参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

2022年9月30日現在

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

（参考）新興国株式マザーファンド

2022年9月30日現在

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

（参考）外国債券マザーファンド

2022年9月30日現在

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

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

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

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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。

上記の振替について、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

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2022年10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。

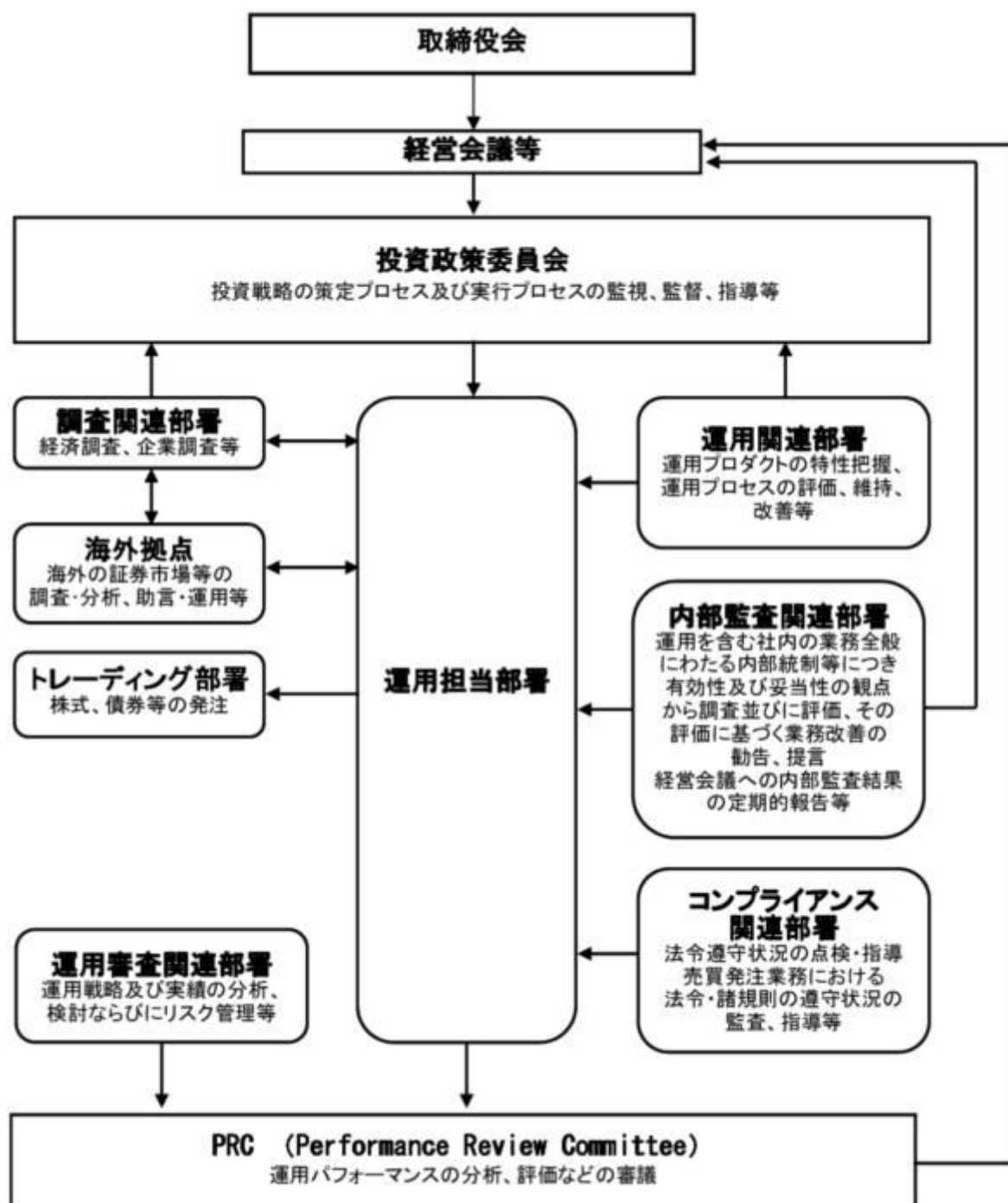
代表取締役・業務執行取締役

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9月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

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

追加型株式投資信託	1,011	37,520,719
単位型株式投資信託	198	733,969
追加型公社債投資信託	14	6,232,195
単位型公社債投資信託	496	1,260,025
合計	1,719	45,746,908

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								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	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。 建物 6年 附属設備 6～15年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
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。 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。 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。 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。 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。 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、記載しておりません。

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

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%

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

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%

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	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2021年3月31日)	当事業年度末 (2022年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,176	賞与引当金 1,381
退職給付引当金 1,022	退職給付引当金 990
関係会社株式評価減 784	関係会社株式評価減 1,010
未払事業税 430	未払事業税 285
投資有価証券評価減 428	投資有価証券評価減 110
減価償却超過額 223	減価償却超過額 272
時効後支払損引当金 179	時効後支払損引当金 182
関係会社株式売却損 148	関係会社株式売却損 505
ゴルフ会員権評価減 135	ゴルフ会員権評価減 92
資産除去債務 425	資産除去債務 348
未払社会保険料 95	未払社会保険料 114
その他 358	その他 84
繰延税金資産小計 5,410	繰延税金資産小計 5,376
評価性引当額 1,530	評価性引当額 1,795
繰延税金資産合計 3,879	繰延税金資産合計 3,581
繰延税金負債	繰延税金負債
資産除去債務に対応する除去費用 361	資産除去債務に対応する除去費用 233
関係会社株式評価益 80	関係会社株式評価益 81
その他有価証券評価差額金 25	その他有価証券評価差額金 78
前払年金費用 403	前払年金費用 402
繰延税金負債合計 871	繰延税金負債合計 796
繰延税金資産の純額 3,008	繰延税金資産の純額 2,784

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

資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

(単位：百万円)

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

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。

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

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。

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㈱（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㈱（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。

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。)。

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。)。

通常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 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。

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。

上記 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9月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
a u カブコム証券株式会社	7,196百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
西日本シティ T T 証券株式会社	3,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
北洋証券株式会社	500百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸近証券株式会社	200百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
楽天証券株式会社	19,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	

株式会社筑波銀行	48,868百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社東京スター銀行	26,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
岡崎信用金庫	3,096百万円	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

* 2022年9月末現在

岡崎信用金庫の資本金の額の箇所には出資の総額を記載しております。

2【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いを行ない、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

委託会社は、丸近証券株式会社の株式の10.9%を保有しています。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。

(2)目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。

(3)届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含む)も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手

できる旨を記載する場合があります。

- (7)目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8)目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

独立監査人の監査報告書

2022年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	湯 原 尚
--------------------	-------	-------

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

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第63期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

-
- (注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2022年11月4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」に掲げられている野村インデックスファンド・海外5資産バランスの2021年9月7日から2022年9月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村インデックスファンド・海外5資産バランスの2022年9月6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。