

## 【表紙】

|            |                                |
|------------|--------------------------------|
| 【提出書類】     | 有価証券報告書                        |
| 【提出先】      | 関東財務局長殿                        |
| 【提出日】      | 2023年5月16日提出                   |
| 【計算期間】     | 第10期(自 2022年2月18日至 2023年2月17日) |
| 【ファンド名】    | 野村D C運用戦略ファンド（マイルド）            |
| 【発行者名】     | 野村アセットマネジメント株式会社               |
| 【代表者の役職氏名】 | C E O兼代表取締役社長 小池 広靖            |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都江東区豊洲二丁目2番1号                |
| 【事務連絡者氏名】  | 松井 秀仁                          |
| 【連絡場所】     | 東京都江東区豊洲二丁目2番1号                |
| 【電話番号】     | 03-6387-5000                   |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。                    |

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

受益権の申込みを行なう投資者は、確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等に限るものとします。

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

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

#### ■ 信託金の限度額 ■

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

#### < 商品分類 >

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

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

（野村DC運用戦略ファンド（マイルド））

#### 《商品分類表》

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産<br>(収益の源泉) |
|---------|--------|-------------------|
|---------|--------|-------------------|

|     |    |              |
|-----|----|--------------|
| 単位型 | 国内 | 株式           |
|     | 海外 | 債券           |
| 追加型 | 内外 | 不動産投信        |
|     |    | その他資産<br>( ) |
|     |    | 資産複合         |

## 《属性区分表》

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

< 商品分類表定義 >

[ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

[ 投資対象地域による区分 ]

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

[ 投資対象資産による区分 ]

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

[ 独立した区分 ]

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

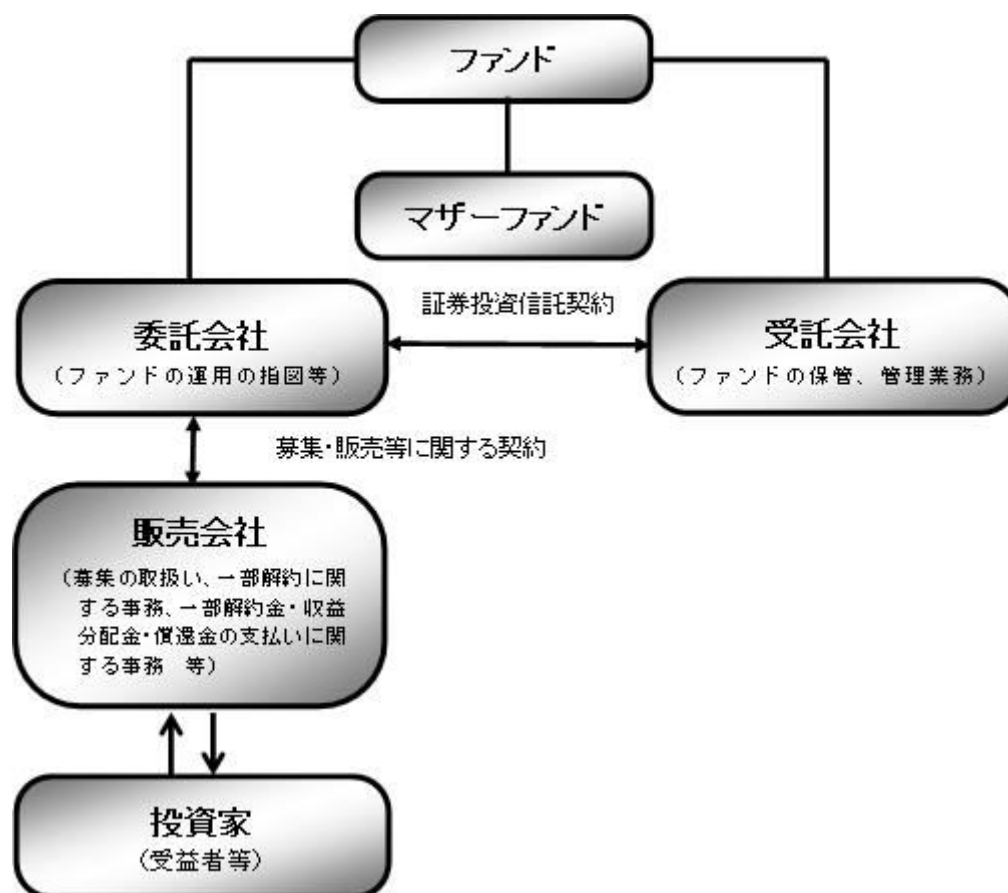
2013年3月29日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

2016年11月10日

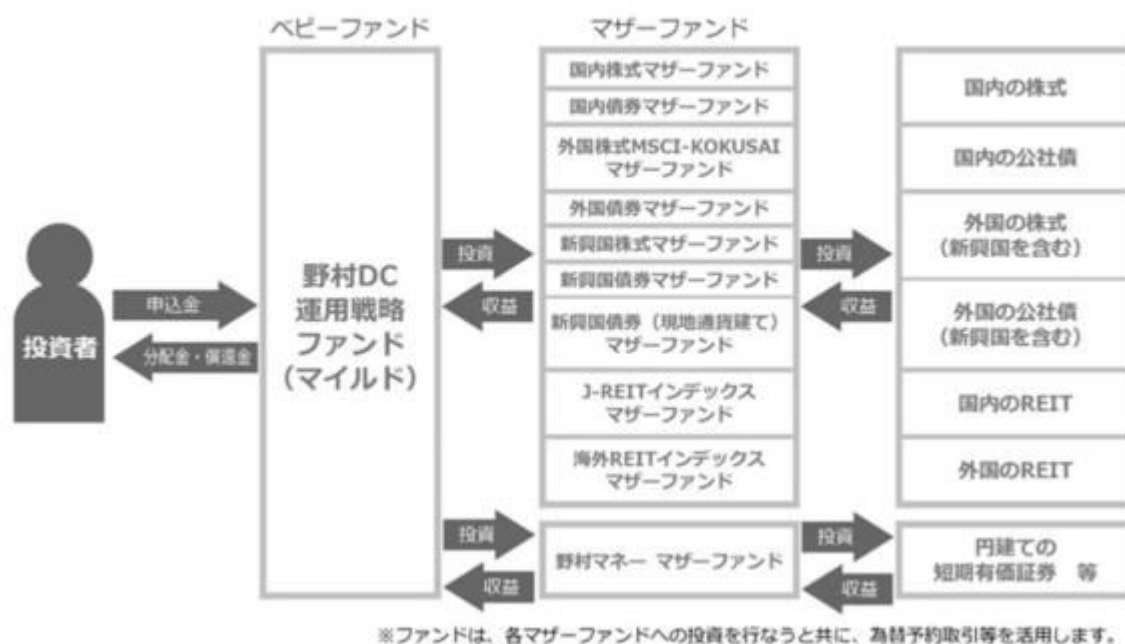
「野村DC運用戦略ファンドM」から「野村DC運用戦略ファンド（マイルド）」へ名称を変更

## （３）【ファンドの仕組み】



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

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



■ 委託会社の概況(2023年3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 ] 運用にあたっては、世界の様々な指標の動きを計量的なアプローチを用いて分析し、リスク水準<sup>1</sup>を一定範囲内程度に抑えつつ効率的に収益を獲得することを目指して、各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジション<sup>2</sup>を決定します。

- 1 リスク水準とは、推定されるポートフォリオの価格の変動の大きさのことです。ファンドでは、推定される基準価額の「振れ幅」（上下変動の程度）を表しています。リスク水準の調整にあたっては、基準価額の目標変動リスク値を、当年度率3%程度以下となることを目指して、リスク水準の異なる資産の配分比率や実質的な外貨のエクスポージャーを変更します。

基準価額の変動の方向は、上昇することも下落することもあり得ます。変動リスクの大きさは、必ずしもファンドの運用成績の良さを意味するものではありません。実際の運用成績は、マイナスとなる可能性があります。

ファンドで組入れる各資産と為替の過去の価格の変動リスク等の統計値から、それらを組み合わせた将来の価格の変動リスク値を推定し、資産配分と通貨配分により目標変動リスク値を調整します。ただし、目標変動リスク値はあくまでも推定に基づく統計的な目安ですので、実際の基準価額の変動リスクは、推定値からはずれる場合があります。したがって、基準価額が目標変動リスク値で示される範囲より小さくしか値動きをしない場合もあれば、目標変動リスク値で示される範囲を超えて大きく値下がりする場合もあります。

変動リスク値は、「ボラティリティ」や「標準偏差」と呼ばれることもあります。

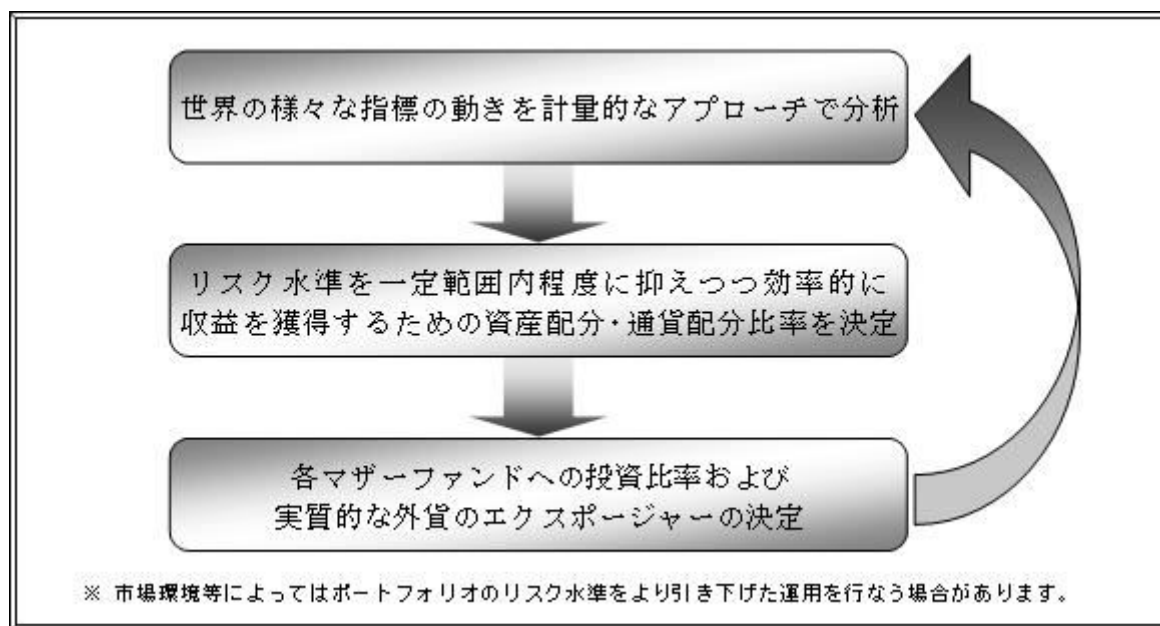
- 2 マザーファンドを通じて実質的に投資を行なう内外の株式およびREITへの投資比率、ファンドが投資する外貨建資産と為替予約取引等を加味した実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、以下の範囲内となります。

| 実質的な内外の株式<br>およびREITへの投資比率 | 実質的な外貨の<br>エクスポージャー |
|----------------------------|---------------------|
| 純資産総額の30%以内                | 純資産総額の30%以内         |

各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジションは適宜見直しを行ないます。

一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

#### ■運用プロセスについて■



各マザーファンド（「野村マネー マザーファンド」を除く）は、各々以下の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

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

| マザーファンド名                     | 主要投資対象                                | 対象指数                                                                        |
|------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------|
| 国内株式マザーファンド                  | わが国の株式                                | 東証株価指数（TOPIX）                                                               |
| 国内債券マザーファンド                  | わが国の公社債                               | NOMURA-BPI 国債指数                                                             |
| 外国株式 MSCI-KOKUSAI<br>マザーファンド | 外国の株式                                 | MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし） <sup>*1</sup>                                 |
| 外国債券マザーファンド                  | 外国の公社債                                | FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）                                            |
| 新興国株式マザーファンド                 | 新興国の株式（DR（預託証券） <sup>*1</sup> 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） <sup>*2</sup>                         |
| 新興国債券マザーファンド                 | 新興国の公社債                               | JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース） <sup>*3</sup>                   |
| 新興国債券（現地通貨建て）<br>マザーファンド     | 現地通貨建ての新興国の公社債                        | JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） <sup>*4</sup> |
| J-REIT インデックス<br>マザーファンド     | J-REIT <sup>*2</sup>                  | 東証 REIT 指数（配当込み）                                                            |
| 海外 REIT インデックス<br>マザーファンド    | 日本を除く世界各国の REIT <sup>*3</sup>         | S&P 先進国 REIT 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） <sup>*5</sup>                             |

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

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

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

\*1 MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

\*2 MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

\*3 JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

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

\*5 S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

内外の株式およびREITをそれぞれ主な投資対象とする「国内株式マザーファンド」、「外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」への投資比率の合計は、原則として、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

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

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

実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、信託財産の純資産総額の30%以内となるように調整を行ないます。

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

■

## 東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）

東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有する。

J P Xは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。

J P Xは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）に係る標章又は商標の使用に関して得られる結果並びに特定日の東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値について、何ら保証、言及をするものではない。

J P Xは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。

本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。

J P Xは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。

J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（TOPIX）、東証REIT指数（配当込み）の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。

以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

## NOMURA - BPI 国債指数

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しております。また、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

## MSCI - KOKUSAI 指数

## MSCI エマージング・マーケット・インデックス

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

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

MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

#### FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

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

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

#### JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - 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

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

ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何

らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できるとされる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

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

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・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](mailto: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](http://www.morganmarkets.com) もご覧ください。

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

#### S&P先進国REIT指数

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

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

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマ

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

#### 投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

#### 有価証券の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内株式マザーファンド、国内債券マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、外国債券マザーファンド、新興国株式マザーファンド、新興国債券マザーファンド、新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド、J-REITインデックス マザーファンド、海外REITインデックス マザーファンドおよび野村マネー マザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、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（新株引受権証書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。）

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 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・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 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<sup>1</sup>

4. 為替先渡取引<sup>2</sup>

5. 直物為替先渡取引<sup>3</sup>

- 1 「金利先渡取引」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」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」は、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

（参考）各マザーファンドの概要

（国内株式マザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

主としてわが国の株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。

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

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は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17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。

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

## （国内債券マザーファンド）

## 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指します。

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は行ないません。

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。

## （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。

（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。

（新興国株式マザーファンド）  
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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。

（新興国債券マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。

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。

投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

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。

## （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。

## (J - REITインデックス マザーファンド)

### 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1.基本方針

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

#### 2.運用方法

##### (1)投資対象

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

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

##### (2)投資態度

J - REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

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。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

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、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が30%を超えるJ - REITがある場合には、当該J - REITへ東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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。

## （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。

## (野村マネー マザーファンド)

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1.基本方針

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

## 2.運用方法

## (1)投資対象

本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

## (2)投資態度

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

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

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

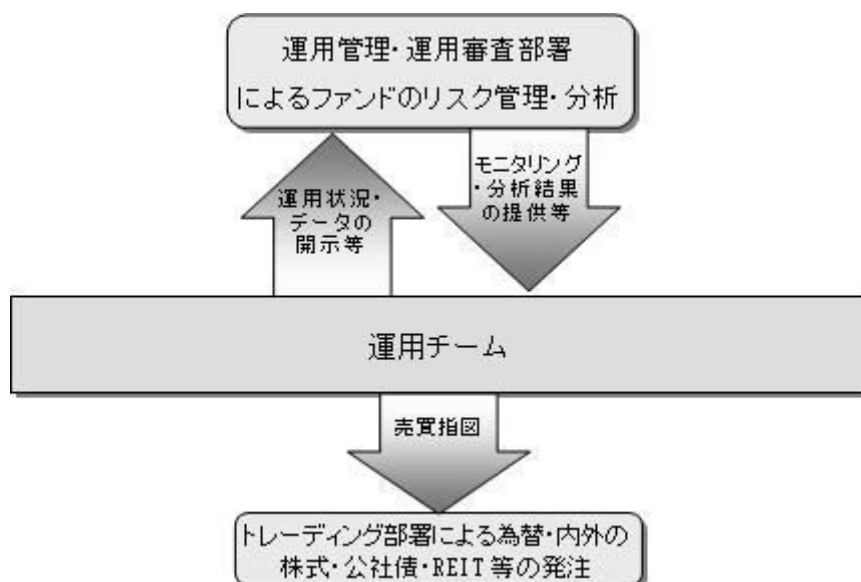
スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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。

## (3)【運用体制】

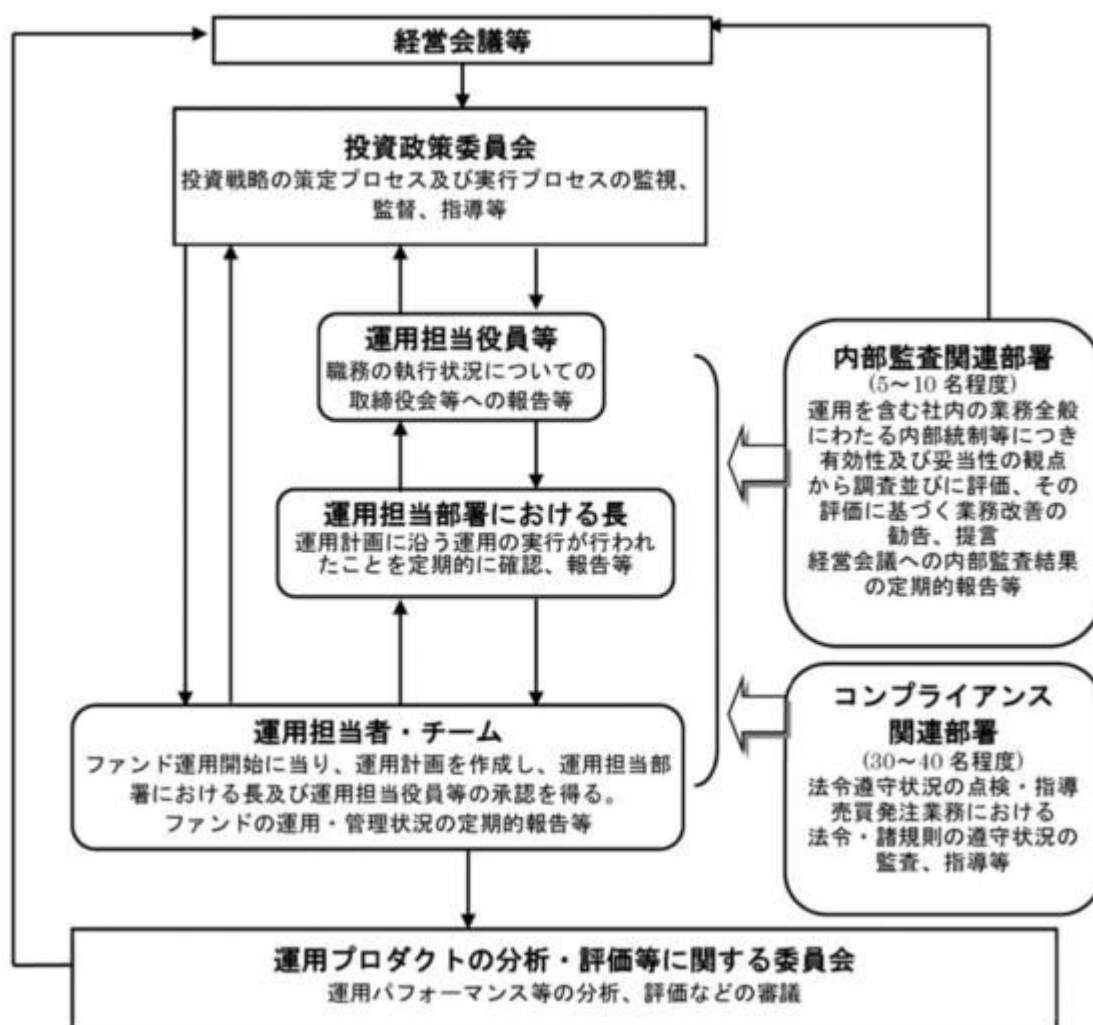
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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、上記の範囲内で、基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

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2月17日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

### （５）【投資制限】

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

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

#### 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に帰属します。

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

#### [株価変動リスク]

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

#### [REITの価格変動リスク]

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

#### [債券価格変動リスク]

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

#### [為替変動リスク]

ファンドは、為替変動リスクの低減を図る目的（ヘッジ目的）のほか、効率的に収益を追求する目的

（ヘッジ目的外）で為替予約取引等を活用しますので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

#### その他の留意点

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付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。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

#### 委託会社におけるリスクマネジメント体制

##### リスク管理関連の委員会

##### パフォーマンスの考査

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

##### 運用リスクの管理

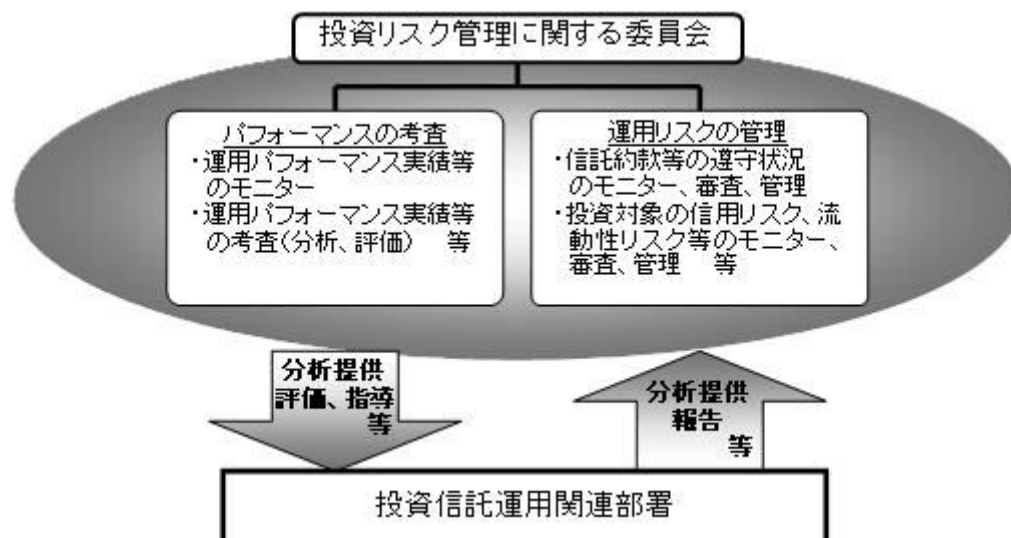
投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

##### 流動性リスク管理について

流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを

実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証などを行ないます。リスク管理関連の委員会が、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について監督します。

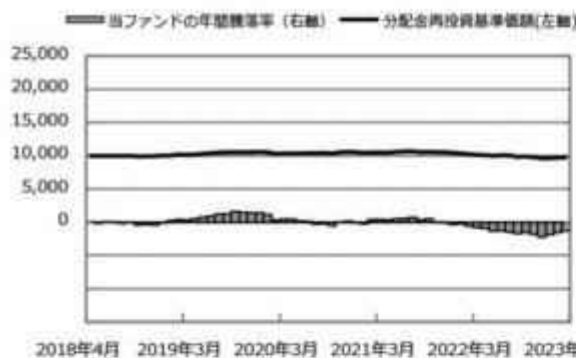
#### リスク管理体制図



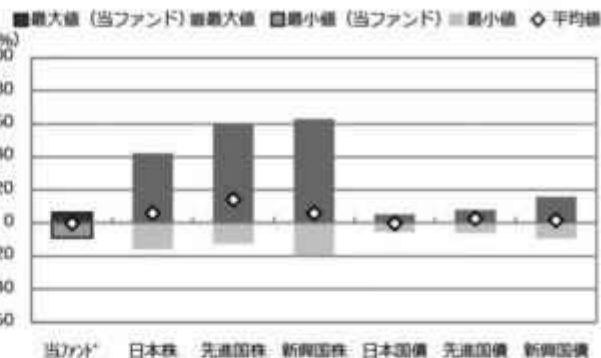
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

## ■ リスクの定量的比較（2018年4月末～2023年3月末：月次）

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



|        | 当ファンド | 日本株    | 先進国株   | 新興国株   | 日本国債  | 先進国債  | 新興国債  |
|--------|-------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 最大値（％） | 6.5   | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 5.4   | 7.9   | 15.7  |
| 最小値（％） | △ 8.8 | △ 16.0 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 9.4 |
| 平均値（％） | △ 0.2 | 5.9    | 14.3   | 5.9    | △ 0.3 | 2.7   | 1.7   |

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年4月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2018年4月から2023年3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。
- \* 2018年4月から2023年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

### <代表的な資産クラスの指数>

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

### ■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標準又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に係る標準又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、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、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは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、その他の情報は強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、または買主になっている可能性もあります。

米国のJ.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての援助、保障または販売促進を行いません。証券または金融商品は、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、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。

JPMSLLCはNASDAQ、NYSE、SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA、JPSI、J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

## 4 【手数料等及び税金】

### （１）【申込手数料】

申込手数料はありません。

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.66%（税抜年0.60%）以内（2023年5月16日現在年0.66%（税抜年0.60%））の率（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とします。

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

信託報酬率の配分は下記の通り（税抜）とします。

|          |          |          |
|----------|----------|----------|
| < 委託会社 > | < 販売会社 > | < 受託会社 > |
| 年0.30%   | 年0.25%   | 年0.05%   |

\* 上記配分は、2023年5月16日現在の信託報酬率における配分です。

### 支払先の役務の内容

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

## （４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税、復興特別所得税および地方税がかかりません。

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いには以下の通りです。

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### ■ 個別元本について ■

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

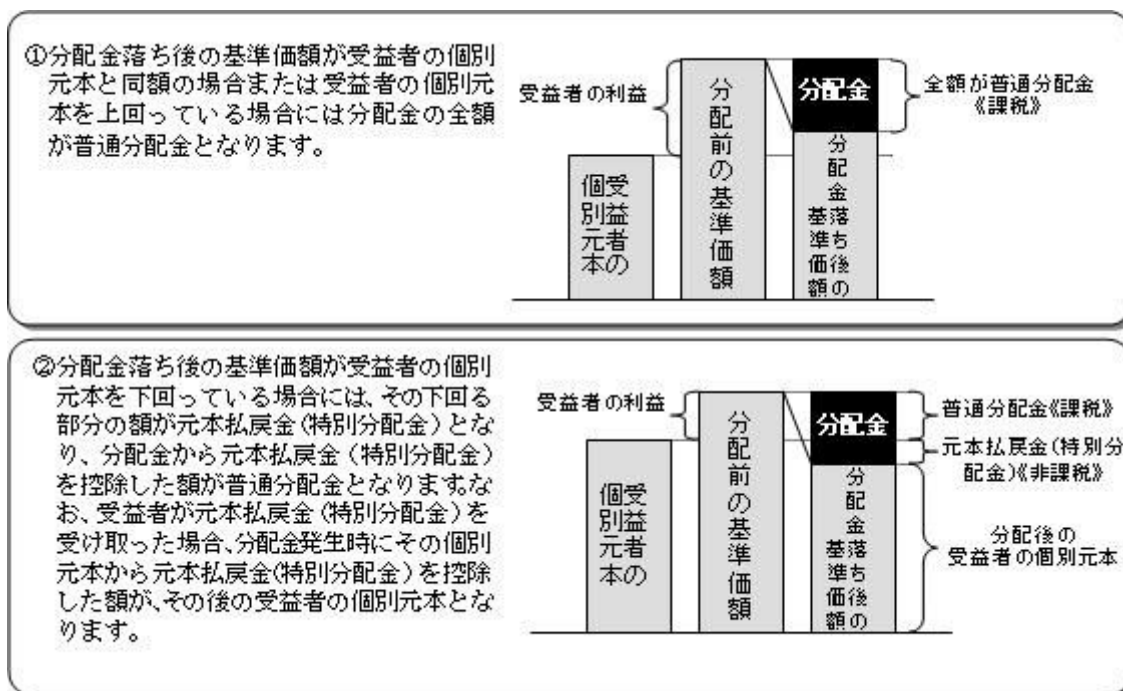
#### ■ 換金（解約）時および償還時の課税について ■

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ■ 分配金の課税について ■

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



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

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

\* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2023年3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2023年3月31日現在の運用状況であります。

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

### （１）【投資状況】

#### 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）

| 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   | 3,214,677,648 | 63.90   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 1,815,804,475 | 36.09   |
| 合計（純資産総額）          |      | 5,030,482,123 | 100.00  |

### （参考）国内株式マザーファンド

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|--------------------|------|-----------------|---------|
| 株式                 | 日本   | 478,284,534,490 | 97.19   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 13,819,340,504  | 2.80    |
| 合計（純資産総額）          |      | 492,103,874,994 | 100.00  |

#### その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 資産の種類    | 建別 | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|----------|----|------|----------------|---------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | 日本   | 13,483,555,000 | 2.73    |

### （参考）国内債券マザーファンド

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券               | 日本   | 21,954,593,960 | 99.22   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 172,050,317    | 0.77    |
| 合計（純資産総額）          |      | 22,126,644,277 | 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     | 1,036,737,196,053 | 69.54  |
|                    | カナダ      | 52,152,027,098    | 3.49   |
|                    | ドイツ      | 39,173,661,771    | 2.62   |
|                    | イタリア     | 11,100,521,329    | 0.74   |
|                    | フランス     | 55,241,287,114    | 3.70   |
|                    | オランダ     | 21,655,651,167    | 1.45   |
|                    | スペイン     | 11,855,663,545    | 0.79   |
|                    | ベルギー     | 3,837,113,176     | 0.25   |
|                    | オーストリア   | 810,980,616       | 0.05   |
|                    | ルクセンブルグ  | 322,789,035       | 0.02   |
|                    | フィンランド   | 4,468,781,688     | 0.29   |
|                    | アイルランド   | 3,524,650,296     | 0.23   |
|                    | ポルトガル    | 1,016,802,831     | 0.06   |
|                    | イギリス     | 66,668,155,618    | 4.47   |
|                    | スイス      | 44,944,839,914    | 3.01   |
|                    | スウェーデン   | 15,150,663,478    | 1.01   |
|                    | ノルウェー    | 2,999,061,526     | 0.20   |
|                    | デンマーク    | 13,884,061,791    | 0.93   |
|                    | オーストラリア  | 31,865,097,730    | 2.13   |
|                    | ニュージーランド | 1,002,260,667     | 0.06   |
|                    | 香港       | 11,443,981,302    | 0.76   |
|                    | シンガポール   | 5,188,310,771     | 0.34   |
|                    | イスラエル    | 2,019,283,496     | 0.13   |
| 小計                 |          | 1,437,062,842,012 | 96.40  |
| 投資証券               | アメリカ     | 27,243,648,121    | 1.82   |
|                    | カナダ      | 154,024,325       | 0.01   |
|                    | フランス     | 567,819,692       | 0.03   |
|                    | ベルギー     | 146,868,273       | 0.00   |
|                    | イギリス     | 608,461,641       | 0.04   |
|                    | オーストラリア  | 1,829,330,693     | 0.12   |
|                    | 香港       | 476,318,102       | 0.03   |
|                    | シンガポール   | 636,325,444       | 0.04   |
| 小計                 |          | 31,662,796,291    | 2.12   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —        | 21,911,346,532    | 1.46   |
| 合計（純資産総額）          |          | 1,490,636,984,835 | 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 | 15,635,828,880 | 1.04    |
|          | 買建 | カナダ  | 758,526,400    | 0.05    |

|    |         |               |      |
|----|---------|---------------|------|
| 買建 | ドイツ     | 2,263,241,431 | 0.15 |
| 買建 | イギリス    | 997,161,250   | 0.06 |
| 買建 | スイス     | 654,926,876   | 0.04 |
| 買建 | オーストラリア | 496,299,615   | 0.03 |

## （参考）外国債券マザーファンド

| 資産の種類              | 国／地域     | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|--------------------|----------|-----------------|---------|
| 国債証券               | アメリカ     | 344,886,209,411 | 49.07   |
|                    | カナダ      | 14,269,055,430  | 2.03    |
|                    | メキシコ     | 6,144,497,901   | 0.87    |
|                    | ドイツ      | 40,767,953,458  | 5.80    |
|                    | イタリア     | 58,787,074,153  | 8.36    |
|                    | フランス     | 51,930,489,322  | 7.38    |
|                    | オランダ     | 8,827,067,746   | 1.25    |
|                    | スペイン     | 41,441,850,971  | 5.89    |
|                    | ベルギー     | 14,853,036,241  | 2.11    |
|                    | オーストリア   | 8,469,917,389   | 1.20    |
|                    | フィンランド   | 2,274,433,379   | 0.32    |
|                    | アイルランド   | 4,303,943,046   | 0.61    |
|                    | イギリス     | 33,844,516,792  | 4.81    |
|                    | スウェーデン   | 1,439,456,969   | 0.20    |
|                    | ノルウェー    | 1,387,281,271   | 0.19    |
|                    | デンマーク    | 2,236,330,338   | 0.31    |
|                    | ポーランド    | 3,227,835,900   | 0.45    |
|                    | オーストラリア  | 11,028,146,242  | 1.56    |
|                    | ニュージーランド | 1,555,820,567   | 0.22    |
|                    | シンガポール   | 3,068,222,410   | 0.43    |
|                    | マレーシア    | 3,805,312,039   | 0.54    |
|                    | 中国       | 32,490,461,883  | 4.62    |
|                    | イスラエル    | 2,273,363,255   | 0.32    |
|                    | 小計       | 693,312,276,113 | 98.65   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —        | 9,428,044,630   | 1.34    |
| 合計（純資産総額）          |          | 702,740,320,743 | 100.00  |

## （参考）新興国株式マザーファンド

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円）       | 投資比率（％） |
|-------|------|---------------|---------|
| 株式    | アメリカ | 3,030,501,155 | 3.41    |
|       | メキシコ | 2,173,074,543 | 2.44    |

|                    |          |                |        |
|--------------------|----------|----------------|--------|
|                    | ブラジル     | 4,182,957,160  | 4.71   |
|                    | チリ       | 201,612,230    | 0.22   |
|                    | コロンビア    | 43,031,158     | 0.04   |
|                    | ギリシャ     | 324,542,900    | 0.36   |
|                    | トルコ      | 525,833,064    | 0.59   |
|                    | チェコ      | 142,056,031    | 0.16   |
|                    | ハンガリー    | 152,250,823    | 0.17   |
|                    | ポーランド    | 598,911,479    | 0.67   |
|                    | 香港       | 20,797,340,180 | 23.42  |
|                    | マレーシア    | 1,239,253,554  | 1.39   |
|                    | タイ       | 1,818,033,590  | 2.04   |
|                    | フィリピン    | 616,880,468    | 0.69   |
|                    | インドネシア   | 1,610,449,103  | 1.81   |
|                    | 韓国       | 10,015,629,432 | 11.28  |
|                    | 台湾       | 12,883,427,232 | 14.51  |
|                    | インド      | 10,763,986,163 | 12.12  |
|                    | カタール     | 757,323,035    | 0.85   |
|                    | エジプト     | 8,233,648      | 0.00   |
|                    | 南アフリカ    | 2,973,744,921  | 3.34   |
|                    | アラブ首長国連邦 | 1,067,763,228  | 1.20   |
|                    | クウェート    | 746,347,411    | 0.84   |
|                    | サウジアラビア  | 3,319,859,273  | 3.73   |
|                    | 小計       | 79,993,041,781 | 90.11  |
| 投資信託受益証券           | アメリカ     | 3,669,494,546  | 4.13   |
| 投資証券               | メキシコ     | 73,530,135     | 0.08   |
|                    | 南アフリカ    | 29,211,000     | 0.03   |
|                    | 小計       | 102,741,135    | 0.11   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —        | 5,004,750,208  | 5.63   |
| 合計（純資産総額）          |          | 88,770,027,670 | 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 | 4,184,037,021 | 4.71    |
|          | 買建 | 香港   | 744,523,888   | 0.83    |

## （参考）新興国債券マザーファンド

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|-------|------|----------------|---------|
| 国債証券  | アメリカ | 28,757,503,717 | 98.19   |

|                    |   |                |        |
|--------------------|---|----------------|--------|
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | — | 529,733,846    | 1.80   |
| 合計（純資産総額）          |   | 29,287,237,563 | 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    | 862,010,792   | 9.71    |
|                    | ブラジル    | 883,470,988   | 9.95    |
|                    | チリ      | 199,174,705   | 2.24    |
|                    | コロンビア   | 319,413,495   | 3.60    |
|                    | ペルー     | 200,376,255   | 2.25    |
|                    | ウルグアイ   | 12,806,091    | 0.14    |
|                    | ドミニカ共和国 | 22,070,497    | 0.24    |
|                    | セルビア    | 23,233,565    | 0.26    |
|                    | トルコ     | 99,277,628    | 1.11    |
|                    | チェコ     | 503,195,511   | 5.67    |
|                    | ハンガリー   | 269,002,378   | 3.03    |
|                    | ポーランド   | 621,922,351   | 7.00    |
|                    | ロシア     | 0             | 0.00    |
|                    | ルーマニア   | 307,329,729   | 3.46    |
|                    | マレーシア   | 857,300,030   | 9.66    |
|                    | タイ      | 887,827,091   | 10.00   |
|                    | インドネシア  | 848,960,883   | 9.56    |
|                    | 中国      | 848,287,534   | 9.56    |
|                    | エジプト    | 62,675,672    | 0.70    |
|                    | 南アフリカ   | 828,274,021   | 9.33    |
|                    | 小計      | 8,656,609,216 | 97.56   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —       | 215,736,518   | 2.43    |
| 合計（純資産総額）          |         | 8,872,345,734 | 100.00  |

## （参考）J - R E I T インデックス マザーファンド

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 投資証券               | 日本   | 43,916,529,850 | 97.14   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 1,289,474,810  | 2.85    |
| 合計（純資産総額）          |      | 45,206,004,660 | 100.00  |

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 資産の種類      | 建別 | 国 / 地域 | 時価合計（円）       | 投資比率（％） |
|------------|----|--------|---------------|---------|
| REIT指数先物取引 | 買建 | 日本     | 1,274,109,000 | 2.81    |

（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     | 42,227,233,640 | 75.38   |
|                    | カナダ      | 985,296,640    | 1.75    |
|                    | ドイツ      | 26,532,697     | 0.04    |
|                    | イタリア     | 7,488,551      | 0.01    |
|                    | フランス     | 991,466,115    | 1.76    |
|                    | オランダ     | 108,895,972    | 0.19    |
|                    | スペイン     | 228,606,629    | 0.40    |
|                    | ベルギー     | 629,937,623    | 1.12    |
|                    | アイルランド   | 19,861,636     | 0.03    |
|                    | シンガポール   | 25,693,350     | 0.04    |
|                    | イギリス     | 2,716,476,973  | 4.84    |
|                    | オーストラリア  | 3,625,313,703  | 6.47    |
|                    | ニュージーランド | 225,983,516    | 0.40    |
|                    | 香港       | 868,806,808    | 1.55    |
|                    | シンガポール   | 2,042,151,965  | 3.64    |
|                    | 韓国       | 127,044,975    | 0.22    |
|                    | イスラエル    | 69,742,430     | 0.12    |
|                    | 小計       | 54,926,533,223 | 98.05   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —        | 1,090,209,016  | 1.94    |
| 合計（純資産総額）          |          | 56,016,742,239 | 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   | 952,683,132 | 1.70    |

（参考）野村マネー マザーファンド

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

|                    |    |               |        |
|--------------------|----|---------------|--------|
| 地方債証券              | 日本 | 130,051,657   | 2.70   |
| 特殊債券               | 日本 | 863,237,109   | 17.98  |
| 社債券                | 日本 | 100,024,294   | 2.08   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —  | 3,706,317,092 | 77.22  |
| 合計（純資産総額）          |    | 4,799,630,152 | 100.00 |

## （２）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）

| 順位 | 国／地域 | 種類            | 銘柄名                     | 数量            | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|------|---------------|-------------------------|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券マザーファンド             | 1,210,194,544 | 1.2902          | 1,561,393,000   | 1.3194          | 1,596,730,681   | 31.74           |
| 2  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券マザーファンド             | 351,907,289   | 2.5070          | 882,251,530     | 2.5513          | 897,821,066     | 17.84           |
| 3  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 35,870,199    | 4.7711          | 171,140,307     | 4.7014          | 168,640,153     | 3.35            |
| 4  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式マザーファンド             | 73,514,282    | 2.1643          | 159,106,961     | 2.2034          | 161,981,368     | 3.21            |
| 5  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | J-REITインデックスマザーファンド     | 64,508,762    | 2.5448          | 164,163,196     | 2.5108          | 161,968,599     | 3.21            |
| 6  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド    | 52,543,151    | 1.4762          | 77,564,962      | 1.5041          | 79,030,153      | 1.57            |
| 7  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 新興国株式マザーファンド            | 46,226,837    | 1.6033          | 74,119,474      | 1.5615          | 72,183,205      | 1.43            |
| 8  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 海外REITインデックスマザーファンド     | 16,006,654    | 3.2132          | 51,432,648      | 2.9626          | 47,421,313      | 0.94            |
| 9  | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 新興国債券マザーファンド            | 11,130,886    | 1.9112          | 21,273,349      | 1.9101          | 21,261,105      | 0.42            |
| 10 | 日本   | 親投資信託<br>受益証券 | 野村マネーマザーファンド            | 7,492,405     | 1.0197          | 7,640,005       | 1.0197          | 7,640,005       | 0.15            |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 63.90   |
| 合 計       | 63.90   |

## （参考）国内株式マザーファンド

| 順位 | 国／地域 | 種類 | 銘柄名     | 業種    | 数量        | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|------|----|---------|-------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 株式 | トヨタ自動車  | 輸送用機器 | 9,132,200 | 2,149.67        | 19,631,219,845  | 1,880.00        | 17,168,536,000  | 3.48            |
| 2  | 日本   | 株式 | ソニーグループ | 電気機器  | 1,176,500 | 10,580.08       | 12,447,473,295  | 11,985.00       | 14,100,352,500  | 2.86            |
| 3  | 日本   | 株式 | キーエンス   | 電気機器  | 166,400   | 50,519.10       | 8,406,378,362   | 64,450.00       | 10,724,480,000  | 2.17            |

|    |    |    |                   |        |            |           |               |           |               |      |
|----|----|----|-------------------|--------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 4  | 日本 | 株式 | 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 銀行業    | 10,258,200 | 751.06    | 7,704,523,692 | 847.90    | 8,697,927,780 | 1.76 |
| 5  | 日本 | 株式 | 日本電信電話            | 情報・通信業 | 2,137,300  | 3,867.49  | 8,266,006,693 | 3,962.00  | 8,467,982,600 | 1.72 |
| 6  | 日本 | 株式 | 第一三共              | 医薬品    | 1,453,100  | 3,439.45  | 4,997,867,018 | 4,822.00  | 7,006,848,200 | 1.42 |
| 7  | 日本 | 株式 | 武田薬品工業            | 医薬品    | 1,476,100  | 3,788.35  | 5,591,987,699 | 4,350.00  | 6,421,035,000 | 1.30 |
| 8  | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ   | 銀行業    | 1,197,000  | 3,984.55  | 4,769,508,111 | 5,298.00  | 6,341,706,000 | 1.28 |
| 9  | 日本 | 株式 | 日立製作所             | 電気機器   | 816,800    | 6,476.76  | 5,290,219,128 | 7,252.00  | 5,923,433,600 | 1.20 |
| 10 | 日本 | 株式 | 信越化学工業            | 化学     | 1,384,800  | 3,537.19  | 4,898,303,701 | 4,275.00  | 5,920,020,000 | 1.20 |
| 11 | 日本 | 株式 | 東京エレクトロン          | 電気機器   | 352,000    | 17,453.63 | 6,143,680,880 | 16,040.00 | 5,646,080,000 | 1.14 |
| 12 | 日本 | 株式 | 任天堂               | その他製品  | 1,050,000  | 5,667.34  | 5,950,716,040 | 5,131.00  | 5,387,550,000 | 1.09 |
| 13 | 日本 | 株式 | 三井物産              | 卸売業    | 1,287,500  | 3,172.27  | 4,084,308,181 | 4,116.00  | 5,299,350,000 | 1.07 |
| 14 | 日本 | 株式 | K D D I           | 情報・通信業 | 1,288,900  | 4,334.89  | 5,587,242,542 | 4,093.00  | 5,275,467,700 | 1.07 |
| 15 | 日本 | 株式 | 三菱商事              | 卸売業    | 1,100,200  | 4,139.63  | 4,554,424,452 | 4,751.00  | 5,227,050,200 | 1.06 |
| 16 | 日本 | 株式 | H O Y A           | 精密機器   | 355,200    | 12,603.43 | 4,476,741,415 | 14,560.00 | 5,171,712,000 | 1.05 |
| 17 | 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ        | 情報・通信業 | 964,400    | 4,988.71  | 4,811,112,502 | 5,182.00  | 4,997,520,800 | 1.01 |
| 18 | 日本 | 株式 | 本田技研工業            | 輸送用機器  | 1,351,900  | 3,342.47  | 4,518,694,737 | 3,510.00  | 4,745,169,000 | 0.96 |
| 19 | 日本 | 株式 | ダイキン工業            | 機械     | 200,500    | 19,919.24 | 3,993,809,270 | 23,655.00 | 4,742,827,500 | 0.96 |
| 20 | 日本 | 株式 | 伊藤忠商事             | 卸売業    | 1,084,300  | 3,713.33  | 4,026,367,169 | 4,301.00  | 4,663,574,300 | 0.94 |
| 21 | 日本 | 株式 | リクルートホールディングス     | サービス業  | 1,265,700  | 4,363.51  | 5,522,899,907 | 3,650.00  | 4,619,805,000 | 0.93 |
| 22 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ    | 銀行業    | 2,368,900  | 1,594.14  | 3,776,360,014 | 1,878.00  | 4,448,794,200 | 0.90 |
| 23 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス      | 保険業    | 1,649,400  | 2,364.92  | 3,900,701,037 | 2,547.00  | 4,201,021,800 | 0.85 |
| 24 | 日本 | 株式 | ソフトバンク            | 情報・通信業 | 2,679,600  | 1,509.61  | 4,045,163,085 | 1,529.00  | 4,097,108,400 | 0.83 |
| 25 | 日本 | 株式 | オリエンタルランド         | サービス業  | 904,800    | 3,490.43  | 3,158,146,569 | 4,528.00  | 4,096,934,400 | 0.83 |
| 26 | 日本 | 株式 | 村田製作所             | 電気機器   | 504,400    | 8,151.70  | 4,111,718,509 | 8,040.00  | 4,055,376,000 | 0.82 |
| 27 | 日本 | 株式 | ファナック             | 電気機器   | 816,200    | 3,947.56  | 3,222,000,067 | 4,760.00  | 3,885,112,000 | 0.78 |
| 28 | 日本 | 株式 | S M C             | 機械     | 54,500     | 61,720.89 | 3,363,788,898 | 69,830.00 | 3,805,735,000 | 0.77 |
| 29 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス   | 小売業    | 606,400    | 5,692.49  | 3,451,931,027 | 5,975.00  | 3,623,240,000 | 0.73 |
| 30 | 日本 | 株式 | 日本たばこ産業           | 食料品    | 1,078,000  | 2,298.12  | 2,477,381,017 | 2,798.00  | 3,016,244,000 | 0.61 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内／国外 | 業種      | 投資比率(%) |
|----|-------|---------|---------|
| 株式 | 国内    | 水産・農林業  | 0.08    |
|    |       | 鉱業      | 0.29    |
|    |       | 建設業     | 1.90    |
|    |       | 食料品     | 3.43    |
|    |       | 繊維製品    | 0.46    |
|    |       | パルプ・紙   | 0.17    |
|    |       | 化学      | 6.12    |
|    |       | 医薬品     | 5.40    |
|    |       | 石油・石炭製品 | 0.44    |

|     |            |       |
|-----|------------|-------|
|     | ゴム製品       | 0.75  |
|     | ガラス・土石製品   | 0.70  |
|     | 鉄鋼         | 0.91  |
|     | 非鉄金属       | 0.71  |
|     | 金属製品       | 0.55  |
|     | 機械         | 5.25  |
|     | 電気機器       | 17.58 |
|     | 輸送用機器      | 7.24  |
|     | 精密機器       | 2.51  |
|     | その他製品      | 2.18  |
|     | 電気・ガス業     | 1.17  |
|     | 陸運業        | 2.87  |
|     | 海運業        | 0.59  |
|     | 空運業        | 0.47  |
|     | 倉庫・運輸関連業   | 0.14  |
|     | 情報・通信業     | 8.42  |
|     | 卸売業        | 6.00  |
|     | 小売業        | 4.40  |
|     | 銀行業        | 5.75  |
|     | 証券、商品先物取引業 | 0.72  |
|     | 保険業        | 2.08  |
|     | その他金融業     | 1.06  |
|     | 不動産業       | 1.79  |
|     | サービス業      | 4.92  |
| 合 計 |            | 97.19 |

（参考）国内債券マザーファンド

| 順位 | 国 / 地域 | 種類   | 銘柄名                              | 数量          | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 利率<br>（％） | 償還期限      | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|--------|------|----------------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------|-----------------|
| 1  | 日本     | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>（ 2 年 ）第 4 3<br>8 回   | 400,000,000 | 100.19          | 400,784,000     | 100.15          | 400,620,000     | 0.005     | 2024/7/1  | 1.81            |
| 2  | 日本     | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>（ 1 0 年 ）第 3<br>3 4 回 | 370,000,000 | 101.33          | 374,941,200     | 100.86          | 373,215,300     | 0.6       | 2024/6/20 | 1.68            |
| 3  | 日本     | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>（ 5 年 ）第 1 4<br>1 回   | 340,000,000 | 100.33          | 341,122,000     | 100.29          | 340,996,200     | 0.1       | 2024/9/20 | 1.54            |
| 4  | 日本     | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>（ 5 年 ）第 1 5<br>3 回   | 290,000,000 | 100.15          | 290,462,600     | 99.85           | 289,570,800     | 0.005     | 2027/6/20 | 1.30            |
| 5  | 日本     | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>（ 5 年 ）第 1 4<br>5 回   | 270,000,000 | 100.43          | 271,179,900     | 100.43          | 271,166,400     | 0.1       | 2025/9/20 | 1.22            |
| 6  | 日本     | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>（ 5 年 ）第 1 5<br>2 回   | 270,000,000 | 100.44          | 271,188,000     | 100.31          | 270,853,200     | 0.1       | 2027/3/20 | 1.22            |

|    |    |      |                                   |             |        |             |        |             |       |            |      |
|----|----|------|-----------------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-------|------------|------|
| 7  | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>4 6 回 | 270,000,000 | 100.41 | 271,112,400 | 100.31 | 270,853,200 | 0.1   | 2027/3/20  | 1.22 |
| 8  | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>4 5 回 | 240,000,000 | 100.43 | 241,048,800 | 100.37 | 240,890,400 | 0.1   | 2026/12/20 | 1.08 |
| 9  | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>6 5 回 | 240,000,000 | 97.62  | 234,292,000 | 98.05  | 235,322,400 | 0.1   | 2031/12/20 | 1.06 |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>4 2 回 | 230,000,000 | 100.44 | 231,018,900 | 100.45 | 231,055,700 | 0.1   | 2026/3/20  | 1.04 |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>4 7 回 | 220,000,000 | 100.41 | 220,922,800 | 100.25 | 220,554,400 | 0.1   | 2027/6/20  | 0.99 |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>5 0 回 | 220,000,000 | 100.11 | 220,242,000 | 100.02 | 220,052,800 | 0.1   | 2028/3/20  | 0.99 |
| 13 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>5 7 回 | 220,000,000 | 99.77  | 219,494,000 | 99.37  | 218,614,000 | 0.1   | 2029/12/20 | 0.98 |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>6 0 回 | 220,000,000 | 99.34  | 218,564,200 | 98.90  | 217,580,000 | 0.1   | 2030/9/20  | 0.98 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>6 1 回 | 220,000,000 | 98.60  | 216,941,500 | 98.64  | 217,008,000 | 0.1   | 2030/12/20 | 0.98 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>4 4 回 | 210,000,000 | 100.43 | 210,903,000 | 100.43 | 210,909,300 | 0.1   | 2026/9/20  | 0.95 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>5 9 回 | 210,000,000 | 99.19  | 208,319,400 | 99.07  | 208,061,700 | 0.1   | 2030/6/20  | 0.94 |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>6 9 回 | 200,000,000 | 100.63 | 201,261,300 | 101.69 | 203,390,000 | 0.5   | 2032/12/20 | 0.91 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>4 1 回 | 200,000,000 | 101.17 | 202,348,000 | 100.99 | 201,984,000 | 0.3   | 2025/12/20 | 0.91 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>3 5 回 | 200,000,000 | 101.27 | 202,552,000 | 100.88 | 201,760,000 | 0.5   | 2024/9/20  | 0.91 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>4 3 回 | 200,000,000 | 100.45 | 200,904,000 | 100.46 | 200,932,000 | 0.1   | 2026/6/20  | 0.90 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 5 年 ) 第 1 4<br>3 回   | 200,000,000 | 100.30 | 200,609,000 | 100.37 | 200,746,000 | 0.1   | 2025/3/20  | 0.90 |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>6 2 回 | 200,000,000 | 99.15  | 198,316,400 | 98.40  | 196,812,000 | 0.1   | 2031/3/20  | 0.88 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>6 3 回 | 200,000,000 | 98.78  | 197,560,000 | 98.19  | 196,398,000 | 0.1   | 2031/6/20  | 0.88 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>6 4 回 | 200,000,000 | 98.00  | 196,016,300 | 98.10  | 196,210,000 | 0.1   | 2031/9/20  | 0.88 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 5 年 ) 第 1 4<br>2 回   | 190,000,000 | 100.31 | 190,603,500 | 100.33 | 190,634,600 | 0.1   | 2024/12/20 | 0.86 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 5 年 ) 第 1 4<br>9 回   | 180,000,000 | 100.02 | 180,036,000 | 100.10 | 180,187,200 | 0.005 | 2026/9/20  | 0.81 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>4 9 回 | 180,000,000 | 100.22 | 180,397,000 | 100.09 | 180,167,400 | 0.1   | 2027/12/20 | 0.81 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>5 1 回 | 180,000,000 | 100.00 | 180,000,000 | 99.97  | 179,953,200 | 0.1   | 2028/6/20  | 0.81 |

|    |    |      |                                   |             |       |             |       |             |     |           |      |
|----|----|------|-----------------------------------|-------------|-------|-------------|-------|-------------|-----|-----------|------|
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付<br>( 1 0 年 ) 第 3<br>5 8 回 | 180,000,000 | 99.24 | 178,633,800 | 99.24 | 178,641,000 | 0.1 | 2030/3/20 | 0.80 |
|----|----|------|-----------------------------------|-------------|-------|-------------|-------|-------------|-----|-----------|------|

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 99.22   |
| 合 計  | 99.22   |

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

| 順位 | 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名                            | 業種                                          | 数量        | 簿価<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|----|--------------------------------|---------------------------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | アメリカ   | 株式 | APPLE INC                      | コン<br>ピュー<br>タ・周辺<br>機器                     | 3,530,400 | 23,109.71       | 81,586,546,828  | 21,679.93       | 76,538,827,696  | 5.13            |
| 2  | アメリカ   | 株式 | MICROSOFT CORP                 | ソフト<br>ウェア                                  | 1,571,600 | 40,730.91       | 64,012,701,983  | 37,929.19       | 59,609,525,219  | 3.99            |
| 3  | アメリカ   | 株式 | AMAZON.COM INC                 | 大規模小<br>売り                                  | 2,037,600 | 20,989.61       | 42,768,448,807  | 13,620.06       | 27,752,234,256  | 1.86            |
| 4  | アメリカ   | 株式 | NVIDIA CORP                    | 半導体・<br>半導体製<br>造装置                         | 545,940   | 34,836.90       | 19,018,859,741  | 36,564.51       | 19,962,033,994  | 1.33            |
| 5  | アメリカ   | 株式 | ALPHABET INC-CL A              | インタラ<br>クティ<br>ブ・メ<br>ディアお<br>よびサー<br>ビス    | 1,325,500 | 18,202.21       | 24,127,033,710  | 13,471.84       | 17,856,926,173  | 1.19            |
| 6  | アメリカ   | 株式 | ALPHABET INC-CL C              | インタラ<br>クティ<br>ブ・メ<br>ディアお<br>よびサー<br>ビス    | 1,215,600 | 18,323.91       | 22,274,551,656  | 13,529.25       | 16,446,167,970  | 1.10            |
| 7  | アメリカ   | 株式 | TESLA INC                      | 自動車                                         | 595,700   | 45,175.98       | 26,911,336,947  | 26,075.73       | 15,533,317,365  | 1.04            |
| 8  | アメリカ   | 株式 | META PLATFORMS INC-<br>CLASS A | インタラ<br>クティ<br>ブ・メ<br>ディアお<br>よびサー<br>ビス    | 499,000   | 29,176.19       | 14,558,921,766  | 27,752.87       | 13,848,684,725  | 0.92            |
| 9  | アメリカ   | 株式 | EXXON MOBIL CORP               | 石油・ガ<br>ス・消耗<br>燃料                          | 913,900   | 11,445.90       | 10,460,411,591  | 14,620.19       | 13,361,400,506  | 0.89            |
| 10 | アメリカ   | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP<br>INC      | ヘルスケ<br>ア・プロ<br>バイダー/<br>ヘルスケ<br>ア・サー<br>ビス | 207,370   | 69,199.35       | 14,349,870,923  | 62,767.11       | 13,016,015,974  | 0.87            |
| 11 | アメリカ   | 株式 | JOHNSON & JOHNSON              | 医薬品                                         | 580,200   | 23,795.46       | 13,806,129,769  | 20,487.50       | 11,886,852,084  | 0.79            |
| 12 | アメリカ   | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY<br>INC CL B | 金融サー<br>ビス                                  | 288,900   | 46,444.48       | 13,417,812,742  | 40,737.33       | 11,769,015,330  | 0.78            |
| 13 | アメリカ   | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO            | 銀行                                          | 650,900   | 18,423.81       | 11,992,060,771  | 17,191.98       | 11,190,264,664  | 0.75            |
| 14 | アメリカ   | 株式 | VISA INC-CLASS A<br>SHARES     | 金融サー<br>ビス                                  | 361,300   | 29,539.88       | 10,672,761,157  | 29,691.73       | 10,727,622,338  | 0.71            |
| 15 | アメリカ   | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO            | 家庭用品                                        | 525,900   | 20,383.21       | 10,719,530,141  | 19,688.99       | 10,354,444,311  | 0.69            |
| 16 | スイス    | 株式 | NESTLE SA-REG                  | 食品                                          | 610,300   | 17,433.20       | 10,639,485,449  | 16,185.75       | 9,878,168,352   | 0.66            |

|    |       |    |                                     |                   |           |           |               |            |               |      |
|----|-------|----|-------------------------------------|-------------------|-----------|-----------|---------------|------------|---------------|------|
| 17 | アメリカ  | 株式 | MASTERCARD INC                      | 金融サービス            | 190,500   | 47,837.81 | 9,113,103,417 | 47,971.98  | 9,138,663,676 | 0.61 |
| 18 | アメリカ  | 株式 | CHEVRON CORP                        | 石油・ガス・消耗燃料        | 407,700   | 22,015.41 | 8,975,683,452 | 21,683.93  | 8,840,540,993 | 0.59 |
| 19 | アメリカ  | 株式 | HOME DEPOT                          | 専門小売り             | 226,200   | 40,959.89 | 9,265,127,547 | 38,104.12  | 8,619,152,125 | 0.57 |
| 20 | アメリカ  | 株式 | ABBVIE INC                          | バイオテクノロジー         | 392,500   | 21,590.00 | 8,474,075,652 | 21,087.05  | 8,276,670,108 | 0.55 |
| 21 | アメリカ  | 株式 | ELI LILLY & CO.                     | 医薬品               | 179,200   | 39,382.19 | 7,057,289,690 | 45,492.33  | 8,152,226,557 | 0.54 |
| 22 | オランダ  | 株式 | ASML HOLDING NV                     | 半導体・半導体製造装置       | 89,460    | 88,205.86 | 7,890,896,944 | 90,885.56  | 8,130,622,555 | 0.54 |
| 23 | アメリカ  | 株式 | MERCK & CO INC                      | 医薬品               | 562,700   | 11,293.67 | 6,354,948,377 | 14,143.49  | 7,958,546,100 | 0.53 |
| 24 | アメリカ  | 株式 | BROADCOM INC                        | 半導体・半導体製造装置       | 92,540    | 82,423.43 | 7,627,464,965 | 84,624.63  | 7,831,163,954 | 0.52 |
| 25 | デンマーク | 株式 | NOVO NORDISK A/S-B                  | 医薬品               | 367,400   | 15,032.25 | 5,522,848,782 | 21,116.97  | 7,758,376,982 | 0.52 |
| 26 | アメリカ  | 株式 | COCA COLA CO                        | 飲料                | 911,700   | 8,291.09  | 7,558,993,716 | 8,258.83   | 7,529,575,767 | 0.50 |
| 27 | フランス  | 株式 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 繊維・アパレル・贅沢品       | 61,430    | 96,184.03 | 5,908,584,967 | 120,510.43 | 7,402,956,329 | 0.49 |
| 28 | アメリカ  | 株式 | PEPSICO INC                         | 飲料                | 305,700   | 22,502.54 | 6,879,026,562 | 24,146.22  | 7,381,502,480 | 0.49 |
| 29 | アメリカ  | 株式 | PFIZER INC                          | 医薬品               | 1,245,500 | 6,901.60  | 8,595,951,907 | 5,391.94   | 6,715,663,014 | 0.45 |
| 30 | 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 | 87,040    | 78,389.51 | 6,823,023,316 | 75,173.38  | 6,543,091,352 | 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 | 3.36    |
|    |         | メディア                 | 0.75    |
|    |         | 娯楽                   | 1.17    |
|    |         | 不動産管理・開発             | 0.30    |
|    |         | エネルギー設備・サービス         | 0.26    |
|    |         | 石油・ガス・消耗燃料           | 4.96    |
|    |         | 化学                   | 2.03    |
|    |         | 建設資材                 | 0.27    |
|    |         | 容器・包装                | 0.23    |
|    |         | 金属・鉱業                | 1.67    |
|    |         | 紙製品・林産品              | 0.09    |
|    |         | 航空宇宙・防衛              | 1.76    |
|    |         | 建設関連製品               | 0.57    |
|    |         | 建設・土木                | 0.31    |
|    |         | 電気設備                 | 0.87    |
|    |         | コングロマリット             | 0.93    |
|    |         | 機械                   | 1.85    |
|    |         | 商社・流通業               | 0.38    |

|                         |      |
|-------------------------|------|
| 商業サービス・用品               | 0.52 |
| 航空貨物・物流サービス             | 0.60 |
| 旅客航空輸送                  | 0.05 |
| 海上運輸                    | 0.06 |
| 陸上運輸                    | 0.99 |
| 運送インフラ                  | 0.11 |
| 自動車用部品                  | 0.19 |
| 自動車                     | 1.73 |
| 家庭用耐久財                  | 0.29 |
| レジャー用品                  | 0.01 |
| 繊維・アパレル・贅沢品             | 1.45 |
| ホテル・レストラン・レジャー          | 2.07 |
| 販売                      | 0.11 |
| 大規模小売り                  | 2.31 |
| 専門小売り                   | 1.60 |
| 生活必需品流通・小売り             | 1.82 |
| 飲料                      | 1.86 |
| 食品                      | 1.72 |
| タバコ                     | 0.64 |
| 家庭用品                    | 1.16 |
| パーソナルケア用品               | 0.65 |
| ヘルスケア機器・用品              | 2.39 |
| ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 2.17 |
| バイオテクノロジー               | 2.08 |
| 医薬品                     | 5.25 |
| 銀行                      | 5.40 |
| 金融サービス                  | 3.06 |
| 保険                      | 3.13 |
| 情報技術サービス                | 1.21 |
| ソフトウェア                  | 7.37 |
| 通信機器                    | 0.72 |
| コンピュータ・周辺機器             | 5.35 |
| 電子装置・機器・部品              | 0.54 |
| 半導体・半導体製造装置             | 5.25 |
| 各種電気通信サービス              | 1.15 |
| 無線通信サービス                | 0.27 |
| 電力                      | 1.85 |
| ガス                      | 0.13 |
| 総合公益事業                  | 0.82 |
| 水道                      | 0.11 |
| 消費者金融                   | 0.36 |
| 資本市場                    | 3.07 |

|      |   |                    |       |
|------|---|--------------------|-------|
|      |   | 各種消費者サービス          | 0.02  |
|      |   | 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       | 0.04  |
|      |   | ライフサイエンス・ツール/サービス  | 1.47  |
|      |   | 専門サービス             | 1.02  |
| 投資証券 | — | —                  | 2.12  |
| 合 計  |   |                    | 98.53 |

## （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<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 利率<br>（％） | 償還期限       | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|------|------|--------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 182,850,000 | 15,560.12       | 28,451,680,799  | 14,993.95       | 27,416,452,536  | 5.375     | 2031/2/15  | 3.90            |
| 2  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND         | 176,200,000 | 14,363.89       | 25,309,185,267  | 14,122.88       | 24,884,520,266  | 6         | 2026/2/15  | 3.54            |
| 3  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND         | 168,750,000 | 14,885.89       | 25,119,944,784  | 14,418.63       | 24,331,439,514  | 5.25      | 2028/11/15 | 3.46            |
| 4  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 86,200,000  | 15,979.33       | 13,774,187,348  | 15,552.85       | 13,406,559,576  | 6.25      | 2030/5/15  | 1.90            |
| 5  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 100,100,000 | 13,167.83       | 13,180,998,190  | 13,053.60       | 13,066,653,970  | 2.5       | 2024/5/15  | 1.85            |
| 6  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 67,500,000  | 12,964.92       | 8,751,326,695   | 12,641.27       | 8,532,860,232   | 2.375     | 2027/5/15  | 1.21            |
| 7  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND         | 63,000,000  | 13,216.38       | 8,326,321,024   | 12,989.44       | 8,183,349,222   | 2.375     | 2024/8/15  | 1.16            |
| 8  | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 44,050,000  | 19,127.53       | 8,425,679,836   | 17,042.24       | 7,507,109,116   | 4.75      | 2035/4/25  | 1.06            |
| 9  | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 49,850,000  | 14,207.15       | 7,082,264,351   | 14,397.13       | 7,176,972,296   | 3.4       | 2028/4/1   | 1.02            |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 60,100,000  | 11,852.49       | 7,123,351,895   | 11,811.92       | 7,098,968,487   | 1.125     | 2028/2/29  | 1.01            |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 53,600,000  | 13,213.73       | 7,082,560,468   | 12,830.61       | 6,877,210,150   | 2.875     | 2028/5/15  | 0.97            |
| 12 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 40,150,000  | 18,542.28       | 7,444,729,227   | 17,020.09       | 6,833,568,544   | 5.5       | 2029/4/25  | 0.97            |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 54,200,000  | 11,911.41       | 6,455,986,045   | 12,161.92       | 6,591,761,587   | 1.25      | 2026/12/31 | 0.93            |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 51,300,000  | 13,058.43       | 6,698,975,310   | 12,781.84       | 6,557,086,718   | 2.25      | 2025/11/15 | 0.93            |
| 15 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 45,000,000  | 14,338.17       | 6,452,179,960   | 14,557.42       | 6,550,842,600   | 3.85      | 2029/12/15 | 0.93            |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND         | 44,200,000  | 15,131.89       | 6,688,295,828   | 14,715.94       | 6,504,447,565   | 6.125     | 2027/11/15 | 0.92            |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 48,800,000  | 13,350.67       | 6,515,128,706   | 13,022.04       | 6,354,757,094   | 2.875     | 2025/4/30  | 0.90            |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 48,500,000  | 13,330.26       | 6,465,178,827   | 13,037.16       | 6,323,027,208   | 3         | 2025/9/30  | 0.89            |
| 19 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 32,050,000  | 19,610.10       | 6,285,038,684   | 18,091.73       | 5,798,401,213   | 5.75      | 2032/10/25 | 0.82            |
| 20 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 32,100,000  | 19,652.50       | 6,308,453,337   | 17,799.40       | 5,713,609,506   | 5.5       | 2031/1/4   | 0.81            |
| 21 | スペイン | 国債証券 | SPANISH GOVERNMENT       | 33,500,000  | 18,521.01       | 6,204,539,020   | 16,845.93       | 5,643,389,479   | 6         | 2029/1/31  | 0.80            |
| 22 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 37,100,000  | 16,035.61       | 5,949,213,828   | 14,891.85       | 5,524,878,353   | 3.5       | 2026/4/25  | 0.78            |
| 23 | スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 34,150,000  | 16,700.83       | 5,703,335,443   | 16,137.03       | 5,510,796,700   | 5.15      | 2028/10/31 | 0.78            |

|    |      |      |                                |            |           |               |           |               |       |            |      |
|----|------|------|--------------------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|------|
| 24 | イタリア | 国債証券 | BUONI<br>POLIENNALI DEL<br>TES | 35,100,000 | 15,825.75 | 5,554,840,863 | 15,024.89 | 5,273,739,114 | 5     | 2025/3/1   | 0.75 |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 49,700,000 | 11,284.32 | 5,608,310,951 | 10,480.54 | 5,208,828,394 | 2.5   | 2046/2/15  | 0.74 |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 44,800,000 | 12,284.73 | 5,503,560,688 | 11,524.26 | 5,162,870,236 | 3     | 2044/11/15 | 0.73 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 47,200,000 | 11,226.76 | 5,299,032,917 | 10,535.82 | 4,972,911,505 | 2.5   | 2045/2/15  | 0.70 |
| 28 | スペイン | 国債証券 | SPANISH<br>GOVERNMENT          | 27,950,000 | 19,408.44 | 5,424,660,881 | 17,460.17 | 4,880,117,627 | 5.75  | 2032/7/30  | 0.69 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 37,350,000 | 12,476.51 | 4,659,978,577 | 12,606.32 | 4,708,463,115 | 2.625 | 2029/2/15  | 0.67 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B                | 36,750,000 | 12,953.18 | 4,760,297,296 | 12,742.72 | 4,682,951,500 | 2     | 2025/8/15  | 0.66 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.65   |
| 合 計  | 98.65   |

## （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<br>単価<br>(円) | 簿価<br>金額<br>(円) | 評価<br>単価<br>(円) | 評価<br>金額<br>(円) | 投資<br>比率<br>(%) |
|----|--------|--------------|-----------------------------------|----------------------------------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 台湾     | 株式           | TAIWAN SEMICONDUCTOR              | 半導体・半<br>導体製造装<br>置              | 2,383,000 | 2,259.07        | 5,383,386,651   | 2,342.76        | 5,582,808,995   | 6.28            |
| 2  | 香港     | 株式           | TENCENT HOLDINGS LTD              | インタラク<br>ティブ・メ<br>ディアおよ<br>びサービス | 603,100   | 5,614.75        | 3,386,257,248   | 6,548.85        | 3,949,611,435   | 4.44            |
| 3  | アメリカ   | 投資信託受<br>益証券 | ISHARES MSCI CHINA A<br>UCITS ETF | —                                | 5,517,100 | 634.33          | 3,499,712,274   | 665.11          | 3,669,494,546   | 4.13            |
| 4  | 韓国     | 株式           | SAMSUNG ELECTRONICS               | コンピュ<br>ータ・周辺機<br>器              | 460,750   | 6,701.67        | 3,087,795,092   | 6,515.92        | 3,002,210,140   | 3.38            |
| 5  | 香港     | 株式           | ALIBABA GROUP<br>HOLDING LIMITED  | 大規模小売<br>り                       | 1,430,380 | 1,562.41        | 2,234,844,877   | 1,648.26        | 2,357,651,012   | 2.65            |
| 6  | 香港     | 株式           | MEITUAN-CLASS B                   | ホテル・レ<br>ストラン・<br>レジャー           | 485,540   | 2,784.69        | 1,352,080,797   | 2,415.42        | 1,172,783,027   | 1.32            |
| 7  | インド    | 株式           | RELIANCE INDUSTRIES<br>LIMITED    | 石油・ガ<br>ス・消耗燃<br>料               | 293,700   | 4,153.94        | 1,220,012,548   | 3,664.90        | 1,076,383,480   | 1.21            |
| 8  | 香港     | 株式           | CHINA CONSTRUCTION<br>BANK-H      | 銀行                               | 9,278,000 | 92.04           | 853,975,706     | 86.24           | 800,141,215     | 0.90            |
| 9  | ブラジル   | 株式           | VALE SA                           | 金属・鉱業                            | 369,052   | 2,021.15        | 745,909,463     | 2,142.71        | 790,771,537     | 0.89            |

|    |             |    |                                 |                                  |           |           |             |           |             |      |
|----|-------------|----|---------------------------------|----------------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 10 | インド         | 株式 | INFOSYS LTD                     | 情報技術<br>サービス                     | 324,800   | 2,557.42  | 830,651,317 | 2,269.02  | 736,978,346 | 0.83 |
| 11 | インド         | 株式 | HOUSING DEVELOPMENT<br>FINANCE  | 金融サービ<br>ス                       | 166,400   | 3,649.33  | 607,249,554 | 4,269.00  | 710,361,933 | 0.80 |
| 12 | インド         | 株式 | ICICI BANK LTD                  | 銀行                               | 497,000   | 1,205.72  | 599,246,515 | 1,395.64  | 693,633,080 | 0.78 |
| 13 | 香港          | 株式 | JD.COM, INC.                    | 大規模小売<br>り                       | 208,067   | 3,890.49  | 809,483,024 | 2,776.03  | 577,600,650 | 0.65 |
| 14 | 台湾          | 株式 | HON HAI PRECISION<br>INDUSTRY   | 電子装置・<br>機器・部品                   | 1,204,649 | 455.72    | 548,984,620 | 457.60    | 551,254,008 | 0.62 |
| 15 | 香港          | 株式 | BAIDU INC-CLASS A               | インタラク<br>ティブ・メ<br>ディアおよ<br>びサービス | 212,760   | 1,858.73  | 395,464,297 | 2,542.99  | 541,047,616 | 0.60 |
| 16 | 香港          | 株式 | PING AN INSURANCE<br>GROUP CO-H | 保険                               | 610,500   | 838.82    | 512,104,315 | 864.10    | 527,537,934 | 0.59 |
| 17 | 南アフリ<br>カ   | 株式 | NASPERS LTD-N SHS               | 大規模小売<br>り                       | 21,020    | 12,510.60 | 262,972,838 | 24,848.52 | 522,315,983 | 0.58 |
| 18 | サウジア<br>ラビア | 株式 | AL RAJHI BANK                   | 銀行                               | 192,000   | 3,813.02  | 732,100,103 | 2,618.80  | 502,810,560 | 0.56 |
| 19 | 台湾          | 株式 | MEDIATEK INC                    | 半導体・半<br>導体製造装<br>置              | 146,538   | 3,414.79  | 500,396,866 | 3,406.86  | 499,234,744 | 0.56 |
| 20 | アメリカ        | 株式 | PDD HOLDINGS INC ADR            | 大規模小売<br>り                       | 48,790    | 5,879.72  | 286,871,651 | 10,207.03 | 498,001,150 | 0.56 |
| 21 | 韓国          | 株式 | SK HYNIX INC                    | 半導体・半<br>導体製造装<br>置              | 52,680    | 10,763.24 | 567,007,756 | 9,155.27  | 482,300,150 | 0.54 |
| 22 | インド         | 株式 | TATA CONSULTANCY SVS<br>LTD     | 情報技術<br>サービス                     | 88,300    | 5,602.62  | 494,711,861 | 5,147.79  | 454,550,387 | 0.51 |
| 23 | 香港          | 株式 | NETEASE, INC.                   | 娯楽                               | 190,150   | 2,383.19  | 453,163,694 | 2,311.65  | 439,561,959 | 0.49 |
| 24 | 韓国          | 株式 | SAMSUNG ELECTRONICS<br>PFD      | コンピュ<br>ータ・周辺機<br>器              | 79,400    | 6,008.39  | 477,066,310 | 5,505.54  | 437,139,876 | 0.49 |
| 25 | インドネ<br>シア  | 株式 | BANK CENTRAL ASIA               | 銀行                               | 5,320,000 | 68.36     | 363,675,933 | 78.54     | 417,846,100 | 0.47 |
| 26 | 香港          | 株式 | IND & COMM BK OF<br>CHINA-H     | 銀行                               | 5,440,000 | 76.45     | 415,936,441 | 72.63     | 395,121,888 | 0.44 |
| 27 | 韓国          | 株式 | SAMSUNG SDI CO,LTD              | 電子装置・<br>機器・部品                   | 5,307     | 61,214.60 | 324,865,920 | 74,335.10 | 394,496,376 | 0.44 |
| 28 | 香港          | 株式 | BANK OF CHINA LTD-H             | 銀行                               | 7,660,000 | 51.10     | 391,465,078 | 51.37     | 393,495,732 | 0.44 |
| 29 | メキシコ        | 株式 | AMERICA MOVIL SAB DE<br>CV      | 無線通信<br>サービス                     | 2,678,000 | 135.64    | 363,269,150 | 142.64    | 382,014,611 | 0.43 |

|    |             |    |                            |    |         |          |             |          |             |      |
|----|-------------|----|----------------------------|----|---------|----------|-------------|----------|-------------|------|
| 30 | サウジア<br>ラビア | 株式 | THE SAUDI NATIONAL<br>BANK | 銀行 | 216,500 | 2,662.76 | 576,488,396 | 1,633.63 | 353,682,086 | 0.39 |
|----|-------------|----|----------------------------|----|---------|----------|-------------|----------|-------------|------|

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内 / 国外 | 業種                   | 投資比率 (%) |
|----|---------|----------------------|----------|
| 株式 | 国外      | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 5.94     |
|    |         | メディア                 | 0.16     |
|    |         | 娯楽                   | 1.03     |
|    |         | 不動産管理・開発             | 1.66     |
|    |         | エネルギー設備・サービス         | 0.05     |
|    |         | 石油・ガス・消耗燃料           | 4.27     |
|    |         | 化学                   | 2.72     |
|    |         | 建設資材                 | 0.92     |
|    |         | 容器・包装                | 0.06     |
|    |         | 金属・鉱業                | 3.80     |
|    |         | 紙製品・林産品              | 0.14     |
|    |         | 航空宇宙・防衛              | 0.13     |
|    |         | 建設関連製品               | 0.01     |
|    |         | 建設・土木                | 0.50     |
|    |         | 電気設備                 | 0.88     |
|    |         | コングロマリット             | 1.08     |
|    |         | 機械                   | 0.37     |
|    |         | 商社・流通業               | 0.07     |
|    |         | 商業サービス・用品            | 0.05     |
|    |         | 航空貨物・物流サービス          | 0.24     |
|    |         | 旅客航空輸送               | 0.23     |
|    |         | 海上運輸                 | 0.38     |
|    |         | 陸上運輸                 | 0.23     |
|    |         | 運送インフラ               | 0.74     |
|    |         | 自動車用部品               | 0.46     |
|    |         | 自動車                  | 2.51     |
|    |         | 家庭用耐久財               | 0.29     |
|    |         | レジャー用品               | 0.02     |
|    |         | 繊維・アパレル・贅沢品          | 1.08     |
|    |         | ホテル・レストラン・レジャー       | 2.57     |

|          |   |                         |       |
|----------|---|-------------------------|-------|
|          |   | 大規模小売り                  | 4.82  |
|          |   | 専門小売り                   | 0.73  |
|          |   | 生活必需品流通・小売り             | 1.49  |
|          |   | 飲料                      | 1.19  |
|          |   | 食品                      | 1.59  |
|          |   | タバコ                     | 0.34  |
|          |   | 家庭用品                    | 0.08  |
|          |   | パーソナルケア用品               | 0.72  |
|          |   | ヘルスケア機器・用品              | 0.14  |
|          |   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 0.71  |
|          |   | バイオテクノロジー               | 0.58  |
|          |   | 医薬品                     | 1.01  |
|          |   | 銀行                      | 14.03 |
|          |   | 金融サービス                  | 1.51  |
|          |   | 保険                      | 2.41  |
|          |   | 情報技術サービス                | 2.01  |
|          |   | ソフトウェア                  | 0.17  |
|          |   | 通信機器                    | 0.13  |
|          |   | コンピュータ・周辺機器             | 5.02  |
|          |   | 電子装置・機器・部品              | 2.55  |
|          |   | 半導体・半導体製造装置             | 8.81  |
|          |   | 各種電気通信サービス              | 1.27  |
|          |   | 無線通信サービス                | 1.58  |
|          |   | 電力                      | 0.98  |
|          |   | ガス                      | 0.50  |
|          |   | 総合公益事業                  | 0.02  |
|          |   | 水道                      | 0.11  |
|          |   | 消費者金融                   | 0.54  |
|          |   | 資本市場                    | 0.64  |
|          |   | 各種消費者サービス               | 0.15  |
|          |   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      | 0.71  |
|          |   | ライフサイエンス・ツール/サービス       | 0.67  |
|          |   | その他の業種                  | 0.00  |
| 投資信託受益証券 | — | —                       | 4.13  |
| 投資証券     | — | —                       | 0.11  |
| 合 計      |   |                         | 94.36 |

## （参考）新興国債券マザーファンド

| 順位 | 国／地域 | 種類   | 銘柄名                            | 数量         | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 利率<br>（％） | 償還期限       | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|------|------|--------------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | アメリカ | 国債証券 | SAUDI<br>INTERNATIONAL<br>BOND | 4,100,000  | 13,432.14       | 550,717,779     | 13,346.59       | 547,210,213     | 4.375     | 2029/4/16  | 1.86            |
| 2  | アメリカ | 国債証券 | STATE OF QATAR                 | 3,800,000  | 13,384.55       | 508,613,233     | 13,127.66       | 498,851,389     | 4.817     | 2049/3/14  | 1.70            |
| 3  | アメリカ | 国債証券 | STATE OF QATAR                 | 3,400,000  | 14,245.85       | 484,358,977     | 13,606.10       | 462,607,607     | 5.103     | 2048/4/23  | 1.57            |
| 4  | アメリカ | 国債証券 | OMAN GOV<br>INTERNTL BOND      | 3,300,000  | 13,182.74       | 435,030,726     | 13,446.97       | 443,750,288     | 6         | 2029/8/1   | 1.51            |
| 5  | アメリカ | 国債証券 | FED REPUBLIC OF<br>BRAZIL      | 3,700,000  | 11,503.18       | 425,617,929     | 11,933.55       | 441,541,377     | 3.875     | 2030/6/12  | 1.50            |
| 6  | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>TURKEY          | 2,700,000  | 13,821.64       | 373,184,436     | 13,964.23       | 377,034,306     | 9.875     | 2028/1/15  | 1.28            |
| 7  | アメリカ | 国債証券 | STATE OF QATAR                 | 3,000,000  | 12,650.67       | 379,520,301     | 12,364.87       | 370,946,340     | 4.4       | 2050/4/16  | 1.26            |
| 8  | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>TURKEY          | 2,800,000  | 12,634.32       | 353,761,030     | 12,915.28       | 361,628,083     | 6.375     | 2025/10/14 | 1.23            |
| 9  | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>ARGENTINA       | 10,237,686 | 3,660.41        | 374,741,547     | 3,447.59        | 352,953,545     | 1.5       | 2035/7/9   | 1.20            |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | SAUDI<br>INTERNATIONAL<br>BOND | 2,400,000  | 13,771.28       | 330,510,786     | 14,277.00       | 342,648,022     | 5.5       | 2032/10/25 | 1.16            |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | ABU DHABI GOVT<br>INT'L        | 3,000,000  | 11,508.01       | 345,240,478     | 11,392.49       | 341,774,974     | 3.875     | 2050/4/16  | 1.16            |
| 12 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>PERU            | 3,000,000  | 11,334.02       | 340,020,792     | 11,392.48       | 341,774,575     | 2.783     | 2031/1/23  | 1.16            |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | FED REPUBLIC OF<br>BRAZIL      | 3,400,000  | 9,717.52        | 330,395,949     | 9,836.86        | 334,453,376     | 4.75      | 2050/1/14  | 1.14            |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>ECUADOR         | 7,500,000  | 6,715.72        | 503,679,166     | 4,332.45        | 324,933,771     | 2.5       | 2035/7/31  | 1.10            |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>PANAMA          | 3,200,000  | 10,577.02       | 338,464,900     | 9,856.80        | 315,417,857     | 4.5       | 2056/4/1   | 1.07            |
| 16 | アメリカ | 国債証券 | OMAN GOV<br>INTERNTL BOND      | 2,300,000  | 13,441.12       | 309,145,986     | 13,594.88       | 312,682,461     | 6.25      | 2031/1/25  | 1.06            |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | ABU DHABI GOVT<br>INT'L        | 2,400,000  | 12,669.03       | 304,056,757     | 12,582.59       | 301,982,369     | 3.125     | 2030/4/16  | 1.03            |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | CHINA GOVT INTL<br>BOND        | 2,400,000  | 12,178.00       | 292,272,066     | 12,195.09       | 292,682,270     | 0.55      | 2025/10/21 | 0.99            |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>TURKEY          | 2,100,000  | 13,236.82       | 277,973,407     | 13,634.28       | 286,319,900     | 9.375     | 2033/1/19  | 0.97            |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | CHINA GOVT INTL<br>BOND        | 2,200,000  | 12,940.39       | 284,688,630     | 12,877.38       | 283,302,378     | 1.95      | 2024/12/3  | 0.96            |
| 21 | アメリカ | 国債証券 | DOMINICAN<br>REPUBLIC          | 2,300,000  | 11,721.26       | 269,589,058     | 12,213.55       | 280,911,860     | 6         | 2033/2/22  | 0.95            |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>CHILE           | 2,400,000  | 12,172.46       | 292,139,070     | 11,698.96       | 280,775,197     | 4.34      | 2042/3/7   | 0.95            |
| 23 | アメリカ | 国債証券 | SAUDI<br>INTERNATIONAL<br>BOND | 2,100,000  | 13,541.72       | 284,376,170     | 13,358.67       | 280,532,175     | 4.5       | 2030/4/17  | 0.95            |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF<br>TURKEY          | 2,100,000  | 13,082.13       | 274,724,889     | 13,288.10       | 279,050,193     | 6.35      | 2024/8/10  | 0.95            |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | STATE OF QATAR                 | 2,100,000  | 13,502.55       | 283,553,626     | 13,279.39       | 278,867,364     | 4         | 2029/3/14  | 0.95            |
| 26 | アメリカ | 国債証券 | UNITED MEXICAN<br>STATES       | 2,200,000  | 12,661.52       | 278,553,595     | 12,668.84       | 278,714,576     | 4.875     | 2033/5/19  | 0.95            |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | REPUBLICA<br>ORIENT URUGUAY    | 2,100,000  | 13,499.31       | 283,485,525     | 13,093.76       | 274,968,978     | 4.975     | 2055/4/20  | 0.93            |

|    |      |      |                          |           |           |             |           |             |       |            |      |
|----|------|------|--------------------------|-----------|-----------|-------------|-----------|-------------|-------|------------|------|
| 28 | アメリカ | 国債証券 | SAUDI INTERNATIONAL BOND | 2,200,000 | 13,030.16 | 286,663,539 | 12,494.56 | 274,880,371 | 5     | 2049/4/17  | 0.93 |
| 29 | アメリカ | 国債証券 | SAUDI INTERNATIONAL BOND | 2,100,000 | 13,044.41 | 273,932,789 | 12,867.05 | 270,208,210 | 2.9   | 2025/10/22 | 0.92 |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | ABU DHABI GOVT INT'L     | 2,100,000 | 12,900.07 | 270,901,658 | 12,866.95 | 270,205,967 | 2.125 | 2024/9/30  | 0.92 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.19   |
| 合 計  | 98.19   |

（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<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 利率<br>（%） | 償還期限       | 投資<br>比率<br>（%） |
|----|--------|------|--------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1  | ブラジル   | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL   | 9,900,000  | 1,858.44        | 183,985,832     | 1,885.24        | 186,639,619     | —         | 2026/1/1   | 2.10            |
| 2  | 中国     | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND    | 8,000,000  | 1,945.91        | 155,673,124     | 1,945.06        | 155,605,301     | 2.47      | 2024/9/2   | 1.75            |
| 3  | 中国     | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND    | 7,800,000  | 1,947.79        | 151,927,656     | 1,948.36        | 151,972,711     | 2.69      | 2026/8/12  | 1.71            |
| 4  | ブラジル   | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL   | 6,400,000  | 2,356.32        | 150,804,506     | 2,357.00        | 150,848,463     | —         | 2024/1/1   | 1.70            |
| 5  | ブラジル   | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL   | 6,400,000  | 2,225.86        | 142,455,620     | 2,240.00        | 143,360,397     | —         | 2024/7/1   | 1.61            |
| 6  | 南アフリカ  | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 20,800,000 | 642.62          | 133,665,567     | 650.24          | 135,250,825     | 8.25      | 2032/3/31  | 1.52            |
| 7  | 中国     | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND    | 6,900,000  | 1,957.39        | 135,060,569     | 1,959.34        | 135,194,584     | 2.91      | 2028/10/14 | 1.52            |
| 8  | ポーランド  | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND   | 4,800,000  | 2,518.18        | 120,872,827     | 2,583.17        | 123,992,271     | 2.75      | 2029/10/25 | 1.39            |
| 9  | 南アフリカ  | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 15,300,000 | 794.95          | 121,627,526     | 796.67          | 121,891,099     | 10.5      | 2026/12/21 | 1.37            |
| 10 | 南アフリカ  | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 17,400,000 | 671.79          | 116,892,647     | 680.03          | 118,326,233     | 8         | 2030/1/31  | 1.33            |
| 11 | 中国     | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND    | 6,000,000  | 1,967.16        | 118,029,957     | 1,970.30        | 118,218,476     | 3.02      | 2031/5/27  | 1.33            |
| 12 | メキシコ   | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 16,100,000 | 685.50          | 110,366,401     | 687.55          | 110,695,794     | 7.75      | 2031/5/29  | 1.24            |
| 13 | メキシコ   | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 14,100,000 | 732.30          | 103,255,065     | 731.63          | 103,160,598     | 10        | 2024/12/5  | 1.16            |
| 14 | ブラジル   | 国債証券 | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 391,000    | 2,548.10        | 99,633,927      | 2,603.48        | 101,796,263     | 10        | 2025/1/1   | 1.14            |
| 15 | 南アフリカ  | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 17,700,000 | 581.44          | 102,916,419     | 573.35          | 101,484,631     | 8.75      | 2048/2/28  | 1.14            |
| 16 | ポーランド  | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND   | 3,200,000  | 3,079.29        | 98,537,512      | 3,080.56        | 98,578,207      | 4         | 2023/10/25 | 1.11            |
| 17 | メキシコ   | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 14,500,000 | 657.48          | 95,335,168      | 663.85          | 96,258,299      | 5.75      | 2026/3/5   | 1.08            |
| 18 | ブラジル   | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL   | 4,700,000  | 1,984.62        | 93,277,145      | 2,006.38        | 94,300,007      | —         | 2025/7/1   | 1.06            |
| 19 | メキシコ   | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 12,900,000 | 707.34          | 91,247,929      | 711.08          | 91,729,377      | 8         | 2024/9/5   | 1.03            |

|    |       |      |                          |            |          |            |          |            |       |            |      |
|----|-------|------|--------------------------|------------|----------|------------|----------|------------|-------|------------|------|
| 20 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND   | 3,100,000  | 2,921.64 | 90,570,900 | 2,945.50 | 91,310,664 | 2.25  | 2024/10/25 | 1.02 |
| 21 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIA GOVERNMENT      | 2,850,000  | 3,058.91 | 87,179,135 | 3,069.77 | 87,488,653 | 3.899 | 2027/11/16 | 0.98 |
| 22 | チェコ   | 国債証券 | CZECH REPUBLIC           | 14,000,000 | 594.68   | 83,255,293 | 600.74   | 84,104,754 | 0.45  | 2023/10/25 | 0.94 |
| 23 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 2,500,000  | 3,026.75 | 75,668,769 | 3,035.63 | 75,890,875 | 3.733 | 2028/6/15  | 0.85 |
| 24 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND   | 3,400,000  | 2,132.61 | 72,508,983 | 2,209.60 | 75,126,598 | 1.75  | 2032/4/25  | 0.84 |
| 25 | メキシコ  | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10,300,000 | 718.45   | 74,001,261 | 722.37   | 74,405,087 | 8.5   | 2029/5/31  | 0.83 |
| 26 | マレーシア | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 2,400,000  | 3,059.57 | 73,429,834 | 3,071.42 | 73,714,200 | 3.9   | 2026/11/30 | 0.83 |
| 27 | タイ    | 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 17,500,000 | 401.45   | 70,254,940 | 404.75   | 70,832,024 | 2.65  | 2028/6/17  | 0.79 |
| 28 | 南アフリカ | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10,900,000 | 637.21   | 69,456,081 | 639.38   | 69,692,840 | 8.875 | 2035/2/28  | 0.78 |
| 29 | メキシコ  | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10,600,000 | 662.86   | 70,263,277 | 653.35   | 69,255,222 | 8     | 2047/11/7  | 0.78 |
| 30 | ポーランド | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND   | 2,700,000  | 2,515.37 | 67,915,224 | 2,558.70 | 69,085,015 | 0.25  | 2026/10/25 | 0.77 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.56   |
| 合 計  | 97.56   |

## （参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

| 順位 | 国／地域 | 種類   | 銘柄名                    | 数量     | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|------|------|------------------------|--------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 日本   | 投資証券 | 日本ビルファンド投資法人 投資証券      | 5,109  | 700,263         | 3,577,645,487   | 551,000         | 2,815,059,000   | 6.22            |
| 2  | 日本   | 投資証券 | ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券  | 4,379  | 637,206         | 2,790,328,233   | 528,000         | 2,312,112,000   | 5.11            |
| 3  | 日本   | 投資証券 | 日本都市ファンド投資法人 投資証券      | 22,097 | 105,668         | 2,334,958,153   | 96,700          | 2,136,779,900   | 4.72            |
| 4  | 日本   | 投資証券 | 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券 | 14,162 | 168,068         | 2,380,179,371   | 148,500         | 2,103,057,000   | 4.65            |
| 5  | 日本   | 投資証券 | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券    | 7,382  | 343,635         | 2,536,715,695   | 280,300         | 2,069,174,600   | 4.57            |
| 6  | 日本   | 投資証券 | G L P投資法人 投資証券         | 14,135 | 164,231         | 2,321,408,504   | 143,100         | 2,022,718,500   | 4.47            |
| 7  | 日本   | 投資証券 | 大和ハウスリート投資法人 投資証券      | 6,601  | 314,409         | 2,075,417,568   | 271,500         | 1,792,171,500   | 3.96            |
| 8  | 日本   | 投資証券 | オリックス不動産投資法人 投資証券      | 8,726  | 186,414         | 1,626,653,350   | 168,000         | 1,465,968,000   | 3.24            |
| 9  | 日本   | 投資証券 | ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券   | 9,797  | 146,712         | 1,437,340,523   | 143,000         | 1,400,971,000   | 3.09            |
| 10 | 日本   | 投資証券 | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券   | 4,379  | 355,142         | 1,555,168,034   | 316,500         | 1,385,953,500   | 3.06            |
| 11 | 日本   | 投資証券 | インヴィンシブル投資法人 投資証券      | 19,276 | 42,722          | 823,527,066     | 55,700          | 1,073,673,200   | 2.37            |
| 12 | 日本   | 投資証券 | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券  | 14,123 | 67,465          | 952,817,711     | 75,100          | 1,060,637,300   | 2.34            |
| 13 | 日本   | 投資証券 | 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券   | 2,995  | 407,744         | 1,221,194,109   | 349,000         | 1,045,255,000   | 2.31            |

|    |    |      |                              |        |         |               |         |             |      |
|----|----|------|------------------------------|--------|---------|---------------|---------|-------------|------|
| 14 | 日本 | 投資証券 | 産業ファンド投資法人 投資証券              | 6,682  | 179,569 | 1,199,880,742 | 144,200 | 963,544,400 | 2.13 |
| 15 | 日本 | 投資証券 | 積水ハウス・リート投資法人 投資証券           | 13,160 | 78,885  | 1,038,139,244 | 71,900  | 946,204,000 | 2.09 |
| 16 | 日本 | 投資証券 | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券      | 1,512  | 663,462 | 1,003,155,963 | 597,000 | 902,664,000 | 1.99 |
| 17 | 日本 | 投資証券 | アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券      | 2,312  | 417,467 | 965,184,003   | 378,000 | 873,936,000 | 1.93 |
| 18 | 日本 | 投資証券 | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券       | 2,953  | 322,748 | 953,076,983   | 294,500 | 869,658,500 | 1.92 |
| 19 | 日本 | 投資証券 | ラサールロジポート投資法人 投資証券           | 5,361  | 175,100 | 938,713,919   | 153,700 | 823,985,700 | 1.82 |
| 20 | 日本 | 投資証券 | 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券     | 1,730  | 539,377 | 933,122,446   | 465,000 | 804,450,000 | 1.77 |
| 21 | 日本 | 投資証券 | ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券         | 2,548  | 331,180 | 843,847,860   | 306,500 | 780,962,000 | 1.72 |
| 22 | 日本 | 投資証券 | フロンティア不動産投資法人 投資証券           | 1,625  | 528,189 | 858,307,783   | 475,000 | 771,875,000 | 1.70 |
| 23 | 日本 | 投資証券 | 森ヒルズリート投資法人 投資証券             | 5,150  | 152,118 | 783,412,138   | 147,600 | 760,140,000 | 1.68 |
| 24 | 日本 | 投資証券 | イオンリート投資法人 投資証券              | 5,028  | 152,556 | 767,053,823   | 144,900 | 728,557,200 | 1.61 |
| 25 | 日本 | 投資証券 | 大和証券リビング投資法人 投資証券            | 6,069  | 116,326 | 705,987,854   | 108,900 | 660,914,100 | 1.46 |
| 26 | 日本 | 投資証券 | コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券      | 2,094  | 329,693 | 690,378,568   | 315,500 | 660,657,000 | 1.46 |
| 27 | 日本 | 投資証券 | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券 | 3,212  | 213,199 | 684,797,256   | 204,800 | 657,817,600 | 1.45 |
| 28 | 日本 | 投資証券 | ヒューリックリート投資法人 投資証券           | 4,097  | 161,282 | 660,776,106   | 149,600 | 612,911,200 | 1.35 |
| 29 | 日本 | 投資証券 | 三菱地所物流リート投資法人 投資証券           | 1,505  | 453,292 | 682,205,751   | 390,500 | 587,702,500 | 1.30 |
| 30 | 日本 | 投資証券 | N T T都市開発リート投資法人             | 4,210  | 148,392 | 624,730,325   | 134,900 | 567,929,000 | 1.25 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 97.14   |
| 合 計  | 97.14   |

## （参考）海外REITインデックス マザーファンド

| 順位 | 国／地域    | 種類   | 銘柄名                       | 数量      | 簿価単価（円）   | 簿価金額（円）       | 評価単価（円）   | 評価金額（円）       | 投資比率（%） |
|----|---------|------|---------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|---------|
| 1  | アメリカ    | 投資証券 | PROLOGIS INC              | 307,020 | 15,864.24 | 4,870,639,479 | 16,279.97 | 4,998,278,723 | 8.92    |
| 2  | アメリカ    | 投資証券 | EQUINIX INC               | 30,780  | 87,365.16 | 2,689,099,646 | 93,739.39 | 2,885,298,587 | 5.15    |
| 3  | アメリカ    | 投資証券 | PUBLIC STORAGE            | 52,580  | 41,234.04 | 2,168,086,070 | 39,343.27 | 2,068,669,620 | 3.69    |
| 4  | アメリカ    | 投資証券 | REALTY INCOME CORP        | 208,590 | 8,775.65  | 1,830,512,910 | 8,360.31  | 1,743,877,751 | 3.11    |
| 5  | アメリカ    | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC  | 108,740 | 13,872.55 | 1,508,501,136 | 14,362.48 | 1,561,776,815 | 2.78    |
| 6  | アメリカ    | 投資証券 | WELLTOWER INC             | 157,160 | 10,740.43 | 1,687,966,230 | 9,473.95  | 1,488,926,532 | 2.65    |
| 7  | アメリカ    | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC       | 333,800 | 4,101.86  | 1,369,204,068 | 4,247.58  | 1,417,845,308 | 2.53    |
| 8  | アメリカ    | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC  | 95,630  | 17,208.16 | 1,645,616,856 | 12,481.04 | 1,193,562,725 | 2.13    |
| 9  | アメリカ    | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 46,480  | 25,788.65 | 1,198,656,628 | 21,800.10 | 1,013,269,011 | 1.80    |
| 10 | オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP             | 568,500 | 1,695.01  | 963,616,793   | 1,673.61  | 951,450,355   | 1.69    |
| 11 | アメリカ    | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC   | 44,500  | 22,675.78 | 1,009,072,217 | 21,208.56 | 943,781,361   | 1.68    |

|    |      |      |                               |         |           |               |           |             |      |
|----|------|------|-------------------------------|---------|-----------|---------------|-----------|-------------|------|
| 12 | アメリカ | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL            | 113,280 | 9,517.35  | 1,078,125,987 | 7,815.51  | 885,341,075 | 1.58 |
| 13 | アメリカ | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT  | 52,390  | 19,732.74 | 1,033,798,594 | 16,555.04 | 867,319,038 | 1.54 |
| 14 | アメリカ | 投資証券 | INVITATION HOMES INC          | 193,100 | 4,817.46  | 930,252,368   | 4,099.37  | 791,588,540 | 1.41 |
| 15 | アメリカ | 投資証券 | VENTAS INC                    | 132,950 | 6,931.91  | 921,598,008   | 5,936.74  | 789,290,088 | 1.40 |
| 16 | アメリカ | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC           | 41,180  | 20,761.96 | 854,977,902   | 18,610.07 | 766,362,934 | 1.36 |
| 17 | アメリカ | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM    | 38,390  | 22,390.16 | 859,558,315   | 19,826.53 | 761,140,656 | 1.35 |
| 18 | アメリカ | 投資証券 | WP CAREY INC                  | 70,050  | 10,844.66 | 759,668,647   | 10,295.16 | 721,176,168 | 1.28 |
| 19 | 香港   | 投資証券 | LINK REIT                     | 841,100 | 1,083.68  | 911,485,267   | 857.30    | 721,078,394 | 1.28 |
| 20 | アメリカ | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC             | 96,660  | 6,907.15  | 667,645,567   | 6,915.51  | 668,454,038 | 1.19 |
| 21 | アメリカ | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC      | 21,490  | 35,595.20 | 764,940,920   | 27,264.15 | 585,906,700 | 1.04 |
| 22 | アメリカ | 投資証券 | GAMING AND LEISURE PROPERTIE  | 85,650  | 6,288.05  | 538,571,716   | 6,798.01  | 582,249,753 | 1.03 |
| 23 | アメリカ | 投資証券 | UDR INC                       | 102,900 | 5,965.52  | 613,852,499   | 5,325.17  | 547,960,652 | 0.97 |
| 24 | アメリカ | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC     | 181,900 | 3,425.31  | 623,065,134   | 2,896.26  | 526,830,731 | 0.94 |
| 25 | アメリカ | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP             | 206,400 | 2,818.18  | 581,673,771   | 2,511.69  | 518,414,735 | 0.92 |
| 26 | アメリカ | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES   | 58,380  | 9,426.39  | 550,313,143   | 8,775.59  | 512,319,038 | 0.91 |
| 27 | イギリス | 投資証券 | SEGRO PLC                     | 403,600 | 1,658.38  | 669,323,054   | 1,259.91  | 508,500,322 | 0.90 |
| 28 | アメリカ | 投資証券 | CAMDEN PROPERTY TRUST         | 36,650  | 17,549.99 | 643,207,400   | 13,781.63 | 505,096,787 | 0.90 |
| 29 | アメリカ | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC     | 238,600 | 2,584.60  | 616,685,739   | 2,108.43  | 503,073,474 | 0.89 |
| 30 | アメリカ | 投資証券 | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 62,940  | 8,171.40  | 514,308,488   | 7,755.42  | 488,126,286 | 0.87 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.05   |
| 合 計  | 98.05   |

## （参考）野村マネー マザーファンド

| 順位 | 国／地域 | 種類    | 銘柄名                                              | 数量          | 簿価<br>単価<br>（円） | 簿価<br>金額<br>（円） | 評価<br>単価<br>（円） | 評価<br>金額<br>（円） | 利率<br>（％） | 償還期限      | 投資<br>比率<br>（％） |
|----|------|-------|--------------------------------------------------|-------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|-----------|-----------------|
| 1  | 日本   | 特殊債券  | 政保 地方公共<br>団体金融機構債<br>券 第4 8 回                   | 370,000,000 | 100.07          | 370,285,037     | 100.07          | 370,285,037     | 0.605     | 2023/5/16 | 7.71            |
| 2  | 日本   | 特殊債券  | 日本高速道路保<br>有・債務返済機<br>構債券 政府保<br>証債第1 9 5 回      | 292,000,000 | 100.31          | 292,914,680     | 100.31          | 292,914,680     | 0.911     | 2023/7/31 | 6.10            |
| 3  | 日本   | 地方債証券 | 北海道 公募平<br>成2 5 年度第1<br>回                        | 100,000,000 | 100.04          | 100,042,341     | 100.04          | 100,042,341     | 0.58      | 2023/4/26 | 2.08            |
| 4  | 日本   | 特殊債券  | 預金保険機構債<br>券 政府保証第<br>2 2 1 回                    | 100,000,000 | 100.02          | 100,025,510     | 100.02          | 100,025,510     | 0.1       | 2023/6/7  | 2.08            |
| 5  | 日本   | 社債券   | 三井住友ファイ<br>ナンス&リー<br>ス 第1 8 回社<br>債間限定同順位<br>特約付 | 100,000,000 | 100.02          | 100,024,294     | 100.02          | 100,024,294     | 0.17      | 2023/5/29 | 2.08            |
| 6  | 日本   | 特殊債券  | 日本政策投資銀<br>行社債 財投機<br>関債第9 1 回                   | 100,000,000 | 100.01          | 100,011,882     | 100.01          | 100,011,882     | 0.06      | 2023/6/20 | 2.08            |
| 7  | 日本   | 地方債証券 | 静岡県 公募平<br>成2 5 年度第1<br>回                        | 30,000,000  | 100.03          | 30,009,316      | 100.03          | 30,009,316      | 0.581     | 2023/4/19 | 0.62            |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類    | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 地方債証券 | 2.70    |
| 特殊債券  | 17.98   |
| 社債券   | 2.08    |
| 合 計   | 22.77   |

## 【投資不動産物件】

野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村マネー 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DC運用戦略ファンド（マイルド）

該当事項はありません。

## （参考）国内株式マザーファンド

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

| 種類           | 取引所   | 名称                 | 買建/<br>売建 | 枚数  | 通貨  | 帳簿価額<br>（円）    | 評価額<br>（円）     | 投資<br>比率<br>（％） |
|--------------|-------|--------------------|-----------|-----|-----|----------------|----------------|-----------------|
| 株価指数先物<br>取引 | 大阪取引所 | TOPIX先物(2023年06月限) | 買建        | 673 | 日本円 | 13,261,526,738 | 13,483,555,000 | 2.73            |

## （参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

## （参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

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

| 種類               | 国/地<br>域    | 取引所                            | 名称                                     | 買建/<br>売建 | 枚数  | 通貨         | 帳簿価額          | 帳簿価額<br>（円）    | 評価額         | 評価額<br>（円）     | 投資<br>比率<br>（％） |
|------------------|-------------|--------------------------------|----------------------------------------|-----------|-----|------------|---------------|----------------|-------------|----------------|-----------------|
| 株価指<br>数先物<br>取引 | アメリカ        | シカゴ<br>マーカン<br>タイル取引所          | E-mini S&P500株<br>価指数先物(2023<br>年06月限) | 買建        | 574 | 米ドル        | 114,305,712.5 | 15,263,241,803 | 117,096,000 | 15,635,828,880 | 1.04            |
|                  | カナダ         | モントリ<br>オール取引<br>所             | S&P TSX60株価指<br>数先物(2023年06<br>月限)     | 買建        | 32  | カナダド<br>ル  | 7,601,420     | 750,640,225    | 7,681,280   | 758,526,400    | 0.05            |
|                  | ドイツ         | ユーレック<br>ス・ドイツ<br>金融先物取<br>引所  | ユーロ50株価指数<br>先物(2023年06月<br>限)         | 買建        | 367 | ユーロ        | 15,120,195    | 2,203,314,814  | 15,531,440  | 2,263,241,431  | 0.15            |
|                  | オース<br>トラリア | シドニー先<br>物取引所<br>ア             | SP1200株価指数先<br>物(2023年06月限)            | 買建        | 31  | 豪ドル        | 5,494,850     | 492,833,099    | 5,533,500   | 496,299,615    | 0.03            |
|                  | イギリ<br>ス    | ロンドン国<br>際金融先物<br>オプション<br>取引所 | FT100株価指数先<br>物(2023年06月限)             | 買建        | 79  | 英ポンド       | 5,976,220     | 989,422,981    | 6,022,960   | 997,161,250    | 0.06            |
|                  | スイス         | ユーレック<br>ス・チュー<br>リッヒ取引<br>所   | SMI株価指数先物<br>(2023年06月限)               | 買建        | 41  | スイスフ<br>ラン | 4,361,530     | 637,481,224    | 4,480,890   | 654,926,876    | 0.04            |

## （参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

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

| 種類       | 国／地域 | 取引所            | 名称                                      | 買建／<br>売建 | 枚数  | 通貨  | 帳簿価額       | 帳簿価額<br>（円）   | 評価額        | 評価額<br>（円）    | 投資<br>比率<br>（％） |
|----------|------|----------------|-----------------------------------------|-----------|-----|-----|------------|---------------|------------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | 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(2023年06月限)         | 買建        | 628 | 米ドル | 30,092,855 | 4,018,298,927 | 31,334,060 | 4,184,037,021 | 4.71            |
|          | 香港   | 香港先物取引所        | MSCI China A 50 Connect 指数先物(2023年04月限) | 買建        | 101 | 米ドル | 5,537,325  | 739,399,007   | 5,575,705  | 744,523,888   | 0.83            |

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

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

| 種類         | 取引所   | 名称                  | 買建／<br>売建 | 枚数  | 通貨  | 帳簿価額<br>（円）   | 評価額<br>（円）    | 投資<br>比率<br>（％） |
|------------|-------|---------------------|-----------|-----|-----|---------------|---------------|-----------------|
| REIT指数先物取引 | 大阪取引所 | REIT指数先物(2023年06月限) | 買建        | 717 | 日本円 | 1,301,950,830 | 1,274,109,000 | 2.81            |

（参考）海外R E I T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／<br>売建 | 枚数  | 通貨  | 帳簿価額      | 帳簿価額<br>（円） | 評価額       | 評価額<br>（円）  | 投資<br>比率<br>（％） |
|----------|------|---------------|------------------------------|-----------|-----|-----|-----------|-------------|-----------|-------------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | 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(2023年06月限) | 買建        | 220 | 米ドル | 7,103,430 | 948,521,005 | 7,134,600 | 952,683,132 | 1.70            |

## （参考）野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

## （３）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）

2023年3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 2月17日) | 34         | 34    | 0.9888       | 0.9888 |
| 第2計算期間  | (2015年 2月17日) | 36         | 36    | 1.0396       | 1.0401 |
| 第3計算期間  | (2016年 2月17日) | 35         | 35    | 1.0274       | 1.0279 |
| 第4計算期間  | (2017年 2月17日) | 47         | 48    | 1.0353       | 1.0358 |
| 第5計算期間  | (2018年 2月19日) | 948        | 949   | 1.0379       | 1.0384 |
| 第6計算期間  | (2019年 2月18日) | 1,645      | 1,646 | 1.0463       | 1.0468 |
| 第7計算期間  | (2020年 2月17日) | 2,625      | 2,626 | 1.1050       | 1.1055 |
| 第8計算期間  | (2021年 2月17日) | 3,452      | 3,453 | 1.0985       | 1.0990 |
| 第9計算期間  | (2022年 2月17日) | 3,910      | 3,911 | 1.0707       | 1.0712 |
| 第10計算期間 | (2023年 2月17日) | 4,935      | 4,938 | 1.0027       | 1.0032 |
|         | 2022年 3月末日    | 3,898      | —     | 1.0642       | —      |
|         | 4月末日          | 3,890      | —     | 1.0552       | —      |
|         | 5月末日          | 3,886      | —     | 1.0507       | —      |
|         | 6月末日          | 4,675      | —     | 1.0396       | —      |
|         | 7月末日          | 4,773      | —     | 1.0481       | —      |
|         | 8月末日          | 4,787      | —     | 1.0424       | —      |
|         | 9月末日          | 4,766      | —     | 1.0244       | —      |
|         | 10月末日         | 4,823      | —     | 1.0285       | —      |
|         | 11月末日         | 4,937      | —     | 1.0194       | —      |
|         | 12月末日         | 4,890      | —     | 0.9983       | —      |
|         | 2023年 1月末日    | 4,907      | —     | 1.0006       | —      |
|         | 2月末日          | 4,943      | —     | 1.0046       | —      |
|         | 3月末日          | 5,030      | —     | 1.0097       | —      |

## 【分配の推移】

## 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）

|         | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|---------|-------------------------|-----------|
| 第1計算期間  | 2013年 3月29日～2014年 2月17日 | 0.0000円   |
| 第2計算期間  | 2014年 2月18日～2015年 2月17日 | 0.0005円   |
| 第3計算期間  | 2015年 2月18日～2016年 2月17日 | 0.0005円   |
| 第4計算期間  | 2016年 2月18日～2017年 2月17日 | 0.0005円   |
| 第5計算期間  | 2017年 2月18日～2018年 2月19日 | 0.0005円   |
| 第6計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.0005円   |
| 第7計算期間  | 2019年 2月19日～2020年 2月17日 | 0.0005円   |
| 第8計算期間  | 2020年 2月18日～2021年 2月17日 | 0.0005円   |
| 第9計算期間  | 2021年 2月18日～2022年 2月17日 | 0.0005円   |
| 第10計算期間 | 2022年 2月18日～2023年 2月17日 | 0.0005円   |

### 【収益率の推移】

#### 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

|         | 計算期間                    | 収益率  |
|---------|-------------------------|------|
| 第1計算期間  | 2013年 3月29日～2014年 2月17日 | 1.1% |
| 第2計算期間  | 2014年 2月18日～2015年 2月17日 | 5.2% |
| 第3計算期間  | 2015年 2月18日～2016年 2月17日 | 1.1% |
| 第4計算期間  | 2016年 2月18日～2017年 2月17日 | 0.8% |
| 第5計算期間  | 2017年 2月18日～2018年 2月19日 | 0.3% |
| 第6計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.9% |
| 第7計算期間  | 2019年 2月19日～2020年 2月17日 | 5.7% |
| 第8計算期間  | 2020年 2月18日～2021年 2月17日 | 0.5% |
| 第9計算期間  | 2021年 2月18日～2022年 2月17日 | 2.5% |
| 第10計算期間 | 2022年 2月18日～2023年 2月17日 | 6.3% |

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

### （４）【設定及び解約の実績】

#### 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

|        | 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 3月29日～2014年 2月17日 | 35,000,000    | —           | 35,000,000  |
| 第2計算期間 | 2014年 2月18日～2015年 2月17日 | —             | —           | 35,000,000  |
| 第3計算期間 | 2015年 2月18日～2016年 2月17日 | —             | —           | 35,000,000  |
| 第4計算期間 | 2016年 2月18日～2017年 2月17日 | 11,359,814    | —           | 46,359,814  |
| 第5計算期間 | 2017年 2月18日～2018年 2月19日 | 1,085,833,763 | 217,945,007 | 914,248,570 |

|         |                         |               |             |               |
|---------|-------------------------|---------------|-------------|---------------|
| 第6計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 922,864,885   | 264,607,400 | 1,572,506,055 |
| 第7計算期間  | 2019年 2月19日～2020年 2月17日 | 1,044,057,179 | 240,724,073 | 2,375,839,161 |
| 第8計算期間  | 2020年 2月18日～2021年 2月17日 | 1,279,818,925 | 512,962,915 | 3,142,695,171 |
| 第9計算期間  | 2021年 2月18日～2022年 2月17日 | 919,816,988   | 410,427,376 | 3,652,084,783 |
| 第10計算期間 | 2022年 2月18日～2023年 2月17日 | 1,734,331,236 | 463,664,443 | 4,922,751,576 |

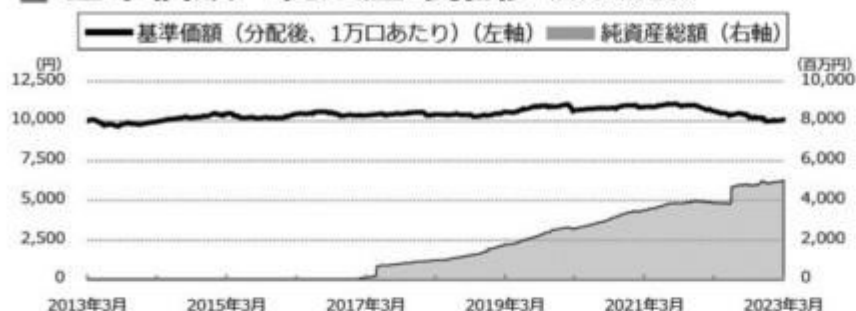
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

## 参考情報



## 運用実績（2023年3月31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）

|         |      |
|---------|------|
| 2023年2月 | 5 円  |
| 2022年2月 | 5 円  |
| 2021年2月 | 5 円  |
| 2020年2月 | 5 円  |
| 2019年2月 | 5 円  |
| 設定来累計   | 45 円 |

### ■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

| 銘柄                      | 投資比率(%) |
|-------------------------|---------|
| 国内株式マザーファンド             | 3.2     |
| 国内債券マザーファンド             | 31.7    |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 3.4     |
| 外国債券マザーファンド             | 17.8    |
| 新興国株式マザーファンド            | 1.4     |
| 新興国債券マザーファンド            | 0.4     |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド    | 1.6     |
| J-REITインデックス マザーファンド    | 3.2     |
| 海外REITインデックス マザーファンド    | 0.9     |
| 野村マネー マザーファンド           | 0.2     |

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 種類   | 投資比率 (%) |
|----|-------------------|------|----------|
| 1  | 国庫債券 利付（2年）第438回  | 国債証券 | 0.6      |
| 2  | 国庫債券 利付（10年）第334回 | 国債証券 | 0.5      |
| 3  | 国庫債券 利付（5年）第141回  | 国債証券 | 0.5      |
| 4  | 国庫債券 利付（5年）第153回  | 国債証券 | 0.4      |
| 5  | 国庫債券 利付（5年）第145回  | 国債証券 | 0.4      |

## ・「外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 業種                   | 投資比率（％） |
|----|-------------------|----------------------|---------|
| 1  | APPLE INC         | コンピュータ・周辺機器          | 0.2     |
| 2  | MICROSOFT CORP    | ソフトウェア               | 0.1     |
| 3  | AMAZON.COM INC    | 大規模小売り               | 0.1     |
| 4  | NVIDIA CORP       | 半導体・半導体製造装置          | 0.0     |
| 5  | ALPHABET INC-CL A | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.0     |

## ・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄               | 種類   | 投資比率（％） |
|----|------------------|------|---------|
| 1  | US TREASURY N/B  | 国債証券 | 0.7     |
| 2  | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.6     |
| 3  | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.6     |
| 4  | US TREASURY N/B  | 国債証券 | 0.3     |
| 5  | US TREASURY N/B  | 国債証券 | 0.3     |

## ・「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          | 0.1     |
| 2  | TENCENT HOLDINGS LTD           | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.1     |
| 3  | ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF | －                    | 0.1     |
| 4  | SAMSUNG ELECTRONICS            | コンピュータ・周辺機器          | 0.0     |
| 5  | ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED  | 大規模小売り               | 0.0     |

## ・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                       | 種類   | 投資比率（％） |
|----|--------------------------|------|---------|
| 1  | SAUDI INTERNATIONAL BOND | 国債証券 | 0.0     |
| 2  | STATE OF QATAR           | 国債証券 | 0.0     |
| 3  | STATE OF QATAR           | 国債証券 | 0.0     |
| 4  | OMAN GOV INTERNTL BOND   | 国債証券 | 0.0     |
| 5  | FED REPUBLIC OF BRAZIL   | 国債証券 | 0.0     |

## ・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

## ・「J－REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

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

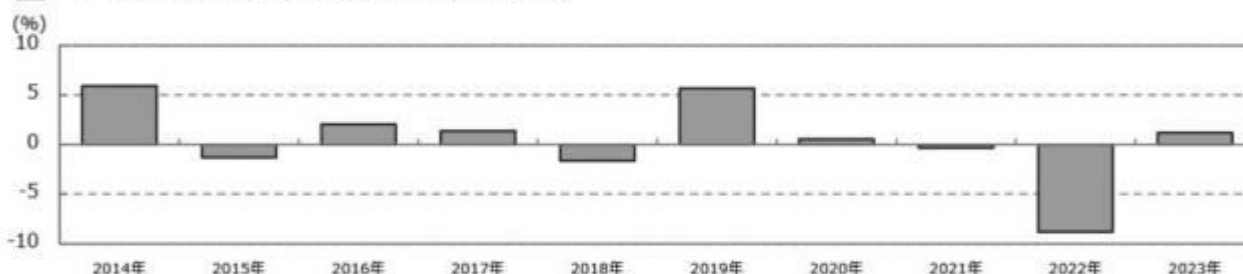
## ・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                       | 種類   | 投資比率（％） |
|----|--------------------------|------|---------|
| 1  | PROLOGIS INC             | 投資証券 | 0.1     |
| 2  | EQUINIX INC              | 投資証券 | 0.0     |
| 3  | PUBLIC STORAGE           | 投資証券 | 0.0     |
| 4  | REALTY INCOME CORP       | 投資証券 | 0.0     |
| 5  | SIMON PROPERTY GROUP INC | 投資証券 | 0.0     |

## ・「野村マネー マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                             | 種類    | 投資比率（％） |
|----|--------------------------------|-------|---------|
| 1  | 政保 地方公共団体金融機構債券 第48回           | 特殊債券  | 0.0     |
| 2  | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第195回   | 特殊債券  | 0.0     |
| 3  | 北海道 公募平成25年度第1回                | 地方債証券 | 0.0     |
| 4  | 預金保険機構債券 政府保証第221回             | 特殊債券  | 0.0     |
| 5  | 三井住友ファイナンス&リース 第18回社債期限定同順位特約付 | 社債券   | 0.0     |

## ■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2023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時まで取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受け付けにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

(3)販売単位

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

(4)販売価額

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

(5)申込代金の支払い

取得申込日の翌々営業日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。

(6)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号口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」という場合があります。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け付けを中止することおよびすでに受付けた取得申込の受け付けを取り消す場合があります。

(7)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け付けについては、午後3時までには解約請求の申込みが行われ、かつ、その解約請求の申込みの受け付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込み分とします。

## (3)換金単位

1口単位で一部解約の実行を請求することができます。

## (4)換金価額

解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

## (5)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。

## (6)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6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、信託約款の規定に従い、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

## (7)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、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよび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。

## (8)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従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては１万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

| 対象                | 評価方法                                                                                                                                        |
|-------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 株式                | 原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> の金融商品取引所の最終相場で評価します。                                                                                             |
| 公社債等              | 原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup><br>日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)<br>金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く）<br>価格情報会社の提供する価額 |
| REIT<br>(不動産投資信託) | 原則として、基準価額計算日 <sup>1</sup> の金融商品取引所の最終相場で評価します。                                                                                             |
| 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3月29日設定)。

### （４）【計算期間】

原則として、毎年2月18日から翌年2月17日までとします。

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

#### （b）信託期間の終了

- （ ）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

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) 信託約款の変更等

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

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- ( ) 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、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。
- ( ) 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、原則、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10期計算期間(2022年2月18日から2023年2月17日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第9期<br>(2022年 2月17日現在) | 第10期<br>(2023年 2月17日現在) |
|-----------------|------------------------|-------------------------|
| 資産の部            |                        |                         |
| 流動資産            |                        |                         |
| コール・ローン         | 1,592,052,708          | 2,038,168,135           |
| 親投資信託受益証券       | 2,367,239,858          | 2,939,702,739           |
| 流動資産合計          | 3,959,292,566          | 4,977,870,874           |
| 資産合計            | 3,959,292,566          | 4,977,870,874           |
| 負債の部            |                        |                         |
| 流動負債            |                        |                         |
| 派生商品評価勘定        | 21,729,239             | 14,319,563              |
| 未払金             | 784,736                | 3,036,962               |
| 未払収益分配金         | 1,826,042              | 2,461,375               |
| 未払解約金           | 11,735,747             | 5,886,590               |
| 未払受託者報酬         | 1,083,827              | 1,342,333               |
| 未払委託者報酬         | 11,922,002             | 14,765,565              |
| 未払利息            | 1,078                  | 488                     |
| その他未払費用         | 64,966                 | 80,475                  |
| 流動負債合計          | 49,147,637             | 41,893,351              |
| 負債合計            | 49,147,637             | 41,893,351              |
| 純資産の部           |                        |                         |
| 元本等             |                        |                         |
| 元本              | 3,652,084,783          | 4,922,751,576           |
| 剰余金             |                        |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 258,060,146            | 13,225,947              |
| （分配準備積立金）       | 146,351,334            | 158,852,722             |
| 元本等合計           | 3,910,144,929          | 4,935,977,523           |
| 純資産合計           | 3,910,144,929          | 4,935,977,523           |
| 負債純資産合計         | 3,959,292,566          | 4,977,870,874           |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第9期<br>自 2021年 2月18日<br>至 2022年 2月17日 | 第10期<br>自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                        |
| 有価証券売買等損益                                 | 12,408,759                            | 79,827,119                             |
| 為替差損益                                     | 85,503,849                            | 176,727,144                            |
| 営業収益合計                                    | 73,095,090                            | 256,554,263                            |
| 営業費用                                      |                                       |                                        |
| 支払利息                                      | 134,633                               | 361,645                                |
| 受託者報酬                                     | 2,073,096                             | 2,463,106                              |
| 委託者報酬                                     | 22,803,937                            | 27,094,030                             |
| その他費用                                     | 130,203                               | 162,773                                |
| 営業費用合計                                    | 25,141,869                            | 30,081,554                             |
| 営業利益又は営業損失（ ）                             | 98,236,959                            | 286,635,817                            |
| 経常利益又は経常損失（ ）                             | 98,236,959                            | 286,635,817                            |
| 当期純利益又は当期純損失（ ）                           | 98,236,959                            | 286,635,817                            |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ） | 1,399,409                             | 13,650,243                             |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ）                           | 309,441,732                           | 258,060,146                            |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 87,472,762                            | 60,737,438                             |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 87,472,762                            | 60,737,438                             |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 40,190,756                            | 30,124,688                             |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 40,190,756                            | 30,124,688                             |
| 分配金                                       | 1,826,042                             | 2,461,375                              |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ）                           | 258,060,146                           | 13,225,947                             |

## （３）【注記表】

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                                                                                                                                        |
|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| １．運用資産の評価基準及び評価方法     | 親投資信託受益証券<br>基準価額で評価しております。                                                                                                                                            |
| ２．費用・収益の計上基準          | 為替予約取引<br>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。<br>有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>為替差損益<br>約定日基準で計上しております。                                                             |
| ３．金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |
| ４．その他                 | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2022年 2月18日から2023年 2月17日までとなっております。                                                                                                             |

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

## （貸借対照表に関する注記）

| 第9期<br>2022年 2月17日現在                                                          | 第10期<br>2023年 2月17日現在                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| １． 計算期間の末日における受益権の総数<br>3,652,084,783口                                        | １． 計算期間の末日における受益権の総数<br>4,922,751,576口                                        |
| ２． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.0707円<br>(10,000口当たり純資産額) (10,707円) | ２． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額<br>1口当たり純資産額 1.0027円<br>(10,000口当たり純資産額) (10,027円) |

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                   |              |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------|--------------|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|----|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|--------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|--|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|----|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|--------------|
| <div>第9期</div> <div>自 2021年 2月18日</div> <div>至 2022年 2月17日</div>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | <div>第10期</div> <div>自 2022年 2月18日</div> <div>至 2023年 2月17日</div> |              |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| <div>1. 分配金の計算過程</div> <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>41,172,582円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>385,573,182円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>107,004,794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>533,750,558円</td></tr></table> | 項目                                                                |              |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 41,172,582円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | 収益調整金額 | C | 385,573,182円 | 分配準備積立金額 | D | 107,004,794円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 533,750,558円 | <div>1. 分配金の計算過程</div> <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>30,024,586円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>587,483,869円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>131,289,511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>748,797,966円</td></tr></table> | 項目 |  |  | 費用控除後の配当等収益額 | A | 30,024,586円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | 収益調整金額 | C | 587,483,869円 | 分配準備積立金額 | D | 131,289,511円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 748,797,966円 |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                   |              |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | A                                                                 | 41,172,582円  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | B                                                                 | 0円           |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | C                                                                 | 385,573,182円 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | D                                                                 | 107,004,794円 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | E=A+B+C+D                                                         | 533,750,558円 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 項目                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                   |              |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 費用控除後の配当等収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | A                                                                 | 30,024,586円  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | B                                                                 | 0円           |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 収益調整金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | C                                                                 | 587,483,869円 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 分配準備積立金額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | D                                                                 | 131,289,511円 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |
| 当ファンドの分配対象収益額                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | E=A+B+C+D                                                         | 748,797,966円 |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |    |  |  |              |   |             |                           |   |    |        |   |              |          |   |              |               |           |              |

|                   |                       |                |                   |                       |                |
|-------------------|-----------------------|----------------|-------------------|-----------------------|----------------|
| 当ファンドの期末残存口数      | F                     | 3,652,084,783口 | 当ファンドの期末残存口数      | F                     | 4,922,751,576口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 1,461円         | 10,000口当たり収益分配対象額 | $G=E/F \times 10,000$ | 1,521円         |
| 10,000口当たり分配金額    | H                     | 5円             | 10,000口当たり分配金額    | H                     | 5円             |
| 収益分配金金額           | $I=F \times H/10,000$ | 1,826,042円     | 収益分配金金額           | $I=F \times H/10,000$ | 2,461,375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9期<br>自 2021年 2月18日<br>至 2022年 2月17日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 第10期<br>自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日                                                                     |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>当ファンドは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされておりますが、主要投資対象である親投資信託受益証券の保有状況によっては、市場リスクの内容は変動する場合があります。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> | <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p> |

## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 第9期<br>2022年 2月17日現在                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 第10期<br>2023年 2月17日現在                                         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|
| <p>1．貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2．時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>1．貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2．時価の算定方法</p> <p>同左</p> |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第9期<br>自 2021年 2月18日<br>至 2022年 2月17日                                 | 第10期<br>自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日 |
|-----------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| 市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。 | 同左                                     |

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

| 第9期<br>自 2021年 2月18日<br>至 2022年 2月17日 | 第10期<br>自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日 |
|---------------------------------------|----------------------------------------|
| 期首元本額 3,142,695,171円                  | 期首元本額 3,652,084,783円                   |
| 期中追加設定元本額 919,816,988円                | 期中追加設定元本額 1,734,331,236円               |
| 期中一部解約元本額 410,427,376円                | 期中一部解約元本額 463,664,443円                 |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類 | 第9期<br>自 2021年 2月18日<br>至 2022年 2月17日 | 第10期<br>自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日 |
|----|---------------------------------------|----------------------------------------|
|----|---------------------------------------|----------------------------------------|

|           | 損益に含まれた評価差額（円） | 損益に含まれた評価差額（円） |
|-----------|----------------|----------------|
| 親投資信託受益証券 | 17,186,464     | 45,589,624     |
| 合計        | 17,186,464     | 45,589,624     |

### ３ デリバティブ取引関係

#### デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

| 種類        | 第9期(2022年 2月17日現在) |           |               |            | 第10期(2023年 2月17日現在) |           |             |            |
|-----------|--------------------|-----------|---------------|------------|---------------------|-----------|-------------|------------|
|           | 契約額等（円）            |           | 時価（円）         | 評価損益（円）    | 契約額等（円）             |           | 時価（円）       | 評価損益（円）    |
|           |                    | うち1年<br>超 |               |            |                     | うち1年<br>超 |             |            |
| 市場取引以外の取引 |                    |           |               |            |                     |           |             |            |
| 為替予約取引    |                    |           |               |            |                     |           |             |            |
| 売建        | 1,178,782,617      | -         | 1,200,511,856 | 21,729,239 | 479,033,855         | -         | 493,353,418 | 14,319,563 |
| 米ドル       | 534,360,860        | -         | 542,700,540   | 8,339,680  | 58,963,184          | -         | 61,731,816  | 2,768,632  |
| カナダドル     | 64,714,298         | -         | 65,523,096    | 808,798    | 59,078,436          | -         | 61,763,532  | 2,685,096  |
| ユーロ       | 437,065,408        | -         | 446,258,151   | 9,192,743  | 182,990,292         | -         | 188,147,833 | 5,157,541  |
| 英ポンド      | 72,016,234         | -         | 73,745,162    | 1,728,928  | 109,636,107         | -         | 110,791,851 | 1,155,744  |
| 豪ドル       | 70,625,817         | -         | 72,284,907    | 1,659,090  | 68,365,836          | -         | 70,918,386  | 2,552,550  |
| 合計        | 1,178,782,617      | -         | 1,200,511,856 | 21,729,239 | 479,033,855         | -         | 493,353,418 | 14,319,563 |

#### （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。

#### （４）【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券 (2023年2月17日現在)

(単位:円)

| 種類        | 通貨  | 銘柄                      | 券面総額          | 評価額                     | 備考 |
|-----------|-----|-------------------------|---------------|-------------------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 国内株式マザーファンド             | 75,779,942    | 164,010,528             |    |
|           |     | 国内債券マザーファンド             | 1,210,194,544 | 1,561,393,000           |    |
|           |     | 外国債券マザーファンド             | 280,597,567   | 702,251,530             |    |
|           |     | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 36,585,703    | 174,554,047             |    |
|           |     | 野村マネー マザーファンド           | 7,492,405     | 7,640,005               |    |
|           |     | J-REITインデックス マザーファンド    | 61,854,171    | 157,363,196             |    |
|           |     | 海外REITインデックス マザーファンド    | 9,709,226     | 31,432,648              |    |
|           |     | 新興国株式マザーファンド            | 45,027,417    | 72,219,474              |    |
|           |     | 新興国債券マザーファンド            | 11,130,886    | 21,273,349              |    |
|           |     | 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド    | 32,421,077    | 47,564,962              |    |
|           | 小計  | 銘柄数：10<br>組入時価比率：59.6%  | 1,770,792,938 | 2,939,702,739<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                         |               | 2,939,702,739           |    |

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2023年 2月17日現在)

|         |                |
|---------|----------------|
| 資産の部    |                |
| 流動資産    |                |
| コール・ローン | 15,508,159,468 |

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 株式              | 475,198,390,320 |
| 派生商品評価勘定        | 136,939,071     |
| 未収入金            | 3,849,724       |
| 未収配当金           | 816,910,678     |
| 未収利息            | 209,099         |
| その他未収収益         | 19,499,969      |
| 差入委託証拠金         | 73,313,695      |
| 流動資産合計          | 491,757,272,024 |
| 資産合計            | 491,757,272,024 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 147,475         |
| 未払金             | 1,151,268,540   |
| 未払解約金           | 110,313,088     |
| 未払利息            | 3,713           |
| 有価証券貸借取引受入金     | 9,407,730,945   |
| 流動負債合計          | 10,669,463,761  |
| 負債合計            | 10,669,463,761  |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 222,284,741,409 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 258,803,066,854 |
| 元本等合計           | 481,087,808,263 |
| 純資産合計           | 481,087,808,263 |
| 負債純資産合計         | 491,757,272,024 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |                |
|----------------------------|----------------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |                |
| 1口当たり純資産額                  | 2.1643円        |
| (10,000口当たり純資産額)           | (21,643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 |                |
|                            | 9,002,368,230円 |

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日                                                                      |  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 1.金融商品に対する取組方針                                                                                      |  |
| 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |  |
| 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク                                                                             |  |
| 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。                                          |  |
| 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。                                                                  |  |
| これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。                                                       |  |
| 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。                                                |  |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制                                                                                    |  |
| 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。                                       |  |
| ○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

| 2023年 2月17日現在                                          |  |
|--------------------------------------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                     |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |  |
| 2. 時価の算定方法                                             |  |

## 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年 2月17日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2022年 2月18日      |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 205,117,643,737円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 40,942,494,560円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 23,775,396,888円  |
| 期末元本額                            | 222,284,741,409円 |
| 期末元本額の内訳＊                        |                  |
| バランスセレクト３０                       | 125,445,132円     |
| バランスセレクト５０                       | 289,028,074円     |
| バランスセレクト７０                       | 435,037,006円     |
| 野村世界６資産分散投信（安定コース）               | 2,078,656,446円   |
| 野村世界６資産分散投信（分配コース）               | 2,693,629,216円   |
| 野村世界６資産分散投信（成長コース）               | 9,090,877,870円   |
| 野村資産設計ファンド２０１５                   | 32,955,314円      |
| 野村資産設計ファンド２０２０                   | 35,627,762円      |
| 野村資産設計ファンド２０２５                   | 59,086,967円      |
| 野村資産設計ファンド２０３０                   | 92,959,450円      |
| 野村資産設計ファンド２０３５                   | 89,229,985円      |
| 野村資産設計ファンド２０４０                   | 156,559,645円     |
| 野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）          | 12,226,645,827円  |
| のむラップ・ファンド（保守型）                  | 2,401,983,630円   |
| のむラップ・ファンド（普通型）                  | 16,059,765,541円  |
| のむラップ・ファンド（積極型）                  | 6,211,392,540円   |
| 野村資産設計ファンド２０４５                   | 34,853,449円      |
| 野村インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ               | 2,168,196,983円   |
| マイ・ロード                           | 2,891,588,693円   |
| ネクストコア                           | 26,714,330円      |
| 野村インデックスファンド・内外７資産バランス・為替ヘッジ型    | 1,450,619,403円   |
| 野村ＴＯＰＩＸインデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）        | 2,723,992,970円   |
| 野村世界６資産分散投信（配分変更コース）             | 942,423,082円     |
| 野村資産設計ファンド２０５０                   | 39,676,875円      |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型 | 10,167,249円      |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型 | 6,532,290円       |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型 | 5,113,480円       |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型 | 4,677,088円       |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                | 431,058,818円     |

|                                                |                 |
|------------------------------------------------|-----------------|
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                              | 903,738,769円    |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 4,240,016円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 3,833,339円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 23,085,630円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 8,491,531円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 32,768,338円     |
| 野村6資産均等バランス                                    | 3,599,722,645円  |
| 世界6資産分散ファンド                                    | 84,289,145円     |
| 野村資産設計ファンド2060                                 | 31,455,312円     |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式                         | 3,157,792,438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）               | 230,972,319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）               | 126,796,709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）               | 324,875,147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）               | 180,251,983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）               | 1,541,740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）             | 7,106,688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）               | 205,530円        |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）                   | 1,846,688,022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）              | 2,817,398円      |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）              | 25,645,940円     |
| 野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）               | 48,407,889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）                 | 11,087,362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）             | 82,351,864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）             | 165,029,340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）             | 3,780,278,037円  |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）                        | 35,916,545円     |
| ノムラ日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）                 | 166,795,580円    |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用）            | 4,236,626,764円  |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）               | 19,103,282円     |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）             | 74,115,103円     |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用） | 2,202,080円      |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け）                           | 5,690,876円      |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け）                           | 28,052,807円     |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け）                           | 32,344,796円     |
| 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）                      | 112,192,337円    |
| マイバランス30（確定拠出年金向け）                             | 8,566,741,323円  |
| マイバランス50（確定拠出年金向け）                             | 24,830,262,617円 |
| マイバランス70（確定拠出年金向け）                             | 29,860,484,451円 |
| 野村国内株式インデックスファンド・TOPIX（確定拠出年金向け）               | 37,372,842,511円 |
| マイバランスDC30                                     | 3,656,898,149円  |
| マイバランスDC50                                     | 6,397,472,222円  |
| マイバランスDC70                                     | 7,103,488,285円  |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX                       | 12,250,754,504円 |
| 野村DC運用戦略ファンド                                   | 983,252,865円    |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）                             | 75,779,942円     |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け）                          | 1,817,151,010円  |
| マイターゲット2030（確定拠出年金向け）                          | 1,863,379,962円  |

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）         | 1,497,024,282円 |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース          | 14,341,193円    |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース        | 6,820,274円     |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース          | 114,190,354円   |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０   | 39,826,337円    |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０   | 37,611,070円    |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０   | 28,550,603円    |
| マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）         | 994,225,704円   |
| マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）         | 738,739,847円   |
| マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）         | 514,680,629円   |
| マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）         | 651,494,785円   |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０   | 21,276,830円    |
| マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）         | 224,547,638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） | 181,023,912円   |
| みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）   | 182,899,617円   |
| 野村ＤＣバランスファンド（年金運用戦略タイプ）       | 47,972,077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(2023年2月17日現在)

（単位：円）

| 種類 | 通貨  | 銘柄         | 株式数     | 評価額      |             | 備考                   |
|----|-----|------------|---------|----------|-------------|----------------------|
|    |     |            |         | 単価       | 金額          |                      |
| 株式 | 日本円 | 極洋         | 8,800   | 3,625.00 | 31,900,000  | 貸付有価証券<br>1,200株     |
|    |     | ニッスイ       | 232,700 | 537.00   | 124,959,900 | 貸付有価証券<br>100株       |
|    |     | マルハニチロ     | 34,600  | 2,418.00 | 83,662,800  |                      |
|    |     | 雪国まいたけ     | 19,800  | 1,016.00 | 20,116,800  |                      |
|    |     | カネコ種苗      | 7,100   | 1,642.00 | 11,658,200  |                      |
|    |     | サカタのタネ     | 26,500  | 3,990.00 | 105,735,000 | 貸付有価証券<br>100株       |
|    |     | ホクト        | 20,700  | 1,872.00 | 38,750,400  |                      |
|    |     | ホクリヨウ      | 2,900   | 824.00   | 2,389,600   | 貸付有価証券<br>400株（400株） |
|    |     | 住石ホールディングス | 32,200  | 377.00   | 12,139,400  | 貸付有価証券<br>15,000株    |
|    |     | 日鉄鉱業       | 9,300   | 3,530.00 | 32,829,000  |                      |

|                     |         |          |               |                            |
|---------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 三井松島ホールディングス        | 10,500  | 3,820.00 | 40,110,000    | 貸付有価証券<br>2,100株（1,100株）   |
| I N P E X           | 860,700 | 1,438.00 | 1,237,686,600 | 貸付有価証券<br>56,100株          |
| 石油資源開発              | 27,000  | 4,865.00 | 131,355,000   |                            |
| K & O エナジーグループ      | 10,600  | 2,174.00 | 23,044,400    | 貸付有価証券<br>400株（400株）       |
| ショーボンドホールディングス      | 31,700  | 5,220.00 | 165,474,000   | 貸付有価証券<br>6,500株           |
| ミライト・ワン             | 80,700  | 1,489.00 | 120,162,300   |                            |
| タマホーム               | 14,600  | 3,210.00 | 46,866,000    | 貸付有価証券<br>6,800株（100株）     |
| サンヨーホームズ            | 2,500   | 744.00   | 1,860,000     | 貸付有価証券<br>1,100株（600株）     |
| 日本アクア               | 8,600   | 976.00   | 8,393,600     |                            |
| ファーストコーポレーション       | 5,300   | 737.00   | 3,906,100     | 貸付有価証券<br>400株             |
| ベステラ                | 4,500   | 911.00   | 4,099,500     | 貸付有価証券<br>2,300株           |
| R o b o t   H o m e | 39,600  | 195.00   | 7,722,000     | 貸付有価証券<br>11,500株（11,400株） |
| キャンディル              | 3,200   | 503.00   | 1,609,600     | 貸付有価証券<br>1,600株           |
| ダイセキ環境ソリューション       | 4,200   | 964.00   | 4,048,800     | 貸付有価証券<br>400株             |
| 第一カッター興業            | 6,000   | 1,085.00 | 6,510,000     |                            |
| 安藤・間                | 134,800 | 871.00   | 117,410,800   | 貸付有価証券<br>1,700株           |
| 東急建設                | 66,300  | 663.00   | 43,956,900    |                            |
| コムシスホールディングス        | 78,800  | 2,478.00 | 195,266,400   |                            |
| ビーアールホールディングス       | 37,000  | 340.00   | 12,580,000    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 高松コンストラクショングループ     | 15,100  | 1,971.00 | 29,762,100    |                            |
| 東建コーポレーション          | 6,700   | 7,530.00 | 50,451,000    |                            |
| ソネック                | 2,200   | 951.00   | 2,092,200     | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| ヤマウラ                | 11,800  | 1,037.00 | 12,236,600    | 貸付有価証券<br>5,500株           |
| オリエンタル白石            | 83,600  | 309.00   | 25,832,400    | 貸付有価証券                     |

|               |         |          |             |                        |
|---------------|---------|----------|-------------|------------------------|
|               |         |          |             | 300株                   |
| 大成建設          | 162,000 | 4,330.00 | 701,460,000 | 貸付有価証券<br>400株         |
| 大林組           | 582,200 | 969.00   | 564,151,800 | 貸付有価証券<br>100株         |
| 清水建設          | 489,400 | 724.00   | 354,325,600 |                        |
| 飛島建設          | 18,000  | 1,056.00 | 19,008,000  |                        |
| 長谷工コーポレーション   | 168,000 | 1,518.00 | 255,024,000 |                        |
| 松井建設          | 15,200  | 624.00   | 9,484,800   |                        |
| 銭高組           | 1,800   | 2,954.00 | 5,317,200   |                        |
| 鹿島建設          | 361,000 | 1,596.00 | 576,156,000 |                        |
| 不動テトラ         | 11,300  | 1,624.00 | 18,351,200  |                        |
| 大末建設          | 5,300   | 1,181.00 | 6,259,300   |                        |
| 鉄建建設          | 11,700  | 1,777.00 | 20,790,900  |                        |
| 西松建設          | 27,600  | 3,500.00 | 96,600,000  | 貸付有価証券<br>300株         |
| 三井住友建設        | 131,300 | 417.00   | 54,752,100  | 貸付有価証券<br>200株         |
| 大豊建設          | 6,700   | 3,835.00 | 25,694,500  |                        |
| 佐田建設          | 9,200   | 514.00   | 4,728,800   |                        |
| ナカノフドー建設      | 10,300  | 325.00   | 3,347,500   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 奥村組           | 26,400  | 3,200.00 | 84,480,000  |                        |
| 東鉄工業          | 22,400  | 2,754.00 | 61,689,600  |                        |
| イチケン          | 3,300   | 1,805.00 | 5,956,500   |                        |
| 富士ピー・エス       | 6,500   | 452.00   | 2,938,000   | 貸付有価証券<br>3,300株（500株） |
| 浅沼組           | 13,000  | 3,225.00 | 41,925,000  |                        |
| 戸田建設          | 200,300 | 707.00   | 141,612,100 |                        |
| 熊谷組           | 28,200  | 2,715.00 | 76,563,000  |                        |
| 北野建設          | 2,700   | 2,885.00 | 7,789,500   |                        |
| 植木組           | 4,100   | 1,370.00 | 5,617,000   | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| 矢作建設工業        | 22,200  | 816.00   | 18,115,200  |                        |
| ピーエス三菱        | 20,600  | 638.00   | 13,142,800  |                        |
| 日本ハウスホールディングス | 32,300  | 394.00   | 12,726,200  | 貸付有価証券<br>500株（100株）   |
| 新日本建設         | 22,900  | 870.00   | 19,923,000  |                        |
| 東亜道路工業        | 3,200   | 6,250.00 | 20,000,000  | 貸付有価証券                 |

|           |         |          |               |                          |
|-----------|---------|----------|---------------|--------------------------|
|           |         |          |               | 100株                     |
| 日本道路      | 3,300   | 6,750.00 | 22,275,000    |                          |
| 東亜建設工業    | 14,000  | 2,588.00 | 36,232,000    | 貸付有価証券<br>5,800株         |
| 日本国土開発    | 48,800  | 549.00   | 26,791,200    |                          |
| 若築建設      | 7,200   | 3,035.00 | 21,852,000    |                          |
| 東洋建設      | 52,700  | 892.00   | 47,008,400    | 貸付有価証券<br>6,500株（4,800株） |
| 五洋建設      | 230,800 | 648.00   | 149,558,400   |                          |
| 世紀東急工業    | 21,500  | 785.00   | 16,877,500    |                          |
| 福田組       | 6,100   | 4,425.00 | 26,992,500    | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| 住友林業      | 124,900 | 2,624.00 | 327,737,600   | 貸付有価証券<br>36,200株        |
| 日本基礎技術    | 8,700   | 545.00   | 4,741,500     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 巴コーポレーション | 16,200  | 407.00   | 6,593,400     |                          |
| 大和ハウス工業   | 454,900 | 3,109.00 | 1,414,284,100 | 貸付有価証券<br>200株           |
| ライト工業     | 31,000  | 1,955.00 | 60,605,000    |                          |
| 積水ハウス     | 510,000 | 2,519.50 | 1,284,945,000 | 貸付有価証券<br>7,700株         |
| 日特建設      | 15,500  | 926.00   | 14,353,000    |                          |
| 北陸電気工事    | 11,200  | 744.00   | 8,332,800     |                          |
| ユアテック     | 35,900  | 744.00   | 26,709,600    |                          |
| 日本リーテック   | 10,700  | 844.00   | 9,030,800     |                          |
| 四電工       | 6,800   | 1,835.00 | 12,478,000    |                          |
| 中電工       | 25,300  | 2,117.00 | 53,560,100    |                          |
| 関電工       | 89,200  | 867.00   | 77,336,400    |                          |
| きんでん      | 114,600 | 1,487.00 | 170,410,200   |                          |
| 東京エネシス    | 16,200  | 904.00   | 14,644,800    |                          |
| トーエネック    | 5,400   | 3,410.00 | 18,414,000    |                          |
| 住友電設      | 15,500  | 2,366.00 | 36,673,000    |                          |
| 日本電設工業    | 26,700  | 1,496.00 | 39,943,200    |                          |
| エクシオグループ  | 75,000  | 2,362.00 | 177,150,000   |                          |
| 新日本空調     | 9,000   | 1,886.00 | 16,974,000    |                          |
| 九電工       | 39,600  | 3,430.00 | 135,828,000   |                          |
| 三機工業      | 36,100  | 1,483.00 | 53,536,300    |                          |

|                 |         |          |             |                            |
|-----------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 日揮ホールディングス      | 161,000 | 1,749.00 | 281,589,000 | 貸付有価証券<br>69,600株（69,600株） |
| 中外炉工業           | 5,300   | 1,792.00 | 9,497,600   |                            |
| ヤマト             | 12,000  | 801.00   | 9,612,000   |                            |
| 太平電業            | 10,100  | 3,710.00 | 37,471,000  |                            |
| 高砂熱学工業          | 39,200  | 1,992.00 | 78,086,400  |                            |
| 三晃金属工業          | 1,800   | 3,800.00 | 6,840,000   |                            |
| 朝日工業社           | 6,800   | 2,105.00 | 14,314,000  |                            |
| 明星工業            | 28,000  | 776.00   | 21,728,000  |                            |
| 大気社             | 19,600  | 3,520.00 | 68,992,000  |                            |
| ダイダン            | 10,700  | 2,220.00 | 23,754,000  |                            |
| 日比谷総合設備         | 14,000  | 1,992.00 | 27,888,000  |                            |
| フィル・カンパニー       | 2,900   | 1,057.00 | 3,065,300   |                            |
| テスホールディングス      | 17,500  | 1,065.00 | 18,637,500  |                            |
| インフロニア・ホールディングス | 170,600 | 1,036.00 | 176,741,600 |                            |
| レイズネクスト         | 23,500  | 1,343.00 | 31,560,500  |                            |
| ニッポン            | 44,000  | 1,595.00 | 70,180,000  |                            |
| 日清製粉グループ本社      | 151,100 | 1,554.00 | 234,809,400 |                            |
| 日東富士製粉          | 2,900   | 4,410.00 | 12,789,000  |                            |
| 昭和産業            | 14,200  | 2,486.00 | 35,301,200  |                            |
| 鳥越製粉            | 11,600  | 586.00   | 6,797,600   | 貸付有価証券<br>4,400株（400株）     |
| 中部飼料            | 22,600  | 1,028.00 | 23,232,800  |                            |
| フィード・ワン         | 23,900  | 679.00   | 16,228,100  |                            |
| 東洋精糖            | 2,700   | 882.00   | 2,381,400   |                            |
| 日本甜菜製糖          | 9,500   | 1,639.00 | 15,570,500  |                            |
| D M三井製糖ホールディングス | 16,200  | 2,036.00 | 32,983,200  |                            |
| 塩水港精糖           | 17,400  | 197.00   | 3,427,800   | 貸付有価証券<br>900株             |
| ウェルネオシュガー       | 8,400   | 1,659.00 | 13,935,600  | 貸付有価証券<br>500株             |
| 森永製菓            | 30,300  | 3,850.00 | 116,655,000 |                            |
| 中村屋             | 4,100   | 3,045.00 | 12,484,500  |                            |
| 江崎グリコ           | 46,700  | 3,485.00 | 162,749,500 | 貸付有価証券<br>700株             |
| 名糖産業            | 6,400   | 1,686.00 | 10,790,400  |                            |

|                 |         |          |               |                        |
|-----------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| 井村屋グループ         | 8,900   | 2,213.00 | 19,695,700    |                        |
| 不二家             | 11,200  | 2,491.00 | 27,899,200    | 貸付有価証券<br>4,900株       |
| 山崎製パン           | 109,400 | 1,571.00 | 171,867,400   | 貸付有価証券<br>1,700株       |
| 第一屋製パン          | 2,800   | 374.00   | 1,047,200     |                        |
| モロゾフ            | 5,300   | 3,400.00 | 18,020,000    |                        |
| 亀田製菓            | 10,400  | 4,330.00 | 45,032,000    | 貸付有価証券<br>400株         |
| 寿スピリッツ          | 17,400  | 8,610.00 | 149,814,000   |                        |
| カルビー            | 74,800  | 2,885.00 | 215,798,000   |                        |
| 森永乳業            | 29,700  | 4,725.00 | 140,332,500   |                        |
| 六甲バター           | 12,000  | 1,333.00 | 15,996,000    | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| ヤクルト本社          | 116,800 | 9,090.00 | 1,061,712,000 |                        |
| 明治ホールディングス      | 101,300 | 6,400.00 | 648,320,000   | 貸付有価証券<br>3,900株       |
| 雪印メグミルク         | 39,500  | 1,758.00 | 69,441,000    | 貸付有価証券<br>1,300株       |
| プリマハム           | 22,000  | 2,146.00 | 47,212,000    | 貸付有価証券<br>100株         |
| 日本ハム            | 63,900  | 3,710.00 | 237,069,000   |                        |
| 林兼産業            | 4,400   | 458.00   | 2,015,200     |                        |
| 丸大食品            | 16,500  | 1,478.00 | 24,387,000    | 貸付有価証券<br>2,500株（500株） |
| S F o o d s     | 18,000  | 2,773.00 | 49,914,000    | 貸付有価証券<br>200株         |
| 柿安本店            | 6,400   | 2,036.00 | 13,030,400    | 貸付有価証券<br>1,600株       |
| 伊藤ハム米久ホールディングス  | 127,000 | 717.00   | 91,059,000    | 貸付有価証券<br>100株         |
| サッポロホールディングス    | 53,800  | 3,080.00 | 165,704,000   | 貸付有価証券<br>3,300株       |
| アサヒグループホールディングス | 377,700 | 4,668.00 | 1,763,103,600 | 貸付有価証券<br>3,800株       |
| キリンホールディングス     | 737,500 | 1,996.50 | 1,472,418,750 | 貸付有価証券<br>13,300株      |
| 宝ホールディングス       | 111,600 | 1,065.00 | 118,854,000   | 貸付有価証券<br>900株         |
| オエノンホールディングス    | 48,900  | 264.00   | 12,909,600    |                        |

|                          |         |          |               |                        |
|--------------------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| 養命酒製造                    | 5,400   | 1,825.00 | 9,855,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| コカ・コーラ ボトラーズ<br>ジャパンホールデ | 128,000 | 1,399.00 | 179,072,000   |                        |
| サントリー食品インター<br>ナショナル     | 115,100 | 4,680.00 | 538,668,000   | 貸付有価証券<br>4,700株       |
| ダイドーグループホール<br>ディングス     | 9,300   | 4,790.00 | 44,547,000    | 貸付有価証券<br>2,400株       |
| 伊藤園                      | 55,400  | 4,470.00 | 247,638,000   | 貸付有価証券<br>3,100株       |
| キーコーヒー                   | 18,300  | 2,072.00 | 37,917,600    |                        |
| ユニカフェ                    | 4,800   | 888.00   | 4,262,400     | 貸付有価証券<br>2,500株（100株） |
| ジャパンフーズ                  | 2,300   | 1,097.00 | 2,523,100     |                        |
| 日清オイリオグループ               | 23,000  | 3,290.00 | 75,670,000    |                        |
| 不二製油グループ本社               | 38,000  | 1,982.00 | 75,316,000    |                        |
| かどや製油                    | 1,800   | 3,525.00 | 6,345,000     |                        |
| J - オイルミルズ               | 16,600  | 1,552.00 | 25,763,200    |                        |
| キッコーマン                   | 108,300 | 6,520.00 | 706,116,000   | 貸付有価証券<br>200株         |
| 味の素                      | 400,000 | 4,038.00 | 1,615,200,000 |                        |
| ブルドックソース                 | 6,500   | 1,891.00 | 12,291,500    | 貸付有価証券<br>2,200株       |
| キューピー                    | 87,800  | 2,250.00 | 197,550,000   | 貸付有価証券<br>800株         |
| ハウス食品グループ本社              | 50,000  | 2,691.00 | 134,550,000   | 貸付有価証券<br>100株         |
| カゴメ                      | 76,100  | 3,000.00 | 228,300,000   | 貸付有価証券<br>7,900株       |
| 焼津水産化学工業                 | 6,500   | 964.00   | 6,266,000     |                        |
| アリアケジャパン                 | 14,300  | 4,800.00 | 68,640,000    |                        |
| ピエトロ                     | 2,100   | 1,821.00 | 3,824,100     | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| エバラ食品工業                  | 4,400   | 3,025.00 | 13,310,000    | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| やまみ                      | 1,400   | 1,425.00 | 1,995,000     |                        |
| ニチレイ                     | 74,900  | 2,678.00 | 200,582,200   | 貸付有価証券<br>4,100株       |
| 東洋水産                     | 82,600  | 5,560.00 | 459,256,000   |                        |
| イー・アンド・ホールディ             | 6,900   | 2,298.00 | 15,856,200    | 貸付有価証券                 |

|                   |           |           |               |                           |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|---------------------------|
| ングス               |           |           |               | 3,200株                    |
| 大冷                | 1,800     | 1,890.00  | 3,402,000     |                           |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 10,300    | 976.00    | 10,052,800    | 貸付有価証券<br>4,800株（200株）    |
| 日清食品ホールディングス      | 57,500    | 11,280.00 | 648,600,000   |                           |
| 永谷園ホールディングス       | 8,000     | 2,085.00  | 16,680,000    |                           |
| 一正蒲鉾              | 6,200     | 703.00    | 4,358,600     |                           |
| フジッコ              | 16,800    | 1,864.00  | 31,315,200    |                           |
| ロック・フィールド         | 18,300    | 1,568.00  | 28,694,400    | 貸付有価証券<br>8,500株          |
| 日本たばこ産業           | 1,075,900 | 2,771.00  | 2,981,318,900 | 貸付有価証券<br>7,100株          |
| ケンコーマヨネーズ         | 11,200    | 1,277.00  | 14,302,400    |                           |
| わらべや日洋ホールディングス    | 12,000    | 1,875.00  | 22,500,000    |                           |
| なとり               | 10,300    | 2,047.00  | 21,084,100    |                           |
| イフジ産業             | 2,500     | 914.00    | 2,285,000     |                           |
| ファーマフーズ           | 25,300    | 1,455.00  | 36,811,500    | 貸付有価証券<br>11,800株（5,700株） |
| ユーグレナ             | 105,200   | 955.00    | 100,466,000   | 貸付有価証券<br>4,100株          |
| 紀文食品              | 12,800    | 955.00    | 12,224,000    | 貸付有価証券<br>200株（200株）      |
| ピクルスホールディングス      | 9,600     | 1,236.00  | 11,865,600    | 貸付有価証券<br>4,500株          |
| ミヨシ油脂             | 5,100     | 954.00    | 4,865,400     | 貸付有価証券<br>2,600株          |
| 理研ビタミン            | 14,100    | 2,022.00  | 28,510,200    |                           |
| 片倉工業              | 15,300    | 1,696.00  | 25,948,800    | 貸付有価証券<br>500株            |
| グンゼ               | 12,500    | 4,310.00  | 53,875,000    |                           |
| 東洋紡               | 71,900    | 1,024.00  | 73,625,600    |                           |
| ユニチカ              | 50,200    | 227.00    | 11,395,400    | 貸付有価証券<br>7,900株          |
| 富士紡ホールディングス       | 6,500     | 3,110.00  | 20,215,000    |                           |
| 倉敷紡績              | 12,400    | 2,459.00  | 30,491,600    |                           |
| シキボウ              | 8,200     | 998.00    | 8,183,600     |                           |
| 日本毛織              | 43,800    | 945.00    | 41,391,000    |                           |
| ダイトウボウ            | 24,100    | 82.00     | 1,976,200     | 貸付有価証券                    |

|                |           |           |             |                           |
|----------------|-----------|-----------|-------------|---------------------------|
|                |           |           |             | 6,800株（2,300株）            |
| トーア紡コーポレーション   | 5,800     | 353.00    | 2,047,400   |                           |
| ダイドーリミテッド      | 22,500    | 271.00    | 6,097,500   | 貸付有価証券<br>11,700株         |
| 帝国繊維           | 18,700    | 1,577.00  | 29,489,900  | 貸付有価証券<br>200株            |
| 帝人             | 159,700   | 1,423.00  | 227,253,100 | 貸付有価証券<br>1,400株          |
| 東レ             | 1,114,000 | 788.00    | 877,832,000 |                           |
| 住江織物           | 3,100     | 1,898.00  | 5,883,800   |                           |
| 日本フェルト         | 8,100     | 409.00    | 3,312,900   |                           |
| イチカワ           | 1,800     | 1,338.00  | 2,408,400   |                           |
| 日東製網           | 1,600     | 1,518.00  | 2,428,800   |                           |
| アツギ            | 8,600     | 386.00    | 3,319,600   |                           |
| ダイニック          | 3,800     | 758.00    | 2,880,400   |                           |
| セーレン           | 32,100    | 2,508.00  | 80,506,800  | 貸付有価証券<br>15,500株（5,600株） |
| ソトー            | 4,700     | 796.00    | 3,741,200   |                           |
| 東海染工           | 1,400     | 1,074.00  | 1,503,600   |                           |
| 小松マテーレ         | 24,100    | 713.00    | 17,183,300  |                           |
| ワコールホールディングス   | 32,000    | 2,324.00  | 74,368,000  |                           |
| ホギメディカル        | 22,300    | 3,230.00  | 72,029,000  |                           |
| クラウドシアホールディングス | 3,400     | 349.00    | 1,186,600   |                           |
| T S I ホールディングス | 59,500    | 559.00    | 33,260,500  |                           |
| マツオカコーポレーション   | 4,000     | 1,364.00  | 5,456,000   | 貸付有価証券<br>200株（100株）      |
| ワールド           | 21,300    | 1,332.00  | 28,371,600  | 貸付有価証券<br>1,600株          |
| 三陽商会           | 5,600     | 1,433.00  | 8,024,800   | 貸付有価証券<br>300株（200株）      |
| ナイガイ           | 4,900     | 258.00    | 1,264,200   | 貸付有価証券<br>100株            |
| オンワードホールディングス  | 107,800   | 338.00    | 36,436,400  | 貸付有価証券<br>26,200株         |
| ルックホールディングス    | 4,200     | 2,135.00  | 8,967,000   | 貸付有価証券<br>500株            |
| ゴールドウイン        | 29,500    | 11,040.00 | 325,680,000 |                           |

|                |           |          |             |                            |
|----------------|-----------|----------|-------------|----------------------------|
| デサント           | 28,600    | 3,905.00 | 111,683,000 | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株）   |
| キング            | 6,500     | 509.00   | 3,308,500   | 貸付有価証券<br>200株             |
| ヤマトインターナショナル   | 11,600    | 248.00   | 2,876,800   | 貸付有価証券<br>5,700株（2,300株）   |
| 特種東海製紙         | 7,400     | 2,883.00 | 21,334,200  | 貸付有価証券<br>300株             |
| 王子ホールディングス     | 692,600   | 527.00   | 365,000,200 |                            |
| 日本製紙           | 86,600    | 965.00   | 83,569,000  |                            |
| 三菱製紙           | 17,800    | 282.00   | 5,019,600   | 貸付有価証券<br>200株             |
| 北越コーポレーション     | 105,100   | 761.00   | 79,981,100  | 貸付有価証券<br>34,700株          |
| 中越パルプ工業        | 6,000     | 966.00   | 5,796,000   | 貸付有価証券<br>100株             |
| 巴川製紙所          | 4,600     | 662.00   | 3,045,200   |                            |
| 大王製紙           | 73,400    | 1,029.00 | 75,528,600  | 貸付有価証券<br>100株             |
| 阿波製紙           | 3,500     | 750.00   | 2,625,000   | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| レンゴー           | 151,400   | 891.00   | 134,897,400 | 貸付有価証券<br>400株             |
| トーモク           | 9,600     | 1,518.00 | 14,572,800  |                            |
| ザ・パック          | 12,400    | 2,839.00 | 35,203,600  | 貸付有価証券<br>100株             |
| 北の達人コーポレーション   | 70,100    | 338.00   | 23,693,800  | 貸付有価証券<br>32,800株（22,600株） |
| クラレ            | 264,300   | 1,184.00 | 312,931,200 | 貸付有価証券<br>8,000株           |
| 旭化成            | 1,038,300 | 938.20   | 974,133,060 | 貸付有価証券<br>8,700株           |
| 共和レザー          | 8,500     | 506.00   | 4,301,000   | 貸付有価証券<br>3,000株           |
| レゾナック・ホールディングス | 160,700   | 2,296.00 | 368,967,200 | 貸付有価証券<br>11,800株          |
| 住友化学           | 1,233,400 | 473.00   | 583,398,200 | 貸付有価証券<br>12,600株          |
| 住友精化           | 6,900     | 4,160.00 | 28,704,000  |                            |
| 日産化学           | 78,900    | 5,860.00 | 462,354,000 |                            |
| ラサ工業           | 6,400     | 2,105.00 | 13,472,000  |                            |

|              |         |           |               |                      |
|--------------|---------|-----------|---------------|----------------------|
| クレハ          | 14,200  | 8,210.00  | 116,582,000   |                      |
| 多木化学         | 6,500   | 4,345.00  | 28,242,500    | 貸付有価証券<br>1,100株     |
| テイカ          | 11,200  | 1,165.00  | 13,048,000    |                      |
| 石原産業         | 30,100  | 1,052.00  | 31,665,200    |                      |
| 片倉コープアグリ     | 3,000   | 1,860.00  | 5,580,000     |                      |
| 日本曹達         | 17,800  | 4,380.00  | 77,964,000    |                      |
| 東ソー          | 222,000 | 1,748.00  | 388,056,000   | 貸付有価証券<br>200株       |
| トクヤマ         | 53,700  | 2,059.00  | 110,568,300   |                      |
| セントラル硝子      | 26,700  | 2,814.00  | 75,133,800    | 貸付有価証券<br>300株       |
| 東亜合成         | 83,400  | 1,186.00  | 98,912,400    | 貸付有価証券<br>1,000株     |
| 大阪ソーダ        | 10,000  | 4,145.00  | 41,450,000    |                      |
| 関東電化工業       | 32,100  | 1,009.00  | 32,388,900    | 貸付有価証券<br>300株       |
| デンカ          | 60,500  | 2,904.00  | 175,692,000   | 貸付有価証券<br>300株       |
| 信越化学工業       | 280,600 | 19,275.00 | 5,408,565,000 | 貸付有価証券<br>2,000株     |
| 日本カーバイド工業    | 5,600   | 1,297.00  | 7,263,200     |                      |
| 堺化学工業        | 12,700  | 1,784.00  | 22,656,800    | 貸付有価証券<br>3,500株     |
| 第一稀元素化学工業    | 15,100  | 1,023.00  | 15,447,300    | 貸付有価証券<br>400株       |
| エア・ウォーター     | 156,900 | 1,599.00  | 250,883,100   |                      |
| 日本酸素ホールディングス | 161,300 | 2,367.00  | 381,797,100   |                      |
| 日本化学工業       | 5,500   | 1,962.00  | 10,791,000    |                      |
| 東邦アセチレン      | 3,100   | 1,244.00  | 3,856,400     |                      |
| 日本パーカライジング   | 82,300  | 931.00    | 76,621,300    |                      |
| 高圧ガス工業       | 24,100  | 654.00    | 15,761,400    |                      |
| チタン工業        | 1,800   | 1,448.00  | 2,606,400     |                      |
| 四国化成ホールディングス | 19,700  | 1,266.00  | 24,940,200    |                      |
| 戸田工業         | 3,800   | 2,478.00  | 9,416,400     | 貸付有価証券<br>300株（300株） |
| ステラ ケミファ     | 9,800   | 2,505.00  | 24,549,000    |                      |
| 保土谷化学工業      | 4,700   | 3,065.00  | 14,405,500    |                      |

|            |           |          |             |                  |
|------------|-----------|----------|-------------|------------------|
| 日本触媒       | 25,300    | 5,650.00 | 142,945,000 |                  |
| 大日精化工業     | 11,600    | 1,750.00 | 20,300,000  |                  |
| カネカ        | 38,000    | 3,400.00 | 129,200,000 |                  |
| 三菱瓦斯化学     | 124,200   | 1,916.00 | 237,967,200 | 貸付有価証券<br>500株   |
| 三井化学       | 137,100   | 3,190.00 | 437,349,000 |                  |
| J S R      | 155,200   | 3,130.00 | 485,776,000 | 貸付有価証券<br>300株   |
| 東京応化工業     | 29,100    | 7,230.00 | 210,393,000 | 貸付有価証券<br>3,400株 |
| 大阪有機化学工業   | 12,500    | 2,024.00 | 25,300,000  | 貸付有価証券<br>100株   |
| 三菱ケミカルグループ | 1,122,000 | 805.80   | 904,107,600 | 貸付有価証券<br>5,800株 |
| K H ネオケム   | 27,700    | 2,594.00 | 71,853,800  | 貸付有価証券<br>5,400株 |
| ダイセル       | 244,500   | 930.00   | 227,385,000 |                  |
| 住友ベークライト   | 24,600    | 4,475.00 | 110,085,000 |                  |
| 積水化学工業     | 340,000   | 1,801.00 | 612,340,000 |                  |
| 日本ゼオン      | 99,700    | 1,284.00 | 128,014,800 |                  |
| アイカ工業      | 42,000    | 3,005.00 | 126,210,000 |                  |
| U B E      | 85,700    | 2,049.00 | 175,599,300 |                  |
| 積水樹脂       | 24,200    | 1,930.00 | 46,706,000  |                  |
| タキロンシーアイ   | 36,300    | 495.00   | 17,968,500  |                  |
| 旭有機材       | 11,100    | 2,803.00 | 31,113,300  |                  |
| ニチバン       | 10,300    | 1,798.00 | 18,519,400  | 貸付有価証券<br>100株   |
| リケンテクノス    | 35,800    | 544.00   | 19,475,200  | 貸付有価証券<br>100株   |
| 大倉工業       | 7,700     | 1,882.00 | 14,491,400  | 貸付有価証券<br>500株   |
| 積水化成成品工業   | 23,300    | 388.00   | 9,040,400   |                  |
| 群栄化学工業     | 3,900     | 2,486.00 | 9,695,400   |                  |
| タイガースポリマー  | 6,700     | 416.00   | 2,787,200   |                  |
| ミライアル      | 4,500     | 1,544.00 | 6,948,000   | 貸付有価証券<br>800株   |
| ダイキアクシス    | 5,400     | 686.00   | 3,704,400   | 貸付有価証券<br>2,600株 |
| ダイキョーニシカワ  | 36,700    | 625.00   | 22,937,500  |                  |

|                |         |          |               |                        |
|----------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| 竹本容器           | 5,000   | 833.00   | 4,165,000     |                        |
| 森六ホールディングス     | 8,400   | 1,808.00 | 15,187,200    | 貸付有価証券<br>100株         |
| 恵和             | 10,800  | 1,549.00 | 16,729,200    | 貸付有価証券<br>5,000株（200株） |
| 日本化薬           | 127,000 | 1,180.00 | 149,860,000   |                        |
| カーリットホールディングス  | 14,900  | 732.00   | 10,906,800    |                        |
| 日本精化           | 9,400   | 2,434.00 | 22,879,600    |                        |
| 扶桑化学工業         | 15,400  | 3,665.00 | 56,441,000    |                        |
| トリケミカル研究所      | 22,200  | 2,319.00 | 51,481,800    | 貸付有価証券<br>2,900株       |
| A D E K A      | 58,000  | 2,103.00 | 121,974,000   |                        |
| 日油             | 51,400  | 5,950.00 | 305,830,000   |                        |
| 新日本理化          | 20,400  | 215.00   | 4,386,000     | 貸付有価証券<br>700株         |
| ハリマ化成グループ      | 10,400  | 871.00   | 9,058,400     |                        |
| 花王             | 404,900 | 5,080.00 | 2,056,892,000 | 貸付有価証券<br>2,500株       |
| 第一工業製薬         | 6,000   | 1,945.00 | 11,670,000    |                        |
| 石原ケミカル         | 7,600   | 1,298.00 | 9,864,800     |                        |
| 日華化学           | 5,900   | 829.00   | 4,891,100     |                        |
| ニイタカ           | 2,700   | 2,038.00 | 5,502,600     |                        |
| 三洋化成工業         | 10,200  | 4,210.00 | 42,942,000    |                        |
| 有機合成薬品工業       | 10,900  | 290.00   | 3,161,000     | 貸付有価証券<br>600株         |
| 大日本塗料          | 20,300  | 822.00   | 16,686,600    |                        |
| 日本ペイントホールディングス | 735,700 | 1,254.00 | 922,567,800   | 貸付有価証券<br>16,200株      |
| 関西ペイント         | 152,300 | 1,839.00 | 280,079,700   | 貸付有価証券<br>3,200株       |
| 神東塗料           | 12,300  | 124.00   | 1,525,200     | 貸付有価証券<br>2,300株       |
| 中国塗料           | 27,300  | 1,092.00 | 29,811,600    |                        |
| 日本特殊塗料         | 9,400   | 915.00   | 8,601,000     |                        |
| 藤倉化成           | 22,300  | 435.00   | 9,700,500     |                        |
| 太陽ホールディングス     | 25,300  | 2,387.00 | 60,391,100    | 貸付有価証券<br>100株         |
| D I C          | 65,000  | 2,374.00 | 154,310,000   | 貸付有価証券                 |

|                  |         |           |               |                            |
|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
|                  |         |           |               | 5,300株                     |
| サカティンクス          | 37,000  | 1,014.00  | 37,518,000    | 貸付有価証券<br>1,200株           |
| 東洋インキＳＣホールディングス  | 32,600  | 1,866.00  | 60,831,600    | 貸付有価証券<br>100株             |
| T & K T O K A    | 14,800  | 1,277.00  | 18,899,600    | 貸付有価証券<br>6,900株（2,700株）   |
| 富士フイルムホールディングス   | 319,400 | 6,399.00  | 2,043,840,600 | 貸付有価証券<br>100株             |
| 資生堂              | 347,600 | 6,159.00  | 2,140,868,400 | 貸付有価証券<br>4,200株           |
| ライオン             | 199,700 | 1,463.00  | 292,161,100   |                            |
| 高砂香料工業           | 11,300  | 2,487.00  | 28,103,100    |                            |
| マンダム             | 36,000  | 1,431.00  | 51,516,000    |                            |
| ミルボン             | 24,700  | 5,740.00  | 141,778,000   |                            |
| ファンケル            | 72,800  | 2,524.00  | 183,747,200   | 貸付有価証券<br>34,100株（34,100株） |
| コーセー             | 33,900  | 15,310.00 | 519,009,000   | 貸付有価証券<br>2,200株           |
| コタ               | 13,900  | 1,695.00  | 23,560,500    | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| シーボン             | 1,900   | 1,608.00  | 3,055,200     |                            |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 85,300  | 1,757.00  | 149,872,100   | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| ノエビアホールディングス     | 14,800  | 5,540.00  | 81,992,000    |                            |
| アジュバンホールディングス    | 3,600   | 1,005.00  | 3,618,000     | 貸付有価証券<br>1,600株           |
| 新日本製薬            | 9,500   | 1,417.00  | 13,461,500    | 貸付有価証券<br>3,600株           |
| エステー             | 12,800  | 1,545.00  | 19,776,000    |                            |
| アグロ カネショウ        | 6,700   | 1,520.00  | 10,184,000    | 貸付有価証券<br>2,300株           |
| コニシ              | 27,800  | 1,785.00  | 49,623,000    |                            |
| 長谷川香料            | 34,500  | 2,943.00  | 101,533,500   | 貸付有価証券<br>1,500株           |
| 星光ＰＭＣ            | 7,500   | 534.00    | 4,005,000     |                            |
| 小林製薬             | 48,400  | 8,300.00  | 401,720,000   |                            |
| 荒川化学工業           | 14,100  | 982.00    | 13,846,200    |                            |
| メック              | 13,700  | 2,240.00  | 30,688,000    | 貸付有価証券<br>700株             |

|                  |         |          |               |                          |
|------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 日本高純度化学          | 4,100   | 2,427.00 | 9,950,700     |                          |
| タカラバイオ           | 44,800  | 1,761.00 | 78,892,800    | 貸付有価証券<br>300株           |
| J C U            | 18,800  | 3,065.00 | 57,622,000    |                          |
| 新田ゼラチン           | 9,100   | 807.00   | 7,343,700     | 貸付有価証券<br>3,200株（100株）   |
| O A T アグリオ       | 6,000   | 1,436.00 | 8,616,000     | 貸付有価証券<br>2,500株         |
| デクセリアルズ          | 48,100  | 2,717.00 | 130,687,700   |                          |
| アース製薬            | 15,100  | 4,800.00 | 72,480,000    |                          |
| 北興化学工業           | 16,800  | 818.00   | 13,742,400    |                          |
| 大成ラミック           | 5,200   | 2,880.00 | 14,976,000    |                          |
| クミアイ化学工業         | 66,100  | 857.00   | 56,647,700    | 貸付有価証券<br>6,300株         |
| 日本農薬             | 30,500  | 690.00   | 21,045,000    | 貸付有価証券<br>100株           |
| アキレス             | 10,800  | 1,248.00 | 13,478,400    |                          |
| 有沢製作所            | 27,300  | 1,400.00 | 38,220,000    |                          |
| 日東電工             | 120,800 | 8,390.00 | 1,013,512,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| レック              | 23,700  | 947.00   | 22,443,900    |                          |
| 三光合成             | 21,000  | 553.00   | 11,613,000    | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株） |
| きもと              | 21,800  | 198.00   | 4,316,400     | 貸付有価証券<br>4,800株         |
| 藤森工業             | 13,200  | 3,085.00 | 40,722,000    |                          |
| 前澤化成工業           | 10,700  | 1,380.00 | 14,766,000    | 貸付有価証券<br>3,200株         |
| 未来工業             | 6,000   | 1,498.00 | 8,988,000     |                          |
| ウェーブブロックホールディングス | 4,400   | 608.00   | 2,675,200     | 貸付有価証券<br>800株（800株）     |
| J S P            | 11,700  | 1,577.00 | 18,450,900    | 貸付有価証券<br>5,400株         |
| エフピコ             | 31,500  | 3,500.00 | 110,250,000   |                          |
| 天馬               | 14,100  | 2,264.00 | 31,922,400    |                          |
| 信越ポリマー           | 30,800  | 1,353.00 | 41,672,400    |                          |
| 東リ               | 33,200  | 252.00   | 8,366,400     |                          |
| ニフコ              | 60,100  | 3,490.00 | 209,749,000   |                          |
| バルカー             | 13,900  | 3,185.00 | 44,271,500    |                          |

|               |           |          |               |                        |
|---------------|-----------|----------|---------------|------------------------|
| ユニ・チャーム       | 346,800   | 5,050.00 | 1,751,340,000 | 貸付有価証券<br>7,300株       |
| ショーエイコーポレーション | 4,300     | 564.00   | 2,425,200     | 貸付有価証券<br>1,700株（200株） |
| 協和キリン         | 201,100   | 2,940.00 | 591,234,000   | 貸付有価証券<br>6,300株       |
| 武田薬品工業        | 1,473,200 | 4,182.00 | 6,160,922,400 | 貸付有価証券<br>2,500株       |
| アステラス製薬       | 1,595,400 | 1,927.00 | 3,074,335,800 | 貸付有価証券<br>19,700株      |
| 住友ファーマ        | 123,500   | 852.00   | 105,222,000   | 貸付有価証券<br>200株         |
| 塩野義製薬         | 212,700   | 6,147.00 | 1,307,466,900 |                        |
| わかもと製薬        | 13,800    | 225.00   | 3,105,000     | 貸付有価証券<br>500株（200株）   |
| 日本新薬          | 39,200    | 6,260.00 | 245,392,000   |                        |
| 中外製薬          | 521,100   | 3,556.00 | 1,853,031,600 | 貸付有価証券<br>14,000株      |
| 科研製薬          | 28,500    | 3,625.00 | 103,312,500   | 貸付有価証券<br>200株         |
| エーザイ          | 202,500   | 7,625.00 | 1,544,062,500 |                        |
| ロート製薬         | 161,300   | 2,624.00 | 423,251,200   |                        |
| 小野薬品工業        | 321,200   | 2,847.00 | 914,456,400   |                        |
| 久光製薬          | 37,000    | 3,885.00 | 143,745,000   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 持田製薬          | 19,900    | 3,405.00 | 67,759,500    |                        |
| 参天製薬          | 313,300   | 995.00   | 311,733,500   | 貸付有価証券<br>700株         |
| 扶桑薬品工業        | 5,300     | 1,970.00 | 10,441,000    |                        |
| 日本ケミファ        | 1,500     | 1,723.00 | 2,584,500     |                        |
| ツムラ           | 52,400    | 2,615.00 | 137,026,000   |                        |
| キッセイ薬品工業      | 25,700    | 2,526.00 | 64,918,200    |                        |
| 生化学工業         | 31,700    | 809.00   | 25,645,300    |                        |
| 栄研化学          | 27,000    | 1,563.00 | 42,201,000    |                        |
| 鳥居薬品          | 8,900     | 3,230.00 | 28,747,000    |                        |
| J C R ファーマ    | 56,300    | 1,557.00 | 87,659,100    | 貸付有価証券<br>1,600株       |
| 東和薬品          | 25,600    | 1,902.00 | 48,691,200    |                        |
| 富士製薬工業        | 10,800    | 1,042.00 | 11,253,600    |                        |
| ゼリア新薬工業       | 23,100    | 2,183.00 | 50,427,300    | 貸付有価証券                 |

|                  |           |          |               |                           |
|------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
|                  |           |          |               | 900株                      |
| 第一三共             | 1,450,300 | 4,300.00 | 6,236,290,000 | 貸付有価証券<br>9,300株          |
| キョーリン製薬ホールディングス  | 36,100    | 1,684.00 | 60,792,400    |                           |
| 大幸薬品             | 30,100    | 413.00   | 12,431,300    | 貸付有価証券<br>14,000株         |
| ダイト              | 11,600    | 2,455.00 | 28,478,000    |                           |
| 大塚ホールディングス       | 380,900   | 4,175.00 | 1,590,257,500 | 貸付有価証券<br>3,000株          |
| 大正製薬ホールディングス     | 37,000    | 5,390.00 | 199,430,000   |                           |
| ペプチドリーム          | 80,700    | 1,887.00 | 152,280,900   | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| あすか製薬ホールディングス    | 17,100    | 1,165.00 | 19,921,500    |                           |
| サワイグループホールディングス  | 38,100    | 3,785.00 | 144,208,500   |                           |
| 日本コークス工業         | 150,100   | 86.00    | 12,908,600    | 貸付有価証券<br>14,300株（6,700株） |
| ニチレキ             | 19,700    | 1,373.00 | 27,048,100    |                           |
| ユシロ化学工業          | 8,600     | 826.00   | 7,103,600     |                           |
| ビーピー・カストロール      | 5,700     | 896.00   | 5,107,200     |                           |
| 富士石油             | 34,000    | 253.00   | 8,602,000     | 貸付有価証券<br>5,800株          |
| MORESCO          | 4,800     | 1,211.00 | 5,812,800     | 貸付有価証券<br>2,400株（100株）    |
| 出光興産             | 184,900   | 3,095.00 | 572,265,500   | 貸付有価証券<br>400株            |
| ENEOSホールディングス    | 3,007,700 | 459.40   | 1,381,737,380 | 貸付有価証券<br>300株            |
| コスモエネルギーホールディングス | 65,800    | 3,830.00 | 252,014,000   |                           |
| 横浜ゴム             | 94,700    | 2,215.00 | 209,760,500   | 貸付有価証券<br>2,700株          |
| TOYO TIRE        | 95,700    | 1,569.00 | 150,153,300   | 貸付有価証券<br>12,200株         |
| ブリヂストン           | 531,600   | 5,148.00 | 2,736,676,800 | 貸付有価証券<br>30,100株         |
| 住友ゴム工業           | 163,300   | 1,219.00 | 199,062,700   | 貸付有価証券<br>700株            |
| 藤倉コンポジット         | 10,500    | 956.00   | 10,038,000    |                           |

|                |         |          |             |                          |
|----------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| オカモト           | 9,200   | 3,895.00 | 35,834,000  |                          |
| フコク            | 8,700   | 1,050.00 | 9,135,000   |                          |
| ニッタ            | 16,900  | 2,913.00 | 49,229,700  |                          |
| 住友理工           | 32,300  | 713.00   | 23,029,900  |                          |
| 三ツ星ベルト         | 24,300  | 3,835.00 | 93,190,500  |                          |
| バンドー化学         | 26,400  | 1,013.00 | 26,743,200  |                          |
| 日東紡績           | 19,800  | 2,100.00 | 41,580,000  |                          |
| A G C          | 169,400 | 4,920.00 | 833,448,000 |                          |
| 日本板硝子          | 84,900  | 678.00   | 57,562,200  | 貸付有価証券<br>9,600株         |
| 石塚硝子           | 2,300   | 1,445.00 | 3,323,500   | 貸付有価証券<br>1,000株（100株）   |
| 日本山村硝子         | 5,500   | 566.00   | 3,113,000   |                          |
| 日本電気硝子         | 68,000  | 2,455.00 | 166,940,000 | 貸付有価証券<br>10,000株        |
| オハラ            | 7,900   | 1,182.00 | 9,337,800   | 貸付有価証券<br>2,900株（1,900株） |
| 住友大阪セメント       | 23,400  | 3,760.00 | 87,984,000  |                          |
| 太平洋セメント        | 106,000 | 2,408.00 | 255,248,000 | 貸付有価証券<br>700株           |
| 日本ヒューム         | 14,600  | 658.00   | 9,606,800   |                          |
| 日本コンクリート工業     | 32,300  | 229.00   | 7,396,700   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 三谷セキサン         | 7,000   | 4,310.00 | 30,170,000  | 貸付有価証券<br>3,200株         |
| アジアパイルホールディングス | 26,000  | 633.00   | 16,458,000  |                          |
| 東海カーボン         | 139,600 | 1,291.00 | 180,223,600 |                          |
| 日本カーボン         | 9,500   | 4,135.00 | 39,282,500  |                          |
| 東洋炭素           | 10,400  | 4,195.00 | 43,628,000  | 貸付有価証券<br>700株           |
| ノリタケカンパニーリミテド  | 8,300   | 4,390.00 | 36,437,000  |                          |
| T O T O        | 109,900 | 4,560.00 | 501,144,000 | 貸付有価証券<br>300株           |
| 日本碍子           | 197,000 | 1,787.00 | 352,039,000 | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| 日本特殊陶業         | 126,700 | 2,733.00 | 346,271,100 |                          |
| ダントーホールディングス   | 10,400  | 376.00   | 3,910,400   | 貸付有価証券<br>5,300株         |

|                   |         |           |               |                        |
|-------------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| M A R U W A       | 6,100   | 17,530.00 | 106,933,000   | 貸付有価証券<br>200株         |
| 品川リフラクトリーズ        | 4,700   | 4,275.00  | 20,092,500    |                        |
| 黒崎播磨              | 3,400   | 6,320.00  | 21,488,000    |                        |
| ヨータイ              | 11,100  | 1,497.00  | 16,616,700    |                        |
| 東京窯業              | 13,500  | 303.00    | 4,090,500     | 貸付有価証券<br>100株         |
| ニッカトー             | 6,600   | 555.00    | 3,663,000     | 貸付有価証券<br>1,000株（100株） |
| フジミインコーポレー<br>テッド | 13,300  | 6,500.00  | 86,450,000    |                        |
| クニミネ工業            | 4,300   | 871.00    | 3,745,300     |                        |
| エーアンドエーマテリア<br>ル  | 2,700   | 912.00    | 2,462,400     |                        |
| ニチアス              | 42,100  | 2,573.00  | 108,323,300   |                        |
| ニチハ               | 20,900  | 2,641.00  | 55,196,900    |                        |
| 日本製鉄              | 766,900 | 3,050.00  | 2,339,045,000 | 貸付有価証券<br>32,700株      |
| 神戸製鋼所             | 344,400 | 877.00    | 302,038,800   | 貸付有価証券<br>500株         |
| 中山製鋼所             | 35,200  | 1,058.00  | 37,241,600    | 貸付有価証券<br>10,900株      |
| 合同製鐵              | 8,500   | 3,400.00  | 28,900,000    |                        |
| J F E ホールディングス    | 457,700 | 1,705.00  | 780,378,500   | 貸付有価証券<br>700株         |
| 東京製鐵              | 48,100  | 1,499.00  | 72,101,900    |                        |
| 共英製鋼              | 19,500  | 1,559.00  | 30,400,500    | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| 大和工業              | 28,200  | 5,270.00  | 148,614,000   | 貸付有価証券<br>500株         |
| 東京鐵鋼              | 8,100   | 1,762.00  | 14,272,200    | 貸付有価証券<br>3,800株       |
| 大阪製鐵              | 7,900   | 1,315.00  | 10,388,500    | 貸付有価証券<br>200株         |
| 淀川製鋼所             | 19,500  | 2,613.00  | 50,953,500    |                        |
| 中部鋼鈑              | 14,100  | 1,959.00  | 27,621,900    | 貸付有価証券<br>6,600株       |
| 丸一鋼管              | 52,100  | 2,808.00  | 146,296,800   | 貸付有価証券<br>300株         |
| モリ工業              | 3,500   | 2,945.00  | 10,307,500    |                        |
| 大同特殊鋼             | 21,600  | 5,150.00  | 111,240,000   |                        |

|                |         |          |               |                           |
|----------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| 日本高周波鋼業        | 5,100   | 336.00   | 1,713,600     |                           |
| 日本冶金工業         | 12,500  | 4,365.00 | 54,562,500    |                           |
| 山陽特殊製鋼         | 16,900  | 2,622.00 | 44,311,800    |                           |
| 愛知製鋼           | 9,900   | 2,293.00 | 22,700,700    |                           |
| 日本金属           | 3,300   | 935.00   | 3,085,500     |                           |
| 大平洋金属          | 12,200  | 1,985.00 | 24,217,000    |                           |
| 新日本電工          | 109,400 | 366.00   | 40,040,400    | 貸付有価証券<br>2,400株          |
| 栗本鐵工所          | 8,100   | 2,013.00 | 16,305,300    |                           |
| 虹技             | 1,800   | 1,005.00 | 1,809,000     |                           |
| 日本鑄鉄管          | 1,500   | 980.00   | 1,470,000     |                           |
| 三菱製鋼           | 10,700  | 1,215.00 | 13,000,500    |                           |
| 日垂鋼業           | 15,400  | 272.00   | 4,188,800     | 貸付有価証券<br>3,300株          |
| 日本精線           | 2,300   | 4,520.00 | 10,396,000    |                           |
| エンビプロ・ホールディングス | 10,500  | 712.00   | 7,476,000     | 貸付有価証券<br>4,900株（3,000株）  |
| シンニッタン         | 16,400  | 251.00   | 4,116,400     | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| 新家工業           | 3,300   | 2,379.00 | 7,850,700     |                           |
| 大紀アルミニウム工業所    | 24,400  | 1,419.00 | 34,623,600    | 貸付有価証券<br>3,900株          |
| 日本軽金属ホールディングス  | 46,200  | 1,431.00 | 66,112,200    |                           |
| 三井金属鉱業         | 49,800  | 3,375.00 | 168,075,000   | 貸付有価証券<br>200株            |
| 東邦亜鉛           | 10,100  | 2,053.00 | 20,735,300    |                           |
| 三菱マテリアル        | 114,300 | 2,130.00 | 243,459,000   |                           |
| 住友金属鉱山         | 198,600 | 5,183.00 | 1,029,343,800 | 貸付有価証券<br>14,100株         |
| DOWAホールディングス   | 38,500  | 4,490.00 | 172,865,000   |                           |
| 古河機械金属         | 25,100  | 1,369.00 | 34,361,900    |                           |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 25,100  | 3,190.00 | 80,069,000    | 貸付有価証券<br>11,700株（5,700株） |
| 東邦チタニウム        | 31,000  | 2,190.00 | 67,890,000    | 貸付有価証券<br>14,500株         |
| UACJ           | 24,000  | 2,468.00 | 59,232,000    | 貸付有価証券<br>9,000株          |
| CKサンエツ         | 4,100   | 4,125.00 | 16,912,500    |                           |

|                  |         |          |             |                        |
|------------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| 古河電気工業           | 57,000  | 2,399.00 | 136,743,000 | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| 住友電気工業           | 591,400 | 1,688.50 | 998,578,900 | 貸付有価証券<br>100株         |
| フジクラ             | 183,600 | 967.00   | 177,541,200 |                        |
| 昭和電線ホールディングス     | 19,100  | 1,921.00 | 36,691,100  |                        |
| タツタ電線            | 34,800  | 711.00   | 24,742,800  | 貸付有価証券<br>100株         |
| カナレ電気            | 2,400   | 1,302.00 | 3,124,800   | 貸付有価証券<br>900株（800株）   |
| 平河ヒューテック         | 9,800   | 1,363.00 | 13,357,400  | 貸付有価証券<br>4,600株       |
| リョービ             | 18,200  | 1,389.00 | 25,279,800  |                        |
| アーレスティ           | 16,800  | 538.00   | 9,038,400   |                        |
| アサヒホールディングス      | 69,300  | 1,965.00 | 136,174,500 | 貸付有価証券<br>500株         |
| 稲葉製作所            | 10,000  | 1,386.00 | 13,860,000  |                        |
| 宮地エンジニアリンググループ   | 4,700   | 3,645.00 | 17,131,500  |                        |
| トーカロ             | 47,100  | 1,241.00 | 58,451,100  | 貸付有価証券<br>300株         |
| アルファＣｏ           | 5,600   | 973.00   | 5,448,800   |                        |
| SUMCO            | 326,000 | 1,868.00 | 608,968,000 | 貸付有価証券<br>54,600株      |
| 川田テクノロジーズ        | 4,000   | 3,460.00 | 13,840,000  |                        |
| RS Technologies  | 11,400  | 3,565.00 | 40,641,000  |                        |
| ジェイテックコーポレーション   | 2,000   | 2,764.00 | 5,528,000   | 貸付有価証券<br>1,000株（700株） |
| 信和               | 8,400   | 745.00   | 6,258,000   |                        |
| 東洋製罐グループホールディングス | 113,300 | 1,712.00 | 193,969,600 |                        |
| ホッカンホールディングス     | 9,200   | 1,344.00 | 12,364,800  |                        |
| コロナ              | 9,600   | 910.00   | 8,736,000   |                        |
| 横河ブリッジホールディングス   | 22,600  | 2,017.00 | 45,584,200  |                        |
| 駒井ハルテック          | 2,500   | 1,634.00 | 4,085,000   |                        |
| 高田機工             | 1,200   | 2,630.00 | 3,156,000   |                        |
| 三和ホールディングス       | 157,700 | 1,413.00 | 222,830,100 |                        |

|            |         |          |             |                            |
|------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
|            |         |          |             | 貸付有価証券<br>400株             |
| 文化シャッター    | 49,300  | 1,138.00 | 56,103,400  | 貸付有価証券<br>23,100株（16,300株） |
| 三協立山       | 19,600  | 630.00   | 12,348,000  |                            |
| アルインコ      | 13,100  | 1,060.00 | 13,886,000  |                            |
| 東洋シャッター    | 3,500   | 510.00   | 1,785,000   | 貸付有価証券<br>100株             |
| L I X I L  | 249,500 | 2,131.00 | 531,684,500 |                            |
| 日本フィルコン    | 9,900   | 450.00   | 4,455,000   |                            |
| ノーリツ       | 25,200  | 1,573.00 | 39,639,600  |                            |
| 長府製作所      | 17,300  | 2,074.00 | 35,880,200  |                            |
| リンナイ       | 31,000  | 9,720.00 | 301,320,000 |                            |
| ダイニチ工業     | 7,600   | 667.00   | 5,069,200   |                            |
| 日東精工       | 24,800  | 500.00   | 12,400,000  | 貸付有価証券<br>200株             |
| 三洋工業       | 1,700   | 1,911.00 | 3,248,700   |                            |
| 岡部         | 27,500  | 714.00   | 19,635,000  | 貸付有価証券<br>100株             |
| ジーテクト      | 19,100  | 1,389.00 | 26,529,900  | 貸付有価証券<br>200株             |
| 東ブレ        | 30,200  | 1,168.00 | 35,273,600  | 貸付有価証券<br>200株             |
| 高周波熱錬      | 27,900  | 671.00   | 18,720,900  |                            |
| 東京製綱       | 10,100  | 1,253.00 | 12,655,300  | 貸付有価証券<br>700株             |
| サンコール      | 13,500  | 620.00   | 8,370,000   |                            |
| モリテック スチール | 11,200  | 324.00   | 3,628,800   | 貸付有価証券<br>5,200株           |
| パイオラックス    | 23,600  | 1,936.00 | 45,689,600  |                            |
| エイチワン      | 17,600  | 616.00   | 10,841,600  |                            |
| 日本発條       | 151,500 | 895.00   | 135,592,500 | 貸付有価証券<br>100株             |
| 中央発條       | 9,500   | 702.00   | 6,669,000   | 貸付有価証券<br>100株             |
| アドバネクス     | 1,900   | 1,063.00 | 2,019,700   | 貸付有価証券<br>400株             |
| 立川ブラインド工業  | 7,700   | 1,269.00 | 9,771,300   | 貸付有価証券<br>300株             |
| 三益半導体工業    | 13,200  | 2,531.00 | 33,409,200  |                            |

|             |         |           |               |                         |
|-------------|---------|-----------|---------------|-------------------------|
| 日本ドライケミカル   | 3,600   | 1,654.00  | 5,954,400     |                         |
| 日本製鋼所       | 46,200  | 2,615.00  | 120,813,000   |                         |
| 三浦工業        | 70,000  | 3,390.00  | 237,300,000   |                         |
| タクマ         | 51,500  | 1,361.00  | 70,091,500    |                         |
| ツガミ         | 37,200  | 1,445.00  | 53,754,000    | 貸付有価証券<br>2,100株        |
| オークマ        | 16,800  | 5,180.00  | 87,024,000    |                         |
| 芝浦機械        | 16,700  | 2,882.00  | 48,129,400    |                         |
| アマダ         | 267,500 | 1,194.00  | 319,395,000   | 貸付有価証券<br>600株          |
| アイダエンジニアリング | 34,500  | 780.00    | 26,910,000    | 貸付有価証券<br>100株          |
| TAKISAWA    | 3,900   | 1,106.00  | 4,313,400     |                         |
| FUJII       | 72,900  | 2,042.00  | 148,861,800   | 貸付有価証券<br>100株          |
| 牧野フライス製作所   | 18,500  | 4,690.00  | 86,765,000    |                         |
| オーエスジー      | 80,000  | 1,940.00  | 155,200,000   |                         |
| ダイジェット工業    | 1,500   | 818.00    | 1,227,000     | 貸付有価証券<br>700株          |
| 旭ダイヤモンド工業   | 46,800  | 767.00    | 35,895,600    |                         |
| DMG森精機      | 101,600 | 2,131.00  | 216,509,600   | 貸付有価証券<br>37,700株（100株） |
| ソディック       | 46,200  | 735.00    | 33,957,000    |                         |
| ディスコ        | 26,900  | 40,300.00 | 1,084,070,000 |                         |
| 日東工器        | 8,100   | 1,675.00  | 13,567,500    |                         |
| 日進工具        | 14,000  | 1,078.00  | 15,092,000    |                         |
| パンチ工業       | 13,000  | 450.00    | 5,850,000     | 貸付有価証券<br>100株          |
| 富士ダイス       | 7,000   | 582.00    | 4,074,000     | 貸付有価証券<br>100株          |
| 豊和工業        | 8,100   | 976.00    | 7,905,600     |                         |
| ニデックオーケー    | 6,000   | 895.00    | 5,370,000     |                         |
| 東洋機械金属      | 10,300  | 557.00    | 5,737,100     | 貸付有価証券<br>100株          |
| 津田駒工業       | 2,700   | 507.00    | 1,368,900     | 貸付有価証券<br>1,200株（300株）  |
| エンシュウ       | 3,200   | 701.00    | 2,243,200     | 貸付有価証券<br>100株（100株）    |
| 島精機製作所      | 26,700  | 1,843.00  | 49,208,100    | 貸付有価証券                  |

|                |         |           |               |                          |
|----------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
|                |         |           |               | 1,700株                   |
| オプトラン          | 24,800  | 2,041.00  | 50,616,800    |                          |
| N C ホールディングス   | 3,000   | 1,934.00  | 5,802,000     |                          |
| イワキポンプ         | 11,200  | 1,274.00  | 14,268,800    |                          |
| フリー            | 17,600  | 1,181.00  | 20,785,600    |                          |
| ヤマシンフィルタ       | 40,000  | 401.00    | 16,040,000    | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株） |
| 日阪製作所          | 16,300  | 908.00    | 14,800,400    |                          |
| やまびこ           | 27,400  | 1,231.00  | 33,729,400    | 貸付有価証券<br>400株           |
| 野村マイクロ・サイエンス   | 5,700   | 4,465.00  | 25,450,500    |                          |
| 平田機工           | 8,000   | 6,490.00  | 51,920,000    |                          |
| ペガサスミシン製造      | 18,500  | 667.00    | 12,339,500    | 貸付有価証券<br>2,900株（2,600株） |
| マルマエ           | 8,100   | 1,860.00  | 15,066,000    | 貸付有価証券<br>3,800株         |
| タツモ            | 9,200   | 1,658.00  | 15,253,600    | 貸付有価証券<br>100株           |
| ナプテスコ          | 105,200 | 3,655.00  | 384,506,000   |                          |
| 三井海洋開発         | 21,000  | 1,523.00  | 31,983,000    |                          |
| レオン自動機         | 17,600  | 1,195.00  | 21,032,000    | 貸付有価証券<br>200株           |
| S M C          | 54,400  | 67,100.00 | 3,650,240,000 |                          |
| ホソカワミクロン       | 12,800  | 2,617.00  | 33,497,600    |                          |
| ユニオンツール        | 7,400   | 3,230.00  | 23,902,000    | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| オイレス工業         | 23,400  | 1,618.00  | 37,861,200    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日精エー・エス・ピー機械   | 7,600   | 4,260.00  | 32,376,000    |                          |
| サトーホールディングス    | 23,800  | 2,288.00  | 54,454,400    |                          |
| 技研製作所          | 17,500  | 2,796.00  | 48,930,000    |                          |
| 日本エアーテック       | 8,500   | 1,096.00  | 9,316,000     |                          |
| カワタ            | 4,300   | 847.00    | 3,642,100     |                          |
| 日精樹脂工業         | 12,400  | 968.00    | 12,003,200    |                          |
| オカダアイヨン        | 4,600   | 1,598.00  | 7,350,800     | 貸付有価証券<br>800株           |
| ワイエイシイホールディングス | 6,300   | 2,238.00  | 14,099,400    | 貸付有価証券<br>2,900株（1,200株） |

|              |         |           |               |                        |
|--------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| 小松製作所        | 785,500 | 3,262.00  | 2,562,301,000 | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| 住友重機械工業      | 99,200  | 2,923.00  | 289,961,600   | 貸付有価証券<br>10,400株      |
| 日立建機         | 66,800  | 3,065.00  | 204,742,000   |                        |
| 日工           | 24,800  | 627.00    | 15,549,600    |                        |
| 巴工業          | 7,200   | 2,401.00  | 17,287,200    | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| 井関農機         | 15,700  | 1,172.00  | 18,400,400    | 貸付有価証券<br>100株         |
| T O W A      | 17,100  | 1,795.00  | 30,694,500    | 貸付有価証券<br>2,600株       |
| 丸山製作所        | 2,500   | 1,688.00  | 4,220,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| 北川鉄工所        | 6,600   | 1,106.00  | 7,299,600     |                        |
| ローツェ         | 8,800   | 10,210.00 | 89,848,000    | 貸付有価証券<br>500株（400株）   |
| タカキタ         | 4,200   | 446.00    | 1,873,200     | 貸付有価証券<br>2,500株（200株） |
| クボタ          | 887,100 | 2,047.00  | 1,815,893,700 | 貸付有価証券<br>19,500株      |
| 荏原実業         | 8,000   | 2,860.00  | 22,880,000    |                        |
| 三菱化工機        | 5,400   | 2,205.00  | 11,907,000    |                        |
| 月島機械         | 22,700  | 1,118.00  | 25,378,600    | 貸付有価証券<br>100株         |
| 帝国電機製作所      | 12,100  | 2,568.00  | 31,072,800    |                        |
| 東京機械製作所      | 3,500   | 559.00    | 1,956,500     | 貸付有価証券<br>100株         |
| 新東工業         | 33,900  | 740.00    | 25,086,000    |                        |
| 澁谷工業         | 15,700  | 2,382.00  | 37,397,400    |                        |
| アイチ コーポレーション | 23,700  | 773.00    | 18,320,100    |                        |
| 小森コーポレーション   | 38,800  | 869.00    | 33,717,200    |                        |
| 鶴見製作所        | 12,800  | 2,002.00  | 25,625,600    |                        |
| 住友精密工業       | 1,100   | 3,635.00  | 3,998,500     | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| 日本ギア工業       | 5,000   | 482.00    | 2,410,000     |                        |
| 酒井重工業        | 2,400   | 3,735.00  | 8,964,000     |                        |
| 荏原製作所        | 68,600  | 5,550.00  | 380,730,000   |                        |
| 石井鐵工所        | 1,700   | 2,319.00  | 3,942,300     |                        |

|                 |         |           |               |                   |
|-----------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 西島製作所           | 14,500  | 1,510.00  | 21,895,000    |                   |
| 北越工業            | 16,900  | 1,426.00  | 24,099,400    |                   |
| ダイキン工業          | 200,100 | 23,085.00 | 4,619,308,500 | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| オルガノ            | 23,000  | 3,355.00  | 77,165,000    |                   |
| トーヨーカネツ         | 6,400   | 2,625.00  | 16,800,000    |                   |
| 栗田工業            | 93,800  | 6,020.00  | 564,676,000   | 貸付有価証券<br>2,000株  |
| 椿本チエイン          | 23,800  | 3,075.00  | 73,185,000    |                   |
| 大同工業            | 6,000   | 740.00    | 4,440,000     |                   |
| 木村化工機           | 12,800  | 725.00    | 9,280,000     | 貸付有価証券<br>2,400株  |
| アネスト岩田          | 28,500  | 910.00    | 25,935,000    | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| ダイフク            | 86,400  | 7,270.00  | 628,128,000   | 貸付有価証券<br>300株    |
| サムコ             | 5,500   | 3,490.00  | 19,195,000    |                   |
| 加藤製作所           | 7,000   | 860.00    | 6,020,000     |                   |
| 油研工業            | 2,200   | 1,957.00  | 4,305,400     |                   |
| タダノ             | 88,400  | 1,005.00  | 88,842,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| フジテック           | 61,400  | 3,265.00  | 200,471,000   | 貸付有価証券<br>12,500株 |
| C K D           | 46,400  | 2,018.00  | 93,635,200    |                   |
| 平和              | 55,800  | 2,342.00  | 130,683,600   |                   |
| 理想科学工業          | 14,900  | 2,370.00  | 35,313,000    | 貸付有価証券<br>100株    |
| S A N K Y O     | 32,900  | 5,630.00  | 185,227,000   |                   |
| 日本金銭機械          | 18,400  | 1,247.00  | 22,944,800    | 貸付有価証券<br>100株    |
| マースグループホールディングス | 9,900   | 2,499.00  | 24,740,100    |                   |
| フクシマガリレイ        | 12,300  | 4,275.00  | 52,582,500    |                   |
| オーイズミ           | 5,600   | 478.00    | 2,676,800     |                   |
| ダイコク電機          | 9,200   | 2,616.00  | 24,067,200    | 貸付有価証券<br>2,600株  |
| 竹内製作所           | 30,400  | 2,926.00  | 88,950,400    |                   |
| アマノ             | 47,600  | 2,476.00  | 117,857,600   |                   |
| J U K I         | 26,000  | 629.00    | 16,354,000    |                   |

|                  |         |          |             |                   |
|------------------|---------|----------|-------------|-------------------|
| ジャノメ             | 17,000  | 613.00   | 10,421,000  |                   |
| マックス             | 20,700  | 2,119.00 | 43,863,300  |                   |
| グローリー            | 43,500  | 2,651.00 | 115,318,500 |                   |
| 新晃工業             | 16,900  | 1,538.00 | 25,992,200  | 貸付有価証券<br>100株    |
| 大和冷機工業           | 25,700  | 1,207.00 | 31,019,900  |                   |
| セガサミーホールディングス    | 134,800 | 2,396.00 | 322,980,800 | 貸付有価証券<br>500株    |
| 日本ピストンリング        | 5,000   | 1,290.00 | 6,450,000   |                   |
| リケン              | 6,600   | 2,550.00 | 16,830,000  | 貸付有価証券<br>100株    |
| T P R            | 19,200  | 1,372.00 | 26,342,400  | 貸付有価証券<br>100株    |
| ツバキ・ナカシマ         | 41,300  | 1,069.00 | 44,149,700  | 貸付有価証券<br>100株    |
| ホシザキ             | 107,900 | 4,655.00 | 502,274,500 | 貸付有価証券<br>300株    |
| 大豊工業             | 14,500  | 631.00   | 9,149,500   |                   |
| 日本精工             | 308,000 | 741.00   | 228,228,000 | 貸付有価証券<br>100株    |
| N T N            | 330,500 | 334.00   | 110,387,000 | 貸付有価証券<br>4,900株  |
| ジェイテクト           | 149,200 | 1,016.00 | 151,587,200 | 貸付有価証券<br>800株    |
| 不二越              | 12,400  | 3,855.00 | 47,802,000  |                   |
| 日本トムソン           | 41,100  | 623.00   | 25,605,300  |                   |
| T H K            | 96,700  | 2,857.00 | 276,271,900 | 貸付有価証券<br>7,200株  |
| ユーシン精機           | 13,300  | 712.00   | 9,469,600   |                   |
| 前澤給装工業           | 11,800  | 965.00   | 11,387,000  |                   |
| イーグル工業           | 18,500  | 1,163.00 | 21,515,500  |                   |
| 前澤工業             | 8,500   | 624.00   | 5,304,000   | 貸付有価証券<br>100株    |
| 日本ピラー工業          | 15,500  | 3,340.00 | 51,770,000  |                   |
| キッツ              | 61,700  | 872.00   | 53,802,400  | 貸付有価証券<br>500株    |
| マキタ              | 208,600 | 3,505.00 | 731,143,000 | 貸付有価証券<br>5,500株  |
| 三井E & S ホールディングス | 76,600  | 428.00   | 32,784,800  | 貸付有価証券<br>14,500株 |

|                |           |           |               |                          |
|----------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| 日立造船           | 137,400   | 887.00    | 121,873,800   |                          |
| 三菱重工業          | 293,200   | 5,084.00  | 1,490,628,800 |                          |
| I H I          | 105,600   | 3,695.00  | 390,192,000   | 貸付有価証券<br>4,100株         |
| サノヤホールディングス    | 19,900    | 129.00    | 2,567,100     | 貸付有価証券<br>5,700株（1,600株） |
| スター精密          | 31,600    | 1,624.00  | 51,318,400    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日清紡ホールディングス    | 136,500   | 983.00    | 134,179,500   | 貸付有価証券<br>3,200株         |
| イビデン           | 96,200    | 4,565.00  | 439,153,000   | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| コニカミノルタ        | 374,400   | 587.00    | 219,772,800   | 貸付有価証券<br>26,300株        |
| ブラザー工業         | 224,000   | 1,989.00  | 445,536,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| ミネベアミツミ        | 291,600   | 2,420.00  | 705,672,000   | 貸付有価証券<br>900株           |
| 日立製作所          | 815,200   | 6,988.00  | 5,696,617,600 | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| 東芝             | 322,600   | 4,340.00  | 1,400,084,000 |                          |
| 三菱電機           | 1,732,700 | 1,529.00  | 2,649,298,300 | 貸付有価証券<br>11,100株        |
| 富士電機           | 101,900   | 5,230.00  | 532,937,000   | 貸付有価証券<br>200株           |
| 東洋電機製造         | 4,800     | 874.00    | 4,195,200     | 貸付有価証券<br>400株           |
| 安川電機           | 198,600   | 5,130.00  | 1,018,818,000 |                          |
| シンフォニアテクノロジー   | 18,500    | 1,615.00  | 29,877,500    |                          |
| 明電舎            | 25,400    | 1,919.00  | 48,742,600    |                          |
| オリジン           | 3,300     | 1,251.00  | 4,128,300     |                          |
| 山洋電気           | 7,200     | 5,600.00  | 40,320,000    |                          |
| デンヨー           | 12,800    | 1,562.00  | 19,993,600    |                          |
| P H C ホールディングス | 23,300    | 1,409.00  | 32,829,700    |                          |
| ソシオネクスト        | 17,200    | 8,260.00  | 142,072,000   |                          |
| 東芝テック          | 25,000    | 3,810.00  | 95,250,000    | 貸付有価証券<br>600株           |
| 芝浦メカトロニクス      | 3,200     | 13,380.00 | 42,816,000    |                          |
| マブチモーター        | 41,600    | 3,765.00  | 156,624,000   |                          |

|                      |         |           |               |                            |
|----------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| 日本電産                 | 407,100 | 7,025.00  | 2,859,877,500 |                            |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス    | 12,300  | 470.00    | 5,781,000     | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| トレックス・セミコンダクター       | 7,900   | 2,519.00  | 19,900,100    | 貸付有価証券<br>3,700株（3,700株）   |
| 東光高岳                 | 10,100  | 2,012.00  | 20,321,200    |                            |
| ダブル・スコープ             | 54,800  | 1,375.00  | 75,350,000    | 貸付有価証券<br>25,700株（23,200株） |
| ダイヘン                 | 15,100  | 4,190.00  | 63,269,000    |                            |
| ヤーマン                 | 29,000  | 1,408.00  | 40,832,000    | 貸付有価証券<br>9,900株（2,000株）   |
| JVCケンウッド             | 152,700 | 389.00    | 59,400,300    | 貸付有価証券<br>4,700株           |
| ミマキエンジニアリング          | 15,900  | 561.00    | 8,919,900     |                            |
| I - P E X            | 9,300   | 1,182.00  | 10,992,600    | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| 日新電機                 | 40,200  | 1,696.00  | 68,179,200    | 貸付有価証券<br>1,500株           |
| 大崎電気工業               | 39,800  | 526.00    | 20,934,800    |                            |
| オムロン                 | 153,600 | 7,305.00  | 1,122,048,000 |                            |
| 日東工業                 | 22,600  | 2,622.00  | 59,257,200    |                            |
| I D E C              | 24,700  | 3,280.00  | 81,016,000    |                            |
| 正興電機製作所              | 5,600   | 978.00    | 5,476,800     | 貸付有価証券<br>300株             |
| 不二電機工業               | 3,000   | 1,111.00  | 3,333,000     | 貸付有価証券<br>500株             |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション    | 55,000  | 2,461.00  | 135,355,000   | 貸付有価証券<br>200株             |
| サクサホールディングス          | 3,100   | 1,454.00  | 4,507,400     |                            |
| メルコホールディングス          | 4,500   | 3,290.00  | 14,805,000    | 貸付有価証券<br>900株             |
| テクノメディカ              | 4,100   | 1,736.00  | 7,117,600     | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 5,600   | 923.00    | 5,168,800     |                            |
| 日本電気                 | 237,100 | 4,770.00  | 1,130,967,000 |                            |
| 富士通                  | 167,000 | 17,695.00 | 2,955,065,000 | 貸付有価証券<br>600株             |
| 沖電気工業                | 75,800  | 711.00    | 53,893,800    |                            |
| 岩崎通信機                | 6,500   | 782.00    | 5,083,000     |                            |

|                 |           |           |                |                           |
|-----------------|-----------|-----------|----------------|---------------------------|
| 電気興業            | 6,800     | 2,107.00  | 14,327,600     |                           |
| サンケン電気          | 15,600    | 8,750.00  | 136,500,000    |                           |
| ナカヨ             | 2,400     | 1,177.00  | 2,824,800      | 貸付有価証券<br>100株            |
| アイホン            | 10,200    | 1,941.00  | 19,798,200     |                           |
| ルネサスエレクトロニクス    | 1,093,800 | 1,706.00  | 1,866,022,800  |                           |
| セイコーエプソン        | 223,300   | 1,853.00  | 413,774,900    | 貸付有価証券<br>1,900株          |
| ワコム             | 132,800   | 662.00    | 87,913,600     |                           |
| アルバック           | 39,800    | 5,230.00  | 208,154,000    | 貸付有価証券<br>3,000株          |
| アクセル            | 5,600     | 1,752.00  | 9,811,200      | 貸付有価証券<br>300株（300株）      |
| E I Z O         | 12,300    | 3,685.00  | 45,325,500     |                           |
| 日本信号            | 38,200    | 1,028.00  | 39,269,600     | 貸付有価証券<br>200株            |
| 京三製作所           | 35,100    | 409.00    | 14,355,900     | 貸付有価証券<br>1,600株          |
| 能美防災            | 22,700    | 1,675.00  | 38,022,500     |                           |
| ホーチキ            | 12,500    | 1,439.00  | 17,987,500     |                           |
| 星和電機            | 5,900     | 457.00    | 2,696,300      | 貸付有価証券<br>300株            |
| エレコム            | 40,100    | 1,312.00  | 52,611,200     |                           |
| パナソニック ホールディングス | 1,980,300 | 1,203.50  | 2,383,291,050  |                           |
| シャープ            | 201,900   | 969.00    | 195,641,100    | 貸付有価証券<br>76,600株（9,600株） |
| アンリツ            | 118,100   | 1,251.00  | 147,743,100    |                           |
| 富士通ゼネラル         | 47,500    | 3,710.00  | 176,225,000    |                           |
| ソニーグループ         | 1,174,200 | 11,480.00 | 13,479,816,000 | 貸付有価証券<br>6,400株          |
| T D K           | 265,500   | 4,595.00  | 1,219,972,500  | 貸付有価証券<br>400株            |
| 帝国通信工業          | 7,600     | 1,451.00  | 11,027,600     |                           |
| タムラ製作所          | 71,900    | 753.00    | 54,140,700     | 貸付有価証券<br>600株            |
| アルプスアルパイン       | 149,700   | 1,443.00  | 216,017,100    | 貸付有価証券<br>300株            |
| 池上通信機           | 4,700     | 601.00    | 2,824,700      |                           |

|                     |         |           |             |                          |
|---------------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
| 日本電波工業              | 20,100  | 1,417.00  | 28,481,700  | 貸付有価証券<br>100株           |
| 鈴木                  | 8,900   | 1,004.00  | 8,935,600   |                          |
| メイコー                | 18,300  | 2,801.00  | 51,258,300  | 貸付有価証券<br>7,700株         |
| 日本トリム               | 3,800   | 2,845.00  | 10,811,000  |                          |
| ローランド ディー .<br>ジー . | 9,400   | 3,055.00  | 28,717,000  |                          |
| フォスター電機             | 15,500  | 947.00    | 14,678,500  |                          |
| S M K               | 4,000   | 2,497.00  | 9,988,000   |                          |
| ヨコオ                 | 13,300  | 2,030.00  | 26,999,000  |                          |
| ティアック               | 23,000  | 117.00    | 2,691,000   | 貸付有価証券<br>1,000株（700株）   |
| ホシデン                | 40,200  | 1,589.00  | 63,877,800  | 貸付有価証券<br>100株           |
| ヒロセ電機               | 27,700  | 16,920.00 | 468,684,000 |                          |
| 日本航空電子工業            | 34,400  | 2,266.00  | 77,950,400  | 貸付有価証券<br>9,500株（9,500株） |
| T O A               | 19,100  | 777.00    | 14,840,700  | 貸付有価証券<br>100株           |
| マクセル                | 36,400  | 1,462.00  | 53,216,800  |                          |
| 古野電気                | 21,800  | 933.00    | 20,339,400  |                          |
| スミダコーポレーション         | 15,300  | 1,684.00  | 25,765,200  |                          |
| アイコム                | 6,500   | 2,565.00  | 16,672,500  | 貸付有価証券<br>200株           |
| リオン                 | 6,900   | 1,848.00  | 12,751,200  |                          |
| 横河電機                | 183,400 | 2,086.00  | 382,572,400 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 新電元工業               | 6,400   | 3,445.00  | 22,048,000  | 貸付有価証券<br>600株           |
| アズビル                | 116,000 | 3,600.00  | 417,600,000 | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| 東亜ディーケーケー           | 6,900   | 786.00    | 5,423,400   | 貸付有価証券<br>400株（300株）     |
| 日本光電工業              | 76,700  | 3,385.00  | 259,629,500 | 貸付有価証券<br>100株           |
| チノー                 | 6,900   | 1,905.00  | 13,144,500  | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| 共和電業                | 13,900  | 333.00    | 4,628,700   |                          |
| 日本電子材料              | 11,000  | 1,508.00  | 16,588,000  |                          |

|                     |         |           |               |                          |
|---------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| 堀場製作所               | 37,000  | 7,030.00  | 260,110,000   | 貸付有価証券<br>3,100株         |
| アドバンテスト             | 130,800 | 10,050.00 | 1,314,540,000 | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| 小野測器                | 5,500   | 405.00    | 2,227,500     |                          |
| エスベック               | 13,300  | 2,006.00  | 26,679,800    |                          |
| キーエンス               | 166,100 | 58,870.00 | 9,778,307,000 | 貸付有価証券<br>500株           |
| 日置電機                | 8,700   | 7,970.00  | 69,339,000    |                          |
| シスメックス              | 143,200 | 8,355.00  | 1,196,436,000 |                          |
| 日本マイクロニクス           | 27,300  | 1,301.00  | 35,517,300    |                          |
| メガチップス              | 13,600  | 2,874.00  | 39,086,400    |                          |
| O B A R A G R O U P | 7,800   | 3,875.00  | 30,225,000    | 貸付有価証券<br>4,000株（4,000株） |
| 澤藤電機                | 1,700   | 1,140.00  | 1,938,000     |                          |
| 原田工業                | 6,500   | 858.00    | 5,577,000     | 貸付有価証券<br>3,000株（400株）   |
| コーセル                | 20,000  | 1,081.00  | 21,620,000    |                          |
| イリソ電子工業             | 15,300  | 4,855.00  | 74,281,500    |                          |
| オブテックスグループ          | 30,500  | 2,032.00  | 61,976,000    |                          |
| 千代田インテグレ            | 5,800   | 2,168.00  | 12,574,400    |                          |
| レーザーテック             | 76,100  | 22,285.00 | 1,695,888,500 |                          |
| スタンレー電気             | 118,100 | 2,862.00  | 338,002,200   |                          |
| 岩崎電気                | 5,300   | 4,450.00  | 23,585,000    | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| ウシオ電機               | 86,700  | 1,554.00  | 134,731,800   | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| 岡谷電機産業              | 11,400  | 285.00    | 3,249,000     | 貸付有価証券<br>4,900株（800株）   |
| ヘリオス テクノ ホールディング    | 13,600  | 402.00    | 5,467,200     | 貸付有価証券<br>6,300株（1,400株） |
| エノモト                | 3,800   | 1,800.00  | 6,840,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| 日本セラミック             | 16,900  | 2,740.00  | 46,306,000    |                          |
| 遠藤照明                | 6,600   | 770.00    | 5,082,000     |                          |
| 古河電池                | 12,200  | 1,135.00  | 13,847,000    | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株） |
| 双信電機                | 5,900   | 371.00    | 2,188,900     |                          |
| 山一電機                | 14,500  | 1,784.00  | 25,868,000    |                          |

|                         |         |           |               |                          |
|-------------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| 図研                      | 14,400  | 3,480.00  | 50,112,000    |                          |
| 日本電子                    | 41,600  | 4,020.00  | 167,232,000   |                          |
| カシオ計算機                  | 123,700 | 1,355.00  | 167,613,500   | 貸付有価証券<br>100株           |
| ファナック                   | 162,900 | 22,760.00 | 3,707,604,000 | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| 日本シイエムケイ                | 35,200  | 501.00    | 17,635,200    |                          |
| エンプラス                   | 4,800   | 3,890.00  | 18,672,000    |                          |
| 大真空                     | 20,200  | 751.00    | 15,170,200    | 貸付有価証券<br>3,300株（1,800株） |
| ローム                     | 76,700  | 10,590.00 | 812,253,000   |                          |
| 浜松ホトニクス                 | 133,200 | 6,640.00  | 884,448,000   |                          |
| 三井ハイテック                 | 17,100  | 6,910.00  | 118,161,000   | 貸付有価証券<br>6,300株         |
| 新光電気工業                  | 58,700  | 3,790.00  | 222,473,000   |                          |
| 京セラ                     | 257,800 | 6,626.00  | 1,708,182,800 |                          |
| 太陽誘電                    | 80,800  | 4,195.00  | 338,956,000   |                          |
| 村田製作所                   | 503,400 | 7,515.00  | 3,783,051,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 双葉電子工業                  | 31,600  | 549.00    | 17,348,400    |                          |
| 北陸電気工業                  | 5,500   | 1,385.00  | 7,617,500     |                          |
| ニチコン                    | 33,900  | 1,312.00  | 44,476,800    | 貸付有価証券<br>10,000株        |
| 日本ケミコン                  | 16,400  | 2,108.00  | 34,571,200    | 貸付有価証券<br>700株（700株）     |
| K O A                   | 25,100  | 1,865.00  | 46,811,500    |                          |
| 市光工業                    | 23,900  | 442.00    | 10,563,800    | 貸付有価証券<br>200株           |
| 小糸製作所                   | 199,600 | 2,283.00  | 455,686,800   |                          |
| ミツバ                     | 31,100  | 500.00    | 15,550,000    | 貸付有価証券<br>100株           |
| S C R E E Nホールディ<br>ングス | 28,400  | 10,290.00 | 292,236,000   |                          |
| キャノン電子                  | 18,300  | 1,737.00  | 31,787,100    |                          |
| キャノン                    | 910,700 | 2,933.00  | 2,671,083,100 | 貸付有価証券<br>8,100株         |
| リコー                     | 416,200 | 1,031.00  | 429,102,200   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 象印マホービン                 | 49,600  | 1,618.00  | 80,252,800    | 貸付有価証券<br>5,700株（100株）   |

|               |           |           |                |                           |
|---------------|-----------|-----------|----------------|---------------------------|
| MUTOHホールディングス | 2,000     | 1,651.00  | 3,302,000      | 貸付有価証券<br>200株            |
| 東京エレクトロン      | 117,100   | 46,190.00 | 5,408,849,000  | 貸付有価証券<br>400株            |
| イノテック         | 11,100    | 1,312.00  | 14,563,200     |                           |
| トヨタ紡織         | 69,900    | 2,093.00  | 146,300,700    |                           |
| 芦森工業          | 2,700     | 1,448.00  | 3,909,600      | 貸付有価証券<br>500株（500株）      |
| ユニプレス         | 29,800    | 753.00    | 22,439,400     |                           |
| 豊田自動織機        | 121,400   | 7,770.00  | 943,278,000    |                           |
| モリタホールディングス   | 29,100    | 1,184.00  | 34,454,400     |                           |
| 三櫻工業          | 25,300    | 675.00    | 17,077,500     |                           |
| デンソー          | 342,400   | 7,404.00  | 2,535,129,600  |                           |
| 東海理化電機製作所     | 46,800    | 1,511.00  | 70,714,800     |                           |
| 川崎重工業         | 125,100   | 3,040.00  | 380,304,000    | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| 名村造船所         | 37,800    | 354.00    | 13,381,200     | 貸付有価証券<br>15,500株（1,200株） |
| 日本車輛製造        | 6,400     | 1,951.00  | 12,486,400     |                           |
| 三菱ロジスネクスト     | 26,500    | 835.00    | 22,127,500     |                           |
| 近畿車輛          | 2,100     | 1,167.00  | 2,450,700      | 貸付有価証券<br>500株            |
| 日産自動車         | 2,357,900 | 518.70    | 1,223,042,730  | 貸付有価証券<br>3,200株          |
| いすゞ自動車        | 482,600   | 1,641.00  | 791,946,600    |                           |
| トヨタ自動車        | 9,114,400 | 1,907.50  | 17,385,718,000 | 貸付有価証券<br>59,000株         |
| 日野自動車         | 214,000   | 568.00    | 121,552,000    | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| 三菱自動車工業       | 647,500   | 540.00    | 349,650,000    | 貸付有価証券<br>400株            |
| エフテック         | 10,200    | 589.00    | 6,007,800      |                           |
| レシップホールディングス  | 5,800     | 467.00    | 2,708,600      | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| GMB           | 2,900     | 771.00    | 2,235,900      |                           |
| ファルテック        | 2,300     | 592.00    | 1,361,600      |                           |
| 武蔵精密工業        | 40,600    | 1,826.00  | 74,135,600     | 貸付有価証券<br>7,200株（1,000株）  |
| 日産車体          | 29,300    | 896.00    | 26,252,800     | 貸付有価証券<br>1,700株          |

|             |           |          |               |                          |
|-------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| 新明和工業       | 52,100    | 1,073.00 | 55,903,300    |                          |
| 極東開発工業      | 29,200    | 1,447.00 | 42,252,400    | 貸付有価証券<br>900株           |
| トピー工業       | 13,500    | 1,795.00 | 24,232,500    |                          |
| ティラド        | 4,200     | 2,222.00 | 9,332,400     |                          |
| タチエス        | 26,300    | 1,227.00 | 32,270,100    |                          |
| N O K       | 64,500    | 1,264.00 | 81,528,000    | 貸付有価証券<br>8,600株         |
| フタバ産業       | 44,500    | 401.00   | 17,844,500    |                          |
| K Y B       | 16,000    | 3,645.00 | 58,320,000    |                          |
| 大同メタル工業     | 32,400    | 501.00   | 16,232,400    |                          |
| プレス工業       | 74,100    | 449.00   | 33,270,900    |                          |
| ミクニ         | 16,900    | 341.00   | 5,762,900     | 貸付有価証券<br>8,800株（8,500株） |
| 太平洋工業       | 38,100    | 1,118.00 | 42,595,800    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 河西工業        | 19,600    | 210.00   | 4,116,000     | 貸付有価証券<br>2,400株（800株）   |
| アイシン        | 128,000   | 3,750.00 | 480,000,000   | 貸付有価証券<br>5,100株         |
| マツダ         | 549,000   | 1,172.00 | 643,428,000   | 貸付有価証券<br>200株           |
| 今仙電機製作所     | 9,300     | 781.00   | 7,263,300     |                          |
| 本田技研工業      | 1,349,300 | 3,438.00 | 4,638,893,400 | 貸付有価証券<br>3,900株         |
| スズキ         | 304,900   | 4,810.00 | 1,466,569,000 |                          |
| S U B A R U | 525,200   | 2,215.00 | 1,163,318,000 | 貸付有価証券<br>5,300株         |
| 安永          | 6,400     | 684.00   | 4,377,600     | 貸付有価証券<br>2,300株（300株）   |
| ヤマハ発動機      | 260,900   | 3,385.00 | 883,146,500   | 貸付有価証券<br>18,700株        |
| T B K       | 14,600    | 247.00   | 3,606,200     |                          |
| エクセディ       | 27,100    | 1,768.00 | 47,912,800    |                          |
| 豊田合成        | 48,400    | 2,163.00 | 104,689,200   |                          |
| 愛三工業        | 27,400    | 864.00   | 23,673,600    |                          |
| 盟和産業        | 2,100     | 956.00   | 2,007,600     |                          |
| 日本プラスト      | 11,600    | 398.00   | 4,616,800     |                          |
| ヨロズ         | 15,600    | 740.00   | 11,544,000    | 貸付有価証券                   |

|                |           |           |               |                        |
|----------------|-----------|-----------|---------------|------------------------|
|                |           |           |               | 2,500株                 |
| エフ・シー・シー       | 29,400    | 1,460.00  | 42,924,000    |                        |
| シマノ            | 67,900    | 21,880.00 | 1,485,652,000 | 貸付有価証券<br>200株         |
| テイ・エス テック      | 76,000    | 1,722.00  | 130,872,000   |                        |
| ジャムコ           | 8,000     | 1,770.00  | 14,160,000    | 貸付有価証券<br>3,700株（800株） |
| テルモ            | 518,600   | 3,729.00  | 1,933,859,400 | 貸付有価証券<br>6,500株       |
| クリエートメディック     | 4,800     | 882.00    | 4,233,600     |                        |
| 日機装            | 41,500    | 941.00    | 39,051,500    | 貸付有価証券<br>2,300株       |
| 日本エム・ディ・エム     | 9,900     | 1,019.00  | 10,088,100    |                        |
| 島津製作所          | 202,200   | 3,865.00  | 781,503,000   |                        |
| J M S          | 15,400    | 511.00    | 7,869,400     |                        |
| クボテック          | 3,400     | 226.00    | 768,400       | 貸付有価証券<br>1,500株（100株） |
| 長野計器           | 12,100    | 1,184.00  | 14,326,400    |                        |
| ブイ・テクノロジー      | 8,100     | 2,535.00  | 20,533,500    |                        |
| 東京計器           | 12,700    | 1,269.00  | 16,116,300    | 貸付有価証券<br>5,800株（900株） |
| 愛知時計電機         | 6,500     | 1,450.00  | 9,425,000     |                        |
| インターアクション      | 7,900     | 1,434.00  | 11,328,600    | 貸付有価証券<br>200株         |
| オーバル           | 13,000    | 457.00    | 5,941,000     | 貸付有価証券<br>5,000株（800株） |
| 東京精密           | 36,400    | 4,735.00  | 172,354,000   |                        |
| マニー            | 73,000    | 1,864.00  | 136,072,000   | 貸付有価証券<br>400株         |
| ニコン            | 258,000   | 1,270.00  | 327,660,000   | 貸付有価証券<br>900株         |
| トプコン           | 87,400    | 1,706.00  | 149,104,400   |                        |
| オリンパス          | 1,037,600 | 2,301.50  | 2,388,036,400 | 貸付有価証券<br>1,000株       |
| 理研計器           | 10,300    | 5,050.00  | 52,015,000    |                        |
| タムロン           | 12,400    | 3,155.00  | 39,122,000    |                        |
| H O Y A        | 354,500   | 13,470.00 | 4,775,115,000 |                        |
| シード            | 7,500     | 554.00    | 4,155,000     |                        |
| ノーリツ鋼機         | 15,700    | 2,111.00  | 33,142,700    |                        |
| A & D ホロンホールディ | 24,200    | 1,237.00  | 29,935,400    |                        |

|                   |         |          |               |                           |
|-------------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| ングス               |         |          |               | 貸付有価証券<br>2,000株（1,800株）  |
| 朝日インテック           | 185,500 | 2,372.00 | 440,006,000   | 貸付有価証券<br>3,200株          |
| シチズン時計            | 182,500 | 800.00   | 146,000,000   | 貸付有価証券<br>18,900株（5,900株） |
| リズム               | 4,600   | 1,518.00 | 6,982,800     | 貸付有価証券<br>200株            |
| 大研医器              | 11,100  | 468.00   | 5,194,800     |                           |
| メニコン              | 57,000  | 3,000.00 | 171,000,000   | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| シンシア              | 1,400   | 500.00   | 700,000       | 貸付有価証券<br>100株            |
| 松風                | 7,500   | 2,134.00 | 16,005,000    | 貸付有価証券<br>600株（600株）      |
| セイコーグループ          | 25,700  | 2,932.00 | 75,352,400    | 貸付有価証券<br>300株            |
| ニプロ               | 138,400 | 1,074.00 | 148,641,600   |                           |
| K Y O R I T S U   | 21,900  | 126.00   | 2,759,400     | 貸付有価証券<br>8,900株          |
| 中本パックス            | 4,500   | 1,627.00 | 7,321,500     | 貸付有価証券<br>2,100株（200株）    |
| スノーピーク            | 28,400  | 2,142.00 | 60,832,800    | 貸付有価証券<br>13,300株（2,600株） |
| パラマウントベッドホールディングス | 38,300  | 2,363.00 | 90,502,900    | 貸付有価証券<br>600株            |
| トランザクション          | 12,800  | 1,579.00 | 20,211,200    | 貸付有価証券<br>5,900株（100株）    |
| 粧美堂               | 4,000   | 377.00   | 1,508,000     | 貸付有価証券<br>2,100株          |
| ニホンフラッシュ          | 15,600  | 921.00   | 14,367,600    | 貸付有価証券<br>100株            |
| 前田工織              | 14,000  | 3,245.00 | 45,430,000    |                           |
| 永大産業              | 15,700  | 219.00   | 3,438,300     | 貸付有価証券<br>100株            |
| アートネイチャー          | 17,100  | 746.00   | 12,756,600    |                           |
| バンダイナムコホールディングス   | 151,600 | 8,591.00 | 1,302,395,600 |                           |
| アイフィスジャパン         | 4,100   | 597.00   | 2,447,700     | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| S H O E I         | 17,500  | 5,080.00 | 88,900,000    |                           |
| フランスベッドホール        | 20,600  | 981.00   | 20,208,600    |                           |

|                                |         |          |             |                        |
|--------------------------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| ディングス                          |         |          |             |                        |
| パイロットコーポレーション                  | 26,000  | 4,380.00 | 113,880,000 |                        |
| 萩原工業                           | 11,100  | 1,200.00 | 13,320,000  | 貸付有価証券<br>5,100株       |
| フジシールインターナショナル                 | 33,600  | 1,600.00 | 53,760,000  | 貸付有価証券<br>100株         |
| タカラトミー                         | 76,700  | 1,297.00 | 99,479,900  |                        |
| 広済堂ホールディングス                    | 9,900   | 2,335.00 | 23,116,500  | 貸付有価証券<br>300株         |
| エステールホールディングス                  | 3,400   | 631.00   | 2,145,400   | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| タカノ                            | 5,500   | 672.00   | 3,696,000   | 貸付有価証券<br>2,500株       |
| プロネクサス                         | 13,800  | 977.00   | 13,482,600  |                        |
| ホクシン                           | 11,300  | 148.00   | 1,672,400   | 貸付有価証券<br>1,100株（200株） |
| ウッドワン                          | 4,900   | 901.00   | 4,414,900   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 大建工業                           | 10,100  | 2,101.00 | 21,220,100  |                        |
| 凸版印刷                           | 217,100 | 2,375.00 | 515,612,500 | 貸付有価証券<br>700株         |
| 大日本印刷                          | 196,900 | 3,615.00 | 711,793,500 |                        |
| 共同印刷                           | 4,700   | 2,935.00 | 13,794,500  | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| N I S S H A                    | 31,600  | 1,786.00 | 56,437,600  | 貸付有価証券<br>1,000株       |
| 光村印刷                           | 1,200   | 1,221.00 | 1,465,200   | 貸付有価証券<br>100株         |
| T A K A R A & C O<br>M P A N Y | 10,600  | 2,158.00 | 22,874,800  | 貸付有価証券<br>1,400株       |
| アシックス                          | 153,200 | 3,275.00 | 501,730,000 | 貸付有価証券<br>1,200株       |
| ツツミ                            | 2,900   | 1,955.00 | 5,669,500   |                        |
| ローランド                          | 12,200  | 3,850.00 | 46,970,000  | 貸付有価証券<br>1,000株       |
| 小松ウオール工業                       | 6,100   | 1,914.00 | 11,675,400  |                        |
| ヤマハ                            | 104,600 | 4,950.00 | 517,770,000 | 貸付有価証券<br>200株         |
| 河合楽器製作所                        | 4,500   | 2,623.00 | 11,803,500  |                        |
| クリナップ                          | 18,600  | 630.00   | 11,718,000  |                        |

|              |           |          |               |                            |
|--------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| ピジョン         | 105,700   | 2,184.00 | 230,848,800   | 貸付有価証券<br>15,600株          |
| 兼松サステック      | 1,000     | 2,245.00 | 2,245,000     |                            |
| キングジム        | 14,600    | 881.00   | 12,862,600    | 貸付有価証券<br>200株             |
| リンテック        | 33,300    | 2,187.00 | 72,827,100    |                            |
| イトーキ         | 34,000    | 779.00   | 26,486,000    |                            |
| 任天堂          | 1,048,000 | 5,456.00 | 5,717,888,000 | 貸付有価証券<br>400株             |
| 三菱鉛筆         | 23,600    | 1,459.00 | 34,432,400    |                            |
| タカラスタANDARD  | 32,100    | 1,388.00 | 44,554,800    | 貸付有価証券<br>100株             |
| コクヨ          | 79,900    | 1,805.00 | 144,219,500   |                            |
| ナカバヤシ        | 17,900    | 480.00   | 8,592,000     |                            |
| グローブライド      | 13,400    | 2,584.00 | 34,625,600    |                            |
| オカムラ         | 50,000    | 1,320.00 | 66,000,000    |                            |
| 美津濃          | 16,500    | 2,945.00 | 48,592,500    |                            |
| 東京電力ホールディングス | 1,496,300 | 470.00   | 703,261,000   | 貸付有価証券<br>122,500株         |
| 中部電力         | 611,700   | 1,421.00 | 869,225,700   | 貸付有価証券<br>3,000株           |
| 関西電力         | 641,000   | 1,280.00 | 820,480,000   |                            |
| 中国電力         | 264,300   | 687.00   | 181,574,100   | 貸付有価証券<br>14,400株          |
| 北陸電力         | 156,700   | 552.00   | 86,498,400    | 貸付有価証券<br>7,400株           |
| 東北電力         | 405,800   | 663.00   | 269,045,400   | 貸付有価証券<br>1,900株           |
| 四国電力         | 141,700   | 739.00   | 104,716,300   |                            |
| 九州電力         | 382,600   | 740.00   | 283,124,000   |                            |
| 北海道電力        | 160,400   | 475.00   | 76,190,000    |                            |
| 沖縄電力         | 38,900    | 1,041.00 | 40,494,900    | 貸付有価証券<br>2,200株           |
| 電源開発         | 125,000   | 2,127.00 | 265,875,000   |                            |
| エフオン         | 10,700    | 570.00   | 6,099,000     |                            |
| イーレックス       | 29,500    | 1,981.00 | 58,439,500    |                            |
| レノバ          | 44,200    | 2,192.00 | 96,886,400    | 貸付有価証券<br>16,400株（12,000株） |
| 東京瓦斯         | 350,900   | 2,678.00 | 939,710,200   |                            |

|                |         |           |               |                      |
|----------------|---------|-----------|---------------|----------------------|
| 大阪瓦斯           | 336,200 | 2,143.00  | 720,476,600   |                      |
| 東邦瓦斯           | 65,300  | 2,510.00  | 163,903,000   |                      |
| 北海道瓦斯          | 9,900   | 1,756.00  | 17,384,400    |                      |
| 広島ガス           | 35,000  | 344.00    | 12,040,000    |                      |
| 西部ガスホールディングス   | 15,600  | 1,737.00  | 27,097,200    |                      |
| 静岡ガス           | 37,800  | 1,108.00  | 41,882,400    | 貸付有価証券<br>6,500株     |
| メタウォーター        | 20,800  | 1,640.00  | 34,112,000    | 貸付有価証券<br>100株       |
| S B S ホールディングス | 14,800  | 3,255.00  | 48,174,000    | 貸付有価証券<br>1,500株     |
| 東武鉄道           | 182,300 | 2,999.00  | 546,717,700   | 貸付有価証券<br>100株       |
| 相鉄ホールディングス     | 54,800  | 2,273.00  | 124,560,400   |                      |
| 東急             | 465,400 | 1,574.00  | 732,539,600   | 貸付有価証券<br>20,100株    |
| 京浜急行電鉄         | 188,300 | 1,263.00  | 237,822,900   |                      |
| 小田急電鉄          | 251,600 | 1,610.00  | 405,076,000   | 貸付有価証券<br>1,000株     |
| 京王電鉄           | 87,800  | 4,660.00  | 409,148,000   |                      |
| 京成電鉄           | 107,000 | 3,805.00  | 407,135,000   | 貸付有価証券<br>200株       |
| 富士急行           | 20,400  | 4,150.00  | 84,660,000    | 貸付有価証券<br>500株（500株） |
| 東日本旅客鉄道        | 281,500 | 6,845.00  | 1,926,867,500 |                      |
| 西日本旅客鉄道        | 212,000 | 5,217.00  | 1,106,004,000 | 貸付有価証券<br>800株       |
| 東海旅客鉄道         | 127,900 | 15,220.00 | 1,946,638,000 | 貸付有価証券<br>1,700株     |
| 西武ホールディングス     | 200,800 | 1,398.00  | 280,718,400   |                      |
| 鴻池運輸           | 28,300  | 1,449.00  | 41,006,700    |                      |
| 西日本鉄道          | 44,300  | 2,412.00  | 106,851,600   |                      |
| ハマキョウレックス      | 13,000  | 3,155.00  | 41,015,000    |                      |
| サカイ引越センター      | 7,900   | 4,420.00  | 34,918,000    |                      |
| 近鉄グループホールディングス | 165,700 | 4,055.00  | 671,913,500   |                      |
| 阪急阪神ホールディングス   | 221,000 | 3,820.00  | 844,220,000   | 貸付有価証券<br>200株       |
| 南海電気鉄道         | 79,200  | 2,756.00  | 218,275,200   |                      |

|                                  |         |          |               |                        |
|----------------------------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| 京阪ホールディングス                       | 68,500  | 3,325.00 | 227,762,500   |                        |
| 神戸電鉄                             | 4,500   | 3,175.00 | 14,287,500    | 貸付有価証券<br>1,700株       |
| 名古屋鉄道                            | 183,100 | 2,069.00 | 378,833,900   |                        |
| 山陽電気鉄道                           | 12,500  | 2,202.00 | 27,525,000    |                        |
| アルプス物流                           | 13,200  | 1,296.00 | 17,107,200    | 貸付有価証券<br>300株（300株）   |
| ヤマトホールディングス                      | 212,200 | 2,320.00 | 492,304,000   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 山九                               | 42,200  | 4,905.00 | 206,991,000   |                        |
| 丸運                               | 7,200   | 220.00   | 1,584,000     | 貸付有価証券<br>800株         |
| 丸全昭和運輸                           | 10,200  | 3,040.00 | 31,008,000    |                        |
| センコーグループホールディングス                 | 87,700  | 974.00   | 85,419,800    |                        |
| トナミホールディングス                      | 3,600   | 3,805.00 | 13,698,000    |                        |
| ニッコンホールディングス                     | 53,000  | 2,450.00 | 129,850,000   |                        |
| 日本石油輸送                           | 1,500   | 2,315.00 | 3,472,500     |                        |
| 福山通運                             | 12,600  | 3,350.00 | 42,210,000    |                        |
| セイノーホールディングス                     | 103,100 | 1,372.00 | 141,453,200   | 貸付有価証券<br>400株         |
| エスライン                            | 4,100   | 815.00   | 3,341,500     | 貸付有価証券<br>1,900株       |
| 神奈川中央交通                          | 4,700   | 3,270.00 | 15,369,000    | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| A Z - C O M丸和ホールディングス            | 40,000  | 1,792.00 | 71,680,000    | 貸付有価証券<br>1,800株（200株） |
| C & F ロジホールディングス                 | 15,900  | 1,211.00 | 19,254,900    |                        |
| 九州旅客鉄道                           | 117,200 | 2,913.00 | 341,403,600   |                        |
| S Gホールディングス                      | 318,000 | 2,076.00 | 660,168,000   |                        |
| N I P P O N E X P R E S Sホールディング | 61,900  | 7,540.00 | 466,726,000   |                        |
| 日本郵船                             | 443,300 | 3,355.00 | 1,487,271,500 | 貸付有価証券<br>100株         |
| 商船三井                             | 292,100 | 3,435.00 | 1,003,363,500 | 貸付有価証券<br>96,800株      |
| 川崎汽船                             | 141,200 | 3,335.00 | 470,902,000   | 貸付有価証券<br>66,400株      |
| N S ユナイテッド海運                     | 8,900   | 4,140.00 | 36,846,000    |                        |

|                |         |          |               |                        |
|----------------|---------|----------|---------------|------------------------|
| 明治海運           | 14,300  | 638.00   | 9,123,400     | 貸付有価証券<br>5,800株       |
| 飯野海運           | 60,800  | 964.00   | 58,611,200    | 貸付有価証券<br>2,300株       |
| 共栄タンカー         | 2,700   | 958.00   | 2,586,600     | 貸付有価証券<br>1,200株（300株） |
| 乾汽船            | 21,000  | 2,044.00 | 42,924,000    | 貸付有価証券<br>8,300株（500株） |
| 日本航空           | 407,000 | 2,565.00 | 1,043,955,000 |                        |
| A N A ホールディングス | 450,900 | 2,792.00 | 1,258,912,800 | 貸付有価証券<br>28,100株      |
| パスコ            | 2,900   | 1,393.00 | 4,039,700     |                        |
| トランコム          | 4,800   | 6,830.00 | 32,784,000    |                        |
| 日新             | 12,600  | 2,046.00 | 25,779,600    |                        |
| 三菱倉庫           | 35,600  | 3,100.00 | 110,360,000   |                        |
| 三井倉庫ホールディングス   | 15,500  | 4,020.00 | 62,310,000    |                        |
| 住友倉庫           | 45,500  | 2,083.00 | 94,776,500    | 貸付有価証券<br>5,900株       |
| 澁澤倉庫           | 6,600   | 2,149.00 | 14,183,400    |                        |
| 東陽倉庫           | 19,500  | 270.00   | 5,265,000     |                        |
| 日本トランスシティ      | 33,300  | 556.00   | 18,514,800    |                        |
| ケイヒン           | 2,600   | 1,510.00 | 3,926,000     |                        |
| 中央倉庫           | 8,000   | 973.00   | 7,784,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| 川西倉庫           | 2,500   | 1,002.00 | 2,505,000     | 貸付有価証券<br>1,200株       |
| 安田倉庫           | 11,300  | 945.00   | 10,678,500    |                        |
| ファイズホールディングス   | 2,700   | 1,143.00 | 3,086,100     |                        |
| 東洋埠頭           | 4,200   | 1,341.00 | 5,632,200     | 貸付有価証券<br>100株         |
| 上組             | 79,500  | 2,687.00 | 213,616,500   |                        |
| サンリツ           | 3,300   | 747.00   | 2,465,100     |                        |
| キムラユニティー       | 7,000   | 981.00   | 6,867,000     | 貸付有価証券<br>2,200株（300株） |
| キューソー流通システム    | 8,800   | 941.00   | 8,280,800     | 貸付有価証券<br>4,000株       |
| 東海運            | 8,600   | 287.00   | 2,468,200     | 貸付有価証券<br>4,000株       |

|                  |         |          |             |                           |
|------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| エーアイテイー          | 10,400  | 1,565.00 | 16,276,000  | 貸付有価証券<br>500株（300株）      |
| 内外トランスライン        | 6,000   | 2,156.00 | 12,936,000  |                           |
| 日本コンセプト          | 5,200   | 1,304.00 | 6,780,800   |                           |
| N E C ネットズエスアイ   | 55,600  | 1,611.00 | 89,571,600  |                           |
| クロスキャット          | 9,500   | 1,276.00 | 12,122,000  | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）  |
| システナ             | 279,900 | 342.00   | 95,725,800  |                           |
| デジタルアーツ          | 10,500  | 5,450.00 | 57,225,000  |                           |
| 日鉄ソリューションズ       | 28,400  | 3,335.00 | 94,714,000  |                           |
| キューブシステム         | 9,900   | 1,108.00 | 10,969,200  | 貸付有価証券<br>3,400株          |
| コア               | 7,400   | 1,514.00 | 11,203,600  |                           |
| 手間いらず            | 2,800   | 4,850.00 | 13,580,000  |                           |
| ラクーンホールディングス     | 13,800  | 1,117.00 | 15,414,600  | 貸付有価証券<br>1,900株          |
| ソリトンシステムズ        | 8,600   | 1,008.00 | 8,668,800   | 貸付有価証券<br>200株（200株）      |
| ソフトクリエイトホールディングス | 6,800   | 3,470.00 | 23,596,000  |                           |
| T I S            | 187,100 | 3,430.00 | 641,753,000 |                           |
| J N S ホールディングス   | 6,700   | 331.00   | 2,217,700   | 貸付有価証券<br>300株            |
| グリー              | 44,600  | 676.00   | 30,149,600  | 貸付有価証券<br>14,000株         |
| G M O ペパボ        | 2,400   | 1,823.00 | 4,375,200   |                           |
| コーエーテクモホールディングス  | 104,300 | 2,413.00 | 251,675,900 | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| 三菱総合研究所          | 8,200   | 5,210.00 | 42,722,000  |                           |
| ボルテージ            | 4,200   | 317.00   | 1,331,400   | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| 電算               | 1,700   | 1,912.00 | 3,250,400   |                           |
| A G S            | 6,200   | 695.00   | 4,309,000   | 貸付有価証券<br>400株            |
| ファインデックス         | 13,200  | 627.00   | 8,276,400   |                           |
| ブレインパッド          | 12,500  | 628.00   | 7,850,000   |                           |
| K L a b          | 33,200  | 385.00   | 12,782,000  | 貸付有価証券<br>12,900株（1,800株） |
| ポールトゥウィンホールディングス | 28,400  | 849.00   | 24,111,600  | 貸付有価証券<br>2,200株          |

|                           |         |           |               |                          |
|---------------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| ネクソン                      | 430,400 | 3,075.00  | 1,323,480,000 | 貸付有価証券<br>3,100株         |
| アイスタイル                    | 48,400  | 438.00    | 21,199,200    | 貸付有価証券<br>8,800株（4,700株） |
| エムアップホールディングス             | 20,400  | 1,049.00  | 21,399,600    | 貸付有価証券<br>100株           |
| エイチーム                     | 12,300  | 779.00    | 9,581,700     |                          |
| エニグモ                      | 21,200  | 592.00    | 12,550,400    | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| テクノスジャパン                  | 12,200  | 602.00    | 7,344,400     |                          |
| e n i s h                 | 11,100  | 335.00    | 3,718,500     | 貸付有価証券<br>5,400株（1,100株） |
| コロプラ                      | 64,600  | 592.00    | 38,243,200    | 貸付有価証券<br>900株           |
| オルトプラス                    | 11,300  | 188.00    | 2,124,400     | 貸付有価証券<br>5,200株（1,200株） |
| ブロードリーフ                   | 97,200  | 439.00    | 42,670,800    | 貸付有価証券<br>100株           |
| クロス・マーケティンググループ           | 8,900   | 637.00    | 5,669,300     | 貸付有価証券<br>900株           |
| デジタルハーツホールディングス           | 10,400  | 1,486.00  | 15,454,400    |                          |
| システム情報                    | 14,700  | 792.00    | 11,642,400    |                          |
| メディアドゥ                    | 6,700   | 1,515.00  | 10,150,500    |                          |
| じげん                       | 48,500  | 415.00    | 20,127,500    | 貸付有価証券<br>100株           |
| ブイキューブ                    | 20,000  | 606.00    | 12,120,000    | 貸付有価証券<br>9,400株（6,000株） |
| エンカレッジ・テクノロジー             | 3,400   | 491.00    | 1,669,400     |                          |
| サイバーリンクス                  | 4,700   | 903.00    | 4,244,100     |                          |
| ディー・エル・イー                 | 10,600  | 251.00    | 2,660,600     | 貸付有価証券<br>2,700株（400株）   |
| フィックスターズ                  | 18,800  | 1,378.00  | 25,906,400    |                          |
| C A R T A H O L D I N G S | 7,800   | 1,462.00  | 11,403,600    |                          |
| オブティム                     | 13,700  | 980.00    | 13,426,000    | 貸付有価証券<br>200株           |
| セレス                       | 6,700   | 1,123.00  | 7,524,100     | 貸付有価証券<br>400株           |
| S H I F T                 | 12,200  | 22,480.00 | 274,256,000   | 貸付有価証券                   |

|                          |        |           |             |                           |
|--------------------------|--------|-----------|-------------|---------------------------|
|                          |        |           |             | 2,900株                    |
| ティーガイア                   | 17,400 | 1,644.00  | 28,605,600  | 貸付有価証券<br>500株            |
| セック                      | 2,000  | 3,380.00  | 6,760,000   | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）  |
| テクマトリックス                 | 30,400 | 1,554.00  | 47,241,600  |                           |
| プロシップ                    | 7,300  | 1,390.00  | 10,147,000  |                           |
| ガンホー・オンライン・<br>エンターテイメント | 50,900 | 2,364.00  | 120,327,600 |                           |
| GMOペイメントゲート<br>ウェイ       | 38,000 | 11,480.00 | 436,240,000 | 貸付有価証券<br>300株            |
| ザッパラス                    | 4,100  | 350.00    | 1,435,000   | 貸付有価証券<br>1,400株（800株）    |
| システムリサーチ                 | 5,200  | 2,199.00  | 11,434,800  |                           |
| インターネットイニシア<br>ティブ       | 92,900 | 2,650.00  | 246,185,000 |                           |
| さくらインターネット               | 18,700 | 598.00    | 11,182,600  |                           |
| ヴィンクス                    | 4,400  | 1,392.00  | 6,124,800   | 貸付有価証券<br>200株            |
| GMOグローバルサイ<br>ン・ホールディングス | 5,100  | 4,020.00  | 20,502,000  | 貸付有価証券<br>500株（100株）      |
| SRAホールディングス              | 8,500  | 3,035.00  | 25,797,500  |                           |
| システムインテグレータ              | 4,400  | 419.00    | 1,843,600   |                           |
| 朝日ネット                    | 17,900 | 586.00    | 10,489,400  |                           |
| eBASE                    | 23,400 | 650.00    | 15,210,000  |                           |
| アバントグループ                 | 21,000 | 1,311.00  | 27,531,000  |                           |
| アドソル日進                   | 7,000  | 1,433.00  | 10,031,000  | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| ODKソリューションズ              | 3,300  | 590.00    | 1,947,000   |                           |
| フリービット                   | 8,700  | 1,118.00  | 9,726,600   |                           |
| コムチュア                    | 22,000 | 2,259.00  | 49,698,000  |                           |
| サイバーコム                   | 2,400  | 1,405.00  | 3,372,000   |                           |
| アステリア                    | 13,000 | 727.00    | 9,451,000   | 貸付有価証券<br>5,600株（4,600株）  |
| アイル                      | 9,300  | 1,940.00  | 18,042,000  |                           |
| マークライNZ                  | 9,000  | 2,693.00  | 24,237,000  |                           |
| メディカル・データ・ビ<br>ジョン       | 24,800 | 904.00    | 22,419,200  | 貸付有価証券<br>800株            |
| gumi                     | 25,700 | 841.00    | 21,613,700  | 貸付有価証券<br>12,000株（7,500株） |

|                       |        |          |             |                          |
|-----------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| ショーケース                | 3,400  | 328.00   | 1,115,200   |                          |
| モバイルファクトリー            | 3,100  | 894.00   | 2,771,400   | 貸付有価証券<br>1,400株（1,100株） |
| テラスカイ                 | 7,200  | 1,957.00 | 14,090,400  | 貸付有価証券<br>3,300株（1,000株） |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 9,600  | 1,605.00 | 15,408,000  |                          |
| P C I ホールディングス        | 6,200  | 1,000.00 | 6,200,000   | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| アイピーシー                | 2,300  | 404.00   | 929,200     | 貸付有価証券<br>100株           |
| ネオジャパン                | 5,600  | 951.00   | 5,325,600   | 貸付有価証券<br>100株           |
| P R T I M E S         | 4,200  | 1,845.00 | 7,749,000   | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| ラクス                   | 78,700 | 1,720.00 | 135,364,000 | 貸付有価証券<br>3,800株         |
| ランドコンピュータ             | 3,600  | 989.00   | 3,560,400   |                          |
| ダブルスタンダード             | 6,700  | 2,017.00 | 13,513,900  | 貸付有価証券<br>300株           |
| オープンドア                | 11,600 | 1,613.00 | 18,710,800  | 貸付有価証券<br>5,400株（2,900株） |
| マイネット                 | 4,800  | 353.00   | 1,694,400   |                          |
| アカツキ                  | 7,900  | 2,132.00 | 16,842,800  |                          |
| ベネフィットジャパン            | 900    | 1,186.00 | 1,067,400   |                          |
| U b i c o mホールディングス   | 5,200  | 1,935.00 | 10,062,000  |                          |
| カナミックネットワーク           | 23,900 | 518.00   | 12,380,200  |                          |
| ノムラシステムコーポレーション       | 13,800 | 113.00   | 1,559,400   | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| チェンジ                  | 40,800 | 2,604.00 | 106,243,200 | 貸付有価証券<br>2,400株         |
| シンクロ・フード              | 9,300  | 519.00   | 4,826,700   | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| オークネット                | 8,200  | 1,778.00 | 14,579,600  | 貸付有価証券<br>3,500株         |
| キャピタル・アセット・プランニング     | 2,800  | 599.00   | 1,677,200   |                          |
| セグエグループ               | 4,100  | 784.00   | 3,214,400   |                          |
| エイトレッド                | 2,200  | 1,498.00 | 3,295,600   | 貸付有価証券<br>1,300株         |

|                |         |          |               |                            |
|----------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| マクロミル          | 32,700  | 1,055.00 | 34,498,500    | 貸付有価証券<br>200株             |
| ピーグリー          | 2,500   | 1,262.00 | 3,155,000     | 貸付有価証券<br>100株             |
| オロ             | 5,000   | 1,810.00 | 9,050,000     | 貸付有価証券<br>300株             |
| ユーザーローカル       | 6,000   | 1,653.00 | 9,918,000     |                            |
| テモナ            | 2,800   | 296.00   | 828,800       | 貸付有価証券<br>1,400株（800株）     |
| ニーズウェル         | 4,500   | 865.00   | 3,892,500     |                            |
| マネーフォワード       | 40,100  | 4,830.00 | 193,683,000   | 貸付有価証券<br>8,800株           |
| サインポスト         | 5,700   | 588.00   | 3,351,600     | 貸付有価証券<br>900株（800株）       |
| Sun Asterisk   | 8,800   | 1,184.00 | 10,419,200    | 貸付有価証券<br>4,100株           |
| 電算システムホールディングス | 8,000   | 2,524.00 | 20,192,000    |                            |
| Appier Group   | 47,300  | 1,778.00 | 84,099,400    | 貸付有価証券<br>7,400株（6,400株）   |
| ソルクシーズ         | 12,000  | 352.00   | 4,224,000     | 貸付有価証券<br>100株             |
| フェイス           | 4,100   | 505.00   | 2,070,500     | 貸付有価証券<br>600株             |
| プロトコーポレーション    | 20,800  | 1,244.00 | 25,875,200    |                            |
| ハイマックス         | 5,200   | 1,424.00 | 7,404,800     |                            |
| 野村総合研究所        | 341,500 | 2,970.00 | 1,014,255,000 |                            |
| サイバネットシステム     | 13,900  | 985.00   | 13,691,500    | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| C E ホールディングス   | 7,600   | 538.00   | 4,088,800     | 貸付有価証券<br>600株（500株）       |
| 日本システム技術       | 6,200   | 1,703.00 | 10,558,600    |                            |
| インテージホールディングス  | 18,800  | 1,679.00 | 31,565,200    | 貸付有価証券<br>3,400株（1,300株）   |
| 東邦システムサイエンス    | 4,100   | 1,052.00 | 4,313,200     | 貸付有価証券<br>1,800株（100株）     |
| ソースネクスト        | 84,600  | 236.00   | 19,965,600    | 貸付有価証券<br>28,500株（10,400株） |
| インフォコム         | 21,500  | 2,373.00 | 51,019,500    | 貸付有価証券<br>100株             |
| シンプレクス・ホール     | 27,900  | 2,311.00 | 64,476,900    |                            |

|                          |         |          |             |                          |
|--------------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| ディングス                    |         |          |             |                          |
| HEROZ                    | 5,600   | 1,048.00 | 5,868,800   | 貸付有価証券<br>2,600株（800株）   |
| ラクスル                     | 47,000  | 1,373.00 | 64,531,000  | 貸付有価証券<br>4,200株         |
| メルカリ                     | 75,100  | 2,539.00 | 190,678,900 | 貸付有価証券<br>16,200株        |
| I P S                    | 5,400   | 2,654.00 | 14,331,600  |                          |
| F I G                    | 17,100  | 302.00   | 5,164,200   | 貸付有価証券<br>8,000株         |
| システムサポート                 | 6,400   | 1,732.00 | 11,084,800  |                          |
| イーソル                     | 10,700  | 721.00   | 7,714,700   | 貸付有価証券<br>300株           |
| アルテリア・ネットワー<br>クス        | 15,500  | 1,276.00 | 19,778,000  |                          |
| 東海ソフト                    | 2,200   | 908.00   | 1,997,600   |                          |
| ウイングアーク 1 s t            | 17,200  | 1,809.00 | 31,114,800  |                          |
| ヒト・コミュニケーション<br>ズ・ホールディン | 4,400   | 1,564.00 | 6,881,600   |                          |
| サーバーワークス                 | 3,400   | 2,293.00 | 7,796,200   | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 東名                       | 1,100   | 2,265.00 | 2,491,500   | 貸付有価証券<br>500株           |
| ヴィッツ                     | 1,400   | 915.00   | 1,281,000   |                          |
| トビラシステムズ                 | 3,700   | 823.00   | 3,045,100   | 貸付有価証券<br>400株           |
| S a n s a n              | 54,400  | 1,540.00 | 83,776,000  | 貸付有価証券<br>6,600株         |
| L i n k - U              | 2,800   | 978.00   | 2,738,400   | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| ギフトィ                     | 18,100  | 2,727.00 | 49,358,700  | 貸付有価証券<br>7,500株（6,500株） |
| メドレー                     | 16,700  | 4,405.00 | 73,563,500  | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| ベース                      | 5,600   | 4,710.00 | 26,376,000  |                          |
| J M D C                  | 27,300  | 4,360.00 | 119,028,000 | 貸付有価証券<br>1,300株（400株）   |
| フォーカスシステムズ               | 12,100  | 1,004.00 | 12,148,400  |                          |
| クレスコ                     | 12,800  | 1,756.00 | 22,476,800  |                          |
| フジ・メディア・ホール<br>ディングス     | 159,900 | 1,117.00 | 178,608,300 |                          |

|                            |           |           |               |                      |
|----------------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------|
| オービック                      | 55,600    | 20,190.00 | 1,122,564,000 |                      |
| ジャストシステム                   | 23,900    | 3,435.00  | 82,096,500    |                      |
| T D C ソフト                  | 14,000    | 1,508.00  | 21,112,000    |                      |
| Z ホールディングス                 | 2,369,100 | 381.80    | 904,522,380   | 貸付有価証券<br>400株       |
| トレンドマイクロ                   | 96,100    | 6,340.00  | 609,274,000   | 貸付有価証券<br>2,600株     |
| I D ホールディングス               | 11,200    | 997.00    | 11,166,400    |                      |
| 日本オラクル                     | 31,800    | 9,270.00  | 294,786,000   |                      |
| アルファシステムズ                  | 5,200     | 4,290.00  | 22,308,000    |                      |
| フューチャー                     | 41,400    | 1,812.00  | 75,016,800    |                      |
| C A C   H o l d i n g<br>s | 10,200    | 1,621.00  | 16,534,200    | 貸付有価証券<br>1,700株     |
| S B テクノロジー                 | 7,100     | 1,974.00  | 14,015,400    |                      |
| トーセ                        | 3,900     | 748.00    | 2,917,200     | 貸付有価証券<br>200株（100株） |
| オービックビジネスコン<br>サルタント       | 32,800    | 4,780.00  | 156,784,000   |                      |
| 伊藤忠テクノソリュー<br>ションズ         | 89,400    | 3,060.00  | 273,564,000   |                      |
| アイティフォー                    | 21,900    | 861.00    | 18,855,900    |                      |
| 東計電算                       | 2,300     | 5,880.00  | 13,524,000    |                      |
| エックスネット                    | 2,100     | 1,015.00  | 2,131,500     |                      |
| 大塚商会                       | 94,400    | 4,560.00  | 430,464,000   | 貸付有価証券<br>1,200株     |
| サイボウズ                      | 22,900    | 2,603.00  | 59,608,700    | 貸付有価証券<br>500株       |
| 電通国際情報サービス                 | 20,200    | 4,805.00  | 97,061,000    |                      |
| A C C E S S                | 19,700    | 981.00    | 19,325,700    | 貸付有価証券<br>100株       |
| デジタルガレージ                   | 29,500    | 4,535.00  | 133,782,500   | 貸付有価証券<br>300株       |
| E M システムズ                  | 27,800    | 849.00    | 23,602,200    |                      |
| ウェザーニューズ                   | 5,100     | 6,830.00  | 34,833,000    | 貸付有価証券<br>100株       |
| C I J                      | 13,800    | 1,030.00  | 14,214,000    | 貸付有価証券<br>300株       |
| ビジネスエンジニアリン<br>グ           | 3,100     | 2,754.00  | 8,537,400     | 貸付有価証券<br>700株（300株） |
| 日本エンタープライズ                 | 15,300    | 138.00    | 2,111,400     | 貸付有価証券               |

|                                      |         |          |             |                        |
|--------------------------------------|---------|----------|-------------|------------------------|
|                                      |         |          |             | 100株                   |
| WOWOW                                | 9,400   | 1,268.00 | 11,919,200  | 貸付有価証券<br>3,200株       |
| スカラ                                  | 15,400  | 721.00   | 11,103,400  |                        |
| インテリジェント ウェ<br>イブ                    | 7,800   | 710.00   | 5,538,000   |                        |
| WOW WORLD G<br>ROU P                 | 2,600   | 1,497.00 | 3,892,200   | 貸付有価証券<br>600株（100株）   |
| I M A G I C A G R O<br>U P           | 13,900  | 616.00   | 8,562,400   |                        |
| ネットワンシステムズ                           | 62,000  | 3,305.00 | 204,910,000 |                        |
| システムソフト                              | 57,900  | 86.00    | 4,979,400   | 貸付有価証券<br>300株         |
| アルゴグラフィックス                           | 15,300  | 3,830.00 | 58,599,000  |                        |
| マーベラス                                | 27,000  | 709.00   | 19,143,000  |                        |
| エイベックス                               | 28,300  | 1,622.00 | 45,902,600  |                        |
| B I P R O G Y                        | 61,300  | 2,945.00 | 180,528,500 |                        |
| 兼松エレクトロニクス                           | 10,700  | 6,180.00 | 66,126,000  |                        |
| 都築電気                                 | 8,800   | 1,336.00 | 11,756,800  |                        |
| T B S ホールディングス                       | 85,200  | 1,635.00 | 139,302,000 |                        |
| 日本テレビホールディン<br>グス                    | 147,400 | 1,099.00 | 161,992,600 |                        |
| 朝日放送グループホール<br>ディングス                 | 15,600  | 672.00   | 10,483,200  | 貸付有価証券<br>3,500株       |
| テレビ朝日ホールディン<br>グス                    | 40,400  | 1,423.00 | 57,489,200  |                        |
| スカパーＪＳＡＴホール<br>ディングス                 | 147,700 | 494.00   | 72,963,800  |                        |
| テレビ東京ホールディン<br>グス                    | 12,000  | 2,165.00 | 25,980,000  |                        |
| 日本ＢＳ放送                               | 5,300   | 919.00   | 4,870,700   | 貸付有価証券<br>1,200株       |
| ビジョン                                 | 21,900  | 1,532.00 | 33,550,800  | 貸付有価証券<br>4,400株       |
| スマートバリュー                             | 3,600   | 426.00   | 1,533,600   |                        |
| U S E N - N E X T H<br>O L D I N G S | 14,900  | 2,506.00 | 37,339,400  | 貸付有価証券<br>7,000株（400株） |
| ワイヤレスゲート                             | 6,400   | 268.00   | 1,715,200   | 貸付有価証券<br>500株（500株）   |
| コネクシオ                                | 11,100  | 1,905.00 | 21,145,500  | 貸付有価証券<br>100株         |

|                          |           |           |               |                            |
|--------------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| 日本通信                     | 153,600   | 236.00    | 36,249,600    | 貸付有価証券<br>30,700株（27,800株） |
| クロップス                    | 2,400     | 1,150.00  | 2,760,000     | 貸付有価証券<br>1,100株（500株）     |
| 日本電信電話                   | 2,133,100 | 3,888.00  | 8,293,492,800 | 貸付有価証券<br>16,600株          |
| K D D I                  | 1,286,400 | 3,991.00  | 5,134,022,400 | 貸付有価証券<br>12,200株          |
| ソフトバンク                   | 2,674,300 | 1,527.00  | 4,083,656,100 |                            |
| 光通信                      | 19,600    | 20,290.00 | 397,684,000   | 貸付有価証券<br>5,400株（400株）     |
| エムティーアイ                  | 15,200    | 507.00    | 7,706,400     | 貸付有価証券<br>4,700株           |
| G M Oインターネットグループ         | 61,800    | 2,582.00  | 159,567,600   |                            |
| ファイバーゲート                 | 8,900     | 875.00    | 7,787,500     |                            |
| アイドママーケティング<br>コミュニケーション | 3,400     | 287.00    | 975,800       |                            |
| K A D O K A W A          | 88,000    | 2,754.00  | 242,352,000   |                            |
| 学研ホールディングス               | 27,700    | 860.00    | 23,822,000    |                            |
| ゼンリン                     | 28,500    | 855.00    | 24,367,500    |                            |
| 昭文社ホールディングス              | 6,300     | 295.00    | 1,858,500     | 貸付有価証券<br>2,500株（500株）     |
| インプレスホールディングス            | 13,000    | 200.00    | 2,600,000     |                            |
| アイネット                    | 10,100    | 1,272.00  | 12,847,200    |                            |
| 松竹                       | 9,500     | 10,910.00 | 103,645,000   | 貸付有価証券<br>4,400株           |
| 東宝                       | 104,200   | 4,770.00  | 497,034,000   |                            |
| 東映                       | 4,600     | 17,060.00 | 78,476,000    |                            |
| エヌ・ティ・ティ・データ             | 522,300   | 1,876.00  | 979,834,800   | 貸付有価証券<br>6,200株           |
| ピー・シー・エー                 | 9,600     | 1,246.00  | 11,961,600    |                            |
| ビジネスブレイン太田昭和             | 7,100     | 2,092.00  | 14,853,200    |                            |
| D T S                    | 35,400    | 3,105.00  | 109,917,000   |                            |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス     | 83,700    | 6,350.00  | 531,495,000   |                            |
| シーイーシー                   | 23,300    | 1,505.00  | 35,066,500    |                            |
| カブコン                     | 165,400   | 4,540.00  | 750,916,000   |                            |

|                  |         |          |               |                  |
|------------------|---------|----------|---------------|------------------|
| アイ・エス・ピー         | 8,500   | 1,168.00 | 9,928,000     |                  |
| ジャステック           | 10,200  | 1,232.00 | 12,566,400    |                  |
| S C S K          | 135,900 | 1,925.00 | 261,607,500   |                  |
| N S W            | 6,500   | 2,095.00 | 13,617,500    |                  |
| アイネス             | 11,700  | 1,330.00 | 15,561,000    |                  |
| T K C            | 29,900  | 3,625.00 | 108,387,500   |                  |
| 富士ソフト            | 18,800  | 7,770.00 | 146,076,000   |                  |
| N S D            | 59,400  | 2,274.00 | 135,075,600   |                  |
| コナミグループ          | 71,300  | 6,400.00 | 456,320,000   | 貸付有価証券<br>300株   |
| 福井コンピュータホールディングス | 11,600  | 2,819.00 | 32,700,400    |                  |
| J B C Cホールディングス  | 12,100  | 1,918.00 | 23,207,800    |                  |
| ミロク情報サービス        | 15,100  | 1,766.00 | 26,666,600    |                  |
| ソフトバンクグループ       | 962,500 | 5,764.00 | 5,547,850,000 | 貸付有価証券<br>3,900株 |
| 高千穂交易            | 5,600   | 2,382.00 | 13,339,200    | 貸付有価証券<br>2,900株 |
| オルバヘルスケアホールディングス | 2,300   | 1,606.00 | 3,693,800     |                  |
| 伊藤忠食品            | 3,900   | 4,970.00 | 19,383,000    |                  |
| エレマテック           | 15,800  | 1,746.00 | 27,586,800    |                  |
| あらた              | 13,400  | 3,980.00 | 53,332,000    |                  |
| トーメンデバイス         | 2,500   | 6,780.00 | 16,950,000    | 貸付有価証券<br>100株   |
| 東京エレクトロン デバイス    | 6,500   | 7,990.00 | 51,935,000    |                  |
| 円谷フィールズホールディングス  | 15,100  | 4,040.00 | 61,004,000    | 貸付有価証券<br>6,800株 |
| 双日               | 186,400 | 2,583.00 | 481,471,200   | 貸付有価証券<br>200株   |
| アルフレッサ ホールディングス  | 176,300 | 1,615.00 | 284,724,500   |                  |
| 横浜冷凍             | 47,800  | 994.00   | 47,513,200    |                  |
| 神栄               | 2,100   | 883.00   | 1,854,300     | 貸付有価証券<br>1,200株 |
| ラサ商事             | 7,100   | 1,373.00 | 9,748,300     |                  |
| アルコニックス          | 23,100  | 1,336.00 | 30,861,600    |                  |
| 神戸物産             | 135,900 | 3,600.00 | 489,240,000   | 貸付有価証券           |

|                     |        |          |             |                        |
|---------------------|--------|----------|-------------|------------------------|
|                     |        |          |             | 1,500株                 |
| ハイパー                | 2,900  | 445.00   | 1,290,500   | 貸付有価証券<br>200株（100株）   |
| あい ホールディングス         | 28,100 | 2,114.00 | 59,403,400  | 貸付有価証券<br>900株         |
| ディー・ビー・エックス         | 4,300  | 1,027.00 | 4,416,100   | 貸付有価証券<br>1,900株       |
| ダイワボウホールディングス       | 71,800 | 2,041.00 | 146,543,800 |                        |
| マクニカホールディングス        | 43,000 | 3,495.00 | 150,285,000 |                        |
| ラクト・ジャパン            | 6,800  | 2,000.00 | 13,600,000  |                        |
| グリムス                | 7,300  | 2,536.00 | 18,512,800  | 貸付有価証券<br>3,400株       |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 25,700 | 850.00   | 21,845,000  |                        |
| 八洲電機                | 14,200 | 1,119.00 | 15,889,800  | 貸付有価証券<br>5,100株       |
| メディアスホールディングス       | 11,200 | 754.00   | 8,444,800   | 貸付有価証券<br>300株（300株）   |
| レスターホールディングス        | 16,800 | 2,210.00 | 37,128,000  |                        |
| ジューテックホールディングス      | 3,600  | 1,224.00 | 4,406,400   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 大光                  | 6,000  | 656.00   | 3,936,000   | 貸付有価証券<br>3,000株（400株） |
| O C H I ホールディングス    | 3,500  | 1,313.00 | 4,595,500   | 貸付有価証券<br>1,600株（100株） |
| T O K A I ホールディングス  | 86,700 | 858.00   | 74,388,600  |                        |
| 黒谷                  | 4,300  | 598.00   | 2,571,400   | 貸付有価証券<br>1,300株（800株） |
| C o m i n i x       | 3,100  | 767.00   | 2,377,700   |                        |
| 三洋貿易                | 18,000 | 1,120.00 | 20,160,000  |                        |
| ビューティガレージ           | 2,800  | 3,775.00 | 10,570,000  |                        |
| ウイン・パートナーズ          | 12,800 | 1,049.00 | 13,427,200  |                        |
| ミタチ産業               | 4,000  | 1,328.00 | 5,312,000   |                        |
| シップヘルスケアホールディングス    | 63,100 | 2,465.00 | 155,541,500 | 貸付有価証券<br>200株         |
| 明治電機工業              | 6,500  | 1,121.00 | 7,286,500   |                        |
| デリカフーズホールディ         | 6,100  | 527.00   | 3,214,700   | 貸付有価証券                 |

|                  |         |          |             |                          |
|------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| ングス              |         |          |             | 3,000株（300株）             |
| スターティアホールディングス   | 3,100   | 1,005.00 | 3,115,500   |                          |
| コメダホールディングス      | 43,000  | 2,330.00 | 100,190,000 |                          |
| ピーバンドットコム        | 2,200   | 532.00   | 1,170,400   |                          |
| アセンテック           | 5,900   | 518.00   | 3,056,200   |                          |
| 富士興産             | 3,500   | 1,238.00 | 4,333,000   | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株） |
| 協栄産業             | 1,400   | 1,776.00 | 2,486,400   |                          |
| フルサト・マルカホールディングス | 17,500  | 2,879.00 | 50,382,500  | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| ヤマエグループホールディングス  | 9,900   | 1,582.00 | 15,661,800  |                          |
| 小野建              | 16,100  | 1,488.00 | 23,956,800  |                          |
| 南陽               | 3,000   | 1,982.00 | 5,946,000   |                          |
| 佐鳥電機             | 9,800   | 1,470.00 | 14,406,000  |                          |
| エコートレーディング       | 3,000   | 812.00   | 2,436,000   | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| 伯東               | 10,100  | 4,855.00 | 49,035,500  |                          |
| コンドーテック          | 13,500  | 1,045.00 | 14,107,500  | 貸付有価証券<br>800株           |
| 中山福              | 8,300   | 340.00   | 2,822,000   | 貸付有価証券<br>3,300株（1,100株） |
| ナガイレーベン          | 22,200  | 1,953.00 | 43,356,600  |                          |
| 三菱食品             | 16,200  | 3,335.00 | 54,027,000  |                          |
| 松田産業             | 13,400  | 2,234.00 | 29,935,600  |                          |
| 第一興商             | 34,000  | 4,190.00 | 142,460,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| メディカルホールディングス    | 182,100 | 1,729.00 | 314,850,900 |                          |
| S P K            | 7,800   | 1,523.00 | 11,879,400  |                          |
| 萩原電気ホールディングス     | 6,700   | 2,665.00 | 17,855,500  |                          |
| アズワン             | 25,700  | 5,720.00 | 147,004,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| スズデン             | 6,100   | 2,602.00 | 15,872,200  | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| 尾家産業             | 3,700   | 1,006.00 | 3,722,200   | 貸付有価証券<br>1,700株（400株）   |
| シモジマ             | 12,000  | 994.00   | 11,928,000  |                          |

|              |           |          |               |                          |
|--------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| ドウシシャ        | 18,600    | 1,768.00 | 32,884,800    |                          |
| 小津産業         | 3,500     | 1,664.00 | 5,824,000     |                          |
| 高速           | 9,100     | 1,902.00 | 17,308,200    |                          |
| たけびし         | 6,700     | 1,601.00 | 10,726,700    | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| リックス         | 3,200     | 2,511.00 | 8,035,200     | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 丸文           | 15,700    | 1,337.00 | 20,990,900    |                          |
| ハビネット        | 14,900    | 1,861.00 | 27,728,900    |                          |
| 橋本総業ホールディングス | 6,900     | 1,104.00 | 7,617,600     |                          |
| 日本ライフライン     | 51,500    | 907.00   | 46,710,500    |                          |
| タカショー        | 15,300    | 681.00   | 10,419,300    | 貸付有価証券<br>3,100株（1,100株） |
| I D O M      | 53,100    | 857.00   | 45,506,700    |                          |
| 進和           | 11,600    | 2,094.00 | 24,290,400    | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| エスケイジャパン     | 3,800     | 564.00   | 2,143,200     |                          |
| ダイترون       | 6,900     | 2,449.00 | 16,898,100    |                          |
| シークス         | 25,000    | 1,522.00 | 38,050,000    |                          |
| 田中商事         | 4,400     | 592.00   | 2,604,800     |                          |
| オーハシテクニカ     | 8,800     | 1,533.00 | 13,490,400    |                          |
| 白銅           | 6,300     | 2,566.00 | 16,165,800    |                          |
| ダイコー通産       | 1,600     | 1,081.00 | 1,729,600     |                          |
| 伊藤忠商事        | 1,082,200 | 4,135.00 | 4,474,897,000 | 貸付有価証券<br>22,100株        |
| 丸紅           | 1,386,500 | 1,755.00 | 2,433,307,500 | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| 高島           | 2,500     | 2,894.00 | 7,235,000     | 貸付有価証券<br>300株           |
| 長瀬産業         | 82,600    | 2,037.00 | 168,256,200   |                          |
| 蝶理           | 9,400     | 2,486.00 | 23,368,400    |                          |
| 豊田通商         | 153,800   | 5,600.00 | 861,280,000   |                          |
| 三共生興         | 25,200    | 525.00   | 13,230,000    |                          |
| 兼松           | 68,200    | 1,579.00 | 107,687,800   |                          |
| ツカモトコーポレーション | 2,200     | 1,400.00 | 3,080,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| 三井物産         | 1,285,000 | 3,950.00 | 5,075,750,000 | 貸付有価証券<br>18,900株        |

|                     |           |          |               |                      |
|---------------------|-----------|----------|---------------|----------------------|
| 日本紙パルプ商事            | 9,300     | 5,070.00 | 47,151,000    |                      |
| カメイ                 | 18,700    | 1,333.00 | 24,927,100    |                      |
| 東都水産                | 800       | 5,720.00 | 4,576,000     | 貸付有価証券<br>400株       |
| ＯＵＧホールディングス         | 2,300     | 2,473.00 | 5,687,900     |                      |
| スターゼン               | 13,300    | 2,146.00 | 28,541,800    |                      |
| 山善                  | 47,300    | 1,036.00 | 49,002,800    |                      |
| 椿本興業                | 2,800     | 4,080.00 | 11,424,000    |                      |
| 住友商事                | 1,087,600 | 2,361.00 | 2,567,823,600 | 貸付有価証券<br>22,200株    |
| 内田洋行                | 7,800     | 4,645.00 | 36,231,000    |                      |
| 三菱商事                | 1,098,000 | 4,696.00 | 5,156,208,000 | 貸付有価証券<br>13,600株    |
| 第一実業                | 6,200     | 5,180.00 | 32,116,000    |                      |
| キャノンマーケティング<br>ジャパン | 40,700    | 3,080.00 | 125,356,000   |                      |
| 西華産業                | 6,900     | 1,691.00 | 11,667,900    |                      |
| 佐藤商事                | 12,200    | 1,326.00 | 16,177,200    |                      |
| 菱洋エレクトロ             | 15,000    | 2,441.00 | 36,615,000    | 貸付有価証券<br>1,000株     |
| 東京産業                | 16,000    | 775.00   | 12,400,000    |                      |
| ユアサ商事               | 15,800    | 3,630.00 | 57,354,000    |                      |
| 神鋼商事                | 4,400     | 5,700.00 | 25,080,000    |                      |
| トルク                 | 8,300     | 209.00   | 1,734,700     |                      |
| 阪和興業                | 31,500    | 3,960.00 | 124,740,000   |                      |
| 正栄食品工業              | 11,700    | 4,175.00 | 48,847,500    | 貸付有価証券<br>5,400株     |
| カナデン                | 14,200    | 1,106.00 | 15,705,200    |                      |
| 菱電商事                | 14,200    | 1,850.00 | 26,270,000    | 貸付有価証券<br>6,600株     |
| 岩谷産業                | 40,000    | 5,670.00 | 226,800,000   |                      |
| ナイス                 | 4,200     | 1,356.00 | 5,695,200     |                      |
| ニチモウ                | 1,800     | 3,275.00 | 5,895,000     |                      |
| 極東貿易                | 10,500    | 1,436.00 | 15,078,000    | 貸付有価証券<br>600株（200株） |
| アステナホールディング<br>ス    | 30,400    | 424.00   | 12,889,600    | 貸付有価証券<br>100株       |
| 三愛オブリ               | 48,500    | 1,422.00 | 68,967,000    |                      |
| 稲畑産業                | 35,500    | 2,572.00 | 91,306,000    |                      |

|                                 |        |          |             |                        |
|---------------------------------|--------|----------|-------------|------------------------|
| G S I クレオス                      | 10,200 | 1,548.00 | 15,789,600  | 貸付有価証券<br>300株（300株）   |
| 明和産業                            | 23,300 | 693.00   | 16,146,900  | 貸付有価証券<br>8,000株（300株） |
| クワザワホールディングス                    | 5,000  | 465.00   | 2,325,000   | 貸付有価証券<br>2,300株（300株） |
| ワキタ                             | 32,300 | 1,159.00 | 37,435,700  |                        |
| 東邦ホールディングス                      | 43,700 | 2,111.00 | 92,250,700  |                        |
| サンゲツ                            | 44,100 | 2,346.00 | 103,458,600 |                        |
| ミツウロコグループホールディングス               | 22,600 | 1,361.00 | 30,758,600  |                        |
| シナネンホールディングス                    | 5,700  | 3,530.00 | 20,121,000  |                        |
| 伊藤忠エネクス                         | 43,500 | 1,094.00 | 47,589,000  |                        |
| サンリオ                            | 49,800 | 4,005.00 | 199,449,000 |                        |
| サンワテクノス                         | 9,000  | 1,924.00 | 17,316,000  |                        |
| リョーサン                           | 18,600 | 3,075.00 | 57,195,000  |                        |
| 新光商事                            | 23,600 | 1,286.00 | 30,349,600  |                        |
| トーホー                            | 7,500  | 1,758.00 | 13,185,000  | 貸付有価証券<br>1,300株（500株） |
| 三信電気                            | 7,100  | 2,556.00 | 18,147,600  | 貸付有価証券<br>100株         |
| 東陽テクニカ                          | 19,400 | 1,292.00 | 25,064,800  |                        |
| モスフードサービス                       | 25,800 | 3,095.00 | 79,851,000  |                        |
| 加賀電子                            | 14,300 | 4,635.00 | 66,280,500  | 貸付有価証券<br>100株         |
| ソーダニッカ                          | 11,400 | 754.00   | 8,595,600   | 貸付有価証券<br>1,000株       |
| 立花エレクトック                        | 12,800 | 1,863.00 | 23,846,400  |                        |
| フォーバル                           | 6,900  | 1,007.00 | 6,948,300   |                        |
| P A L T A C                     | 27,600 | 4,755.00 | 131,238,000 |                        |
| 三谷産業                            | 30,700 | 315.00   | 9,670,500   |                        |
| 太平洋興発                           | 5,400  | 1,027.00 | 5,545,800   |                        |
| 西本W i s m e t t a c<br>ホールディングス | 4,500  | 3,605.00 | 16,222,500  | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス               | 1,300  | 1,782.00 | 2,316,600   |                        |
| コア商事ホールディングス                    | 9,800  | 633.00   | 6,203,400   | 貸付有価証券<br>400株（400株）   |
| K P P グループホール                   | 40,900 | 760.00   | 31,084,000  | 貸付有価証券                 |

|             |         |          |             |                        |
|-------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| ディングス       |         |          |             | 2,600株                 |
| ヤマタネ        | 7,700   | 1,660.00 | 12,782,000  |                        |
| 丸紅建材リース     | 1,400   | 1,935.00 | 2,709,000   |                        |
| 日鉄物産        | 12,000  | 9,260.00 | 111,120,000 | 貸付有価証券<br>800株（100株）   |
| 泉州電業        | 8,800   | 3,640.00 | 32,032,000  | 貸付有価証券<br>2,400株       |
| トラスコ中山      | 36,900  | 2,235.00 | 82,471,500  |                        |
| オートバックスセブン  | 61,100  | 1,437.00 | 87,800,700  |                        |
| モリト         | 12,600  | 960.00   | 12,096,000  | 貸付有価証券<br>5,800株       |
| 加藤産業        | 21,300  | 3,665.00 | 78,064,500  |                        |
| 北恵          | 3,500   | 698.00   | 2,443,000   | 貸付有価証券<br>1,700株       |
| イエローハット     | 31,000  | 1,755.00 | 54,405,000  |                        |
| J Kホールディングス | 13,800  | 1,024.00 | 14,131,200  |                        |
| 日伝          | 10,400  | 1,913.00 | 19,895,200  |                        |
| 北沢産業        | 8,300   | 270.00   | 2,241,000   | 貸付有価証券<br>100株         |
| 杉本商事        | 7,800   | 1,922.00 | 14,991,600  |                        |
| 因幡電機産業      | 45,500  | 2,789.00 | 126,899,500 |                        |
| 東テク         | 5,900   | 4,120.00 | 24,308,000  |                        |
| ミスミグループ本社   | 265,000 | 3,150.00 | 834,750,000 | 貸付有価証券<br>100株         |
| アルテック       | 8,700   | 266.00   | 2,314,200   |                        |
| タキヒヨー       | 3,800   | 969.00   | 3,682,200   | 貸付有価証券<br>1,700株（200株） |
| 蔵王産業        | 2,600   | 1,961.00 | 5,098,600   |                        |
| スズケン        | 54,600  | 3,420.00 | 186,732,000 |                        |
| ジェコス        | 11,300  | 854.00   | 9,650,200   |                        |
| グローセル       | 18,800  | 412.00   | 7,745,600   | 貸付有価証券<br>8,100株       |
| ローソン        | 43,600  | 5,380.00 | 234,568,000 |                        |
| サンエー        | 13,400  | 4,130.00 | 55,342,000  | 貸付有価証券<br>6,200株       |
| カワチ薬品       | 13,700  | 2,331.00 | 31,934,700  | 貸付有価証券<br>5,100株       |
| エービーシー・マート  | 25,600  | 6,750.00 | 172,800,000 | 貸付有価証券<br>100株         |
| ハードオフコーポレー  | 6,200   | 1,293.00 | 8,016,600   |                        |

|                     |        |          |            |                            |
|---------------------|--------|----------|------------|----------------------------|
| ション                 |        |          |            | 貸付有価証券<br>100株             |
| アスクル                | 36,300 | 1,717.00 | 62,327,100 | 貸付有価証券<br>9,200株           |
| ゲオホールディングス          | 18,500 | 1,776.00 | 32,856,000 | 貸付有価証券<br>100株             |
| アダストリア              | 21,200 | 2,219.00 | 47,042,800 | 貸付有価証券<br>9,900株           |
| ジーフット               | 7,900  | 300.00   | 2,370,000  | 貸付有価証券<br>4,500株（300株）     |
| シー・ヴィ・エス・ベイ<br>エリア  | 2,000  | 418.00   | 836,000    | 貸付有価証券<br>900株             |
| くら寿司                | 20,600 | 3,205.00 | 66,023,000 | 貸付有価証券<br>3,400株（1,400株）   |
| キャンドウ               | 6,200  | 2,310.00 | 14,322,000 | 貸付有価証券<br>2,900株（1,000株）   |
| I Kホールディングス         | 5,000  | 366.00   | 1,830,000  | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| パルグループホールディ<br>ングス  | 17,200 | 2,760.00 | 47,472,000 |                            |
| エディオン               | 69,500 | 1,314.00 | 91,323,000 | 貸付有価証券<br>32,600株（20,000株） |
| サーラコーポレーション         | 36,900 | 708.00   | 26,125,200 | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| ワッツ                 | 7,600  | 686.00   | 5,213,600  | 貸付有価証券<br>3,300株           |
| ハローズ                | 8,000  | 3,340.00 | 26,720,000 | 貸付有価証券<br>3,700株           |
| フジオフードグループ本<br>社    | 14,600 | 1,356.00 | 19,797,600 | 貸付有価証券<br>1,500株           |
| あみやき亭               | 4,300  | 2,956.00 | 12,710,800 | 貸付有価証券<br>2,000株           |
| ひらまつ                | 33,400 | 192.00   | 6,412,800  | 貸付有価証券<br>7,400株           |
| 大黒天物産               | 5,400  | 4,855.00 | 26,217,000 | 貸付有価証券<br>1,600株（900株）     |
| ハニーズホールディング<br>ス    | 13,900 | 1,455.00 | 20,224,500 |                            |
| ファーマライズホール<br>ディングス | 3,400  | 615.00   | 2,091,000  | 貸付有価証券<br>1,600株           |
| アルペン                | 14,500 | 1,936.00 | 28,072,000 | 貸付有価証券<br>5,200株           |
| ハブ                  | 5,100  | 721.00   | 3,677,100  |                            |

|                        |         |          |             |                        |
|------------------------|---------|----------|-------------|------------------------|
|                        |         |          |             | 貸付有価証券<br>2,600株       |
| クオールホールディングス           | 24,100  | 1,177.00 | 28,365,700  | 貸付有価証券<br>1,000株       |
| ジンズホールディングス            | 10,400  | 3,650.00 | 37,960,000  |                        |
| ビックカメラ                 | 116,800 | 1,184.00 | 138,291,200 | 貸付有価証券<br>54,700株      |
| D C Mホールディングス          | 107,200 | 1,180.00 | 126,496,000 |                        |
| M o n o t a R O        | 249,000 | 1,908.00 | 475,092,000 | 貸付有価証券<br>10,500株      |
| 東京一番フーズ                | 3,600   | 492.00   | 1,771,200   | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| D Dホールディングス            | 10,100  | 777.00   | 7,847,700   | 貸付有価証券<br>4,700株（800株） |
| きちりホールディングス            | 3,700   | 583.00   | 2,157,100   | 貸付有価証券<br>2,200株       |
| アークランドサービス<br>ホールディングス | 14,400  | 2,188.00 | 31,507,200  | 貸付有価証券<br>5,600株       |
| J・フロント リテイリ<br>ング      | 218,300 | 1,247.00 | 272,220,100 | 貸付有価証券<br>400株         |
| ドトール・日レスホール<br>ディングス   | 31,100  | 1,876.00 | 58,343,600  | 貸付有価証券<br>14,600株      |
| マツキヨココカラ&カン<br>パニー     | 106,500 | 6,610.00 | 703,965,000 |                        |
| ブロンコビリー                | 9,400   | 2,410.00 | 22,654,000  | 貸付有価証券<br>800株         |
| Z O Z O                | 116,100 | 3,035.00 | 352,363,500 | 貸付有価証券<br>900株         |
| トレジャー・ファクト<br>リー       | 4,700   | 2,800.00 | 13,160,000  | 貸付有価証券<br>2,200株（500株） |
| 物語コーポレーション             | 9,800   | 7,070.00 | 69,286,000  | 貸付有価証券<br>4,500株（100株） |
| 三越伊勢丹ホールディ<br>ングス      | 295,600 | 1,380.00 | 407,928,000 | 貸付有価証券<br>400株         |
| H a m e e              | 6,100   | 814.00   | 4,965,400   | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| マーケットエンタープラ<br>イズ      | 1,600   | 1,001.00 | 1,601,600   | 貸付有価証券<br>500株（400株）   |
| ウエルシアホールディ<br>ングス      | 91,100  | 3,015.00 | 274,666,500 | 貸付有価証券<br>21,900株      |
| クリエイト S D ホール<br>ディングス | 29,000  | 3,410.00 | 98,890,000  |                        |

|                      |         |           |               |                           |
|----------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| 丸善ＣＨＩホールディングス        | 18,400  | 349.00    | 6,421,600     | 貸付有価証券<br>8,100株          |
| ミサワ                  | 2,800   | 612.00    | 1,713,600     |                           |
| ティーライフ               | 2,100   | 1,265.00  | 2,656,500     | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| エー・ピーホールディングス        | 3,200   | 798.00    | 2,553,600     | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| チムニー                 | 4,800   | 1,153.00  | 5,534,400     | 貸付有価証券<br>2,400株          |
| シュッピン                | 13,100  | 892.00    | 11,685,200    | 貸付有価証券<br>6,100株（2,300株）  |
| オイシックス・ラ・大地          | 23,600  | 2,463.00  | 58,126,800    | 貸付有価証券<br>10,300株（3,500株） |
| ネクステージ               | 40,100  | 3,160.00  | 126,716,000   | 貸付有価証券<br>17,800株（1,700株） |
| ジョイフル本田              | 52,100  | 1,755.00  | 91,435,500    |                           |
| 鳥貴族ホールディングス          | 6,500   | 2,071.00  | 13,461,500    | 貸付有価証券<br>900株（900株）      |
| ホットランド               | 13,400  | 1,382.00  | 18,518,800    | 貸付有価証券<br>800株（600株）      |
| すかいらーくホールディングス       | 240,100 | 1,585.00  | 380,558,500   | 貸付有価証券<br>31,300株         |
| SFPホールディングス          | 9,600   | 1,773.00  | 17,020,800    | 貸付有価証券<br>4,500株（600株）    |
| 綿半ホールディングス           | 13,600  | 1,404.00  | 19,094,400    |                           |
| ヨシックスホールディングス        | 3,100   | 2,102.00  | 6,516,200     | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 57,200  | 1,127.00  | 64,464,400    | 貸付有価証券<br>26,800株（900株）   |
| ゴルフダイジェスト・オンライン      | 7,900   | 978.00    | 7,726,200     | 貸付有価証券<br>1,700株（1,700株）  |
| B E E N O S          | 9,900   | 2,417.00  | 23,928,300    | 貸付有価証券<br>4,700株          |
| あさひ                  | 14,700  | 1,348.00  | 19,815,600    | 貸付有価証券<br>6,900株          |
| 日本調剤                 | 11,900  | 1,174.00  | 13,970,600    | 貸付有価証券<br>5,200株（2,900株）  |
| コスモス薬品               | 17,400  | 12,580.00 | 218,892,000   | 貸付有価証券<br>600株            |
| トーエル                 | 6,900   | 775.00    | 5,347,500     | 貸付有価証券<br>3,400株（200株）    |
| セブン＆アイ・ホール           | 605,300 | 6,083.00  | 3,682,039,900 | 貸付有価証券                    |

|                                         |         |          |             |                          |
|-----------------------------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| ディングス                                   |         |          |             | 29,300株                  |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング                    | 132,100 | 975.00   | 128,797,500 | 貸付有価証券<br>62,300株        |
| ツルハホールディングス                             | 36,900  | 9,410.00 | 347,229,000 | 貸付有価証券<br>9,300株         |
| サンマルクホールディングス                           | 14,100  | 1,775.00 | 25,027,500  |                          |
| フェリシモ                                   | 3,500   | 1,003.00 | 3,510,500   | 貸付有価証券<br>500株（400株）     |
| トリドールホールディングス                           | 43,700  | 2,731.00 | 119,344,700 |                          |
| T O K Y O   B A S E                     | 18,100  | 441.00   | 7,982,100   | 貸付有価証券<br>8,100株（1,000株） |
| ウイルプラスホールディングス                          | 2,500   | 1,157.00 | 2,892,500   | 貸付有価証券<br>700株（700株）     |
| J Mホールディングス                             | 14,900  | 1,812.00 | 26,998,800  |                          |
| サツドラホールディングス                            | 7,100   | 785.00   | 5,573,500   | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株） |
| アレンザホールディングス                            | 13,100  | 1,008.00 | 13,204,800  | 貸付有価証券<br>6,200株         |
| 串カツ田中ホールディングス                           | 4,700   | 1,605.00 | 7,543,500   | 貸付有価証券<br>700株           |
| パロックジャパンリミテッド                           | 11,400  | 835.00   | 9,519,000   | 貸付有価証券<br>5,300株         |
| クスリのアオキホールディングス                         | 15,700  | 7,010.00 | 110,057,000 |                          |
| 力の源ホールディングス                             | 9,000   | 1,434.00 | 12,906,000  | 貸付有価証券<br>4,000株         |
| F O O D   &   L I F E   C O M P A N I E | 100,900 | 3,545.00 | 357,690,500 |                          |
| メディカルシステムネットワーク                         | 15,200  | 399.00   | 6,064,800   | 貸付有価証券<br>500株           |
| 一家ホールディングス                              | 3,300   | 600.00   | 1,980,000   | 貸付有価証券<br>200株           |
| ジャパングラフトホールディングス                        | 4,500   | 580.00   | 2,610,000   | 貸付有価証券<br>2,100株         |
| はるやまホールディングス                            | 6,500   | 442.00   | 2,873,000   | 貸付有価証券<br>3,700株（600株）   |
| ノジマ                                     | 57,300  | 1,313.00 | 75,234,900  | 貸付有価証券<br>100株           |
| カップ・クリエイト                               | 27,600  | 1,428.00 | 39,412,800  | 貸付有価証券<br>12,900株（200株）  |

|                      |         |          |             |                           |
|----------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| ライトオン                | 11,800  | 553.00   | 6,525,400   | 貸付有価証券<br>2,800株（2,800株）  |
| 良品計画                 | 226,600 | 1,396.00 | 316,333,600 |                           |
| パリミキホールディングス         | 19,500  | 277.00   | 5,401,500   | 貸付有価証券<br>700株            |
| アドヴァングループ            | 16,700  | 895.00   | 14,946,500  | 貸付有価証券<br>100株            |
| アルビス                 | 5,700   | 2,408.00 | 13,725,600  |                           |
| コナカ                  | 17,000  | 354.00   | 6,018,000   | 貸付有価証券<br>6,100株          |
| ハウス オブ ローゼ           | 1,900   | 1,641.00 | 3,117,900   |                           |
| G - 7 ホールディングス       | 21,900  | 1,444.00 | 31,623,600  |                           |
| イオン北海道               | 26,000  | 890.00   | 23,140,000  | 貸付有価証券<br>12,100株         |
| コジマ                  | 33,900  | 559.00   | 18,950,100  | 貸付有価証券<br>14,400株（1,500株） |
| ヒマラヤ                 | 4,900   | 941.00   | 4,610,900   | 貸付有価証券<br>2,300株（300株）    |
| コーナン商事               | 23,700  | 3,325.00 | 78,802,500  | 貸付有価証券<br>11,000株         |
| エコス                  | 6,500   | 1,856.00 | 12,064,000  | 貸付有価証券<br>3,000株（100株）    |
| ワタミ                  | 21,200  | 899.00   | 19,058,800  | 貸付有価証券<br>6,500株          |
| マルシェ                 | 5,100   | 387.00   | 1,973,700   | 貸付有価証券<br>2,300株（100株）    |
| パン・パシフィック・インターナショナルホ | 354,500 | 2,553.00 | 905,038,500 |                           |
| 西松屋チェーン              | 38,900  | 1,558.00 | 60,606,200  | 貸付有価証券<br>18,200株         |
| ゼンショーホールディングス        | 96,100  | 3,680.00 | 353,648,000 | 貸付有価証券<br>5,700株（2,700株）  |
| 幸楽苑ホールディングス          | 11,500  | 1,060.00 | 12,190,000  | 貸付有価証券<br>5,300株（100株）    |
| ハークスレイ               | 5,500   | 713.00   | 3,921,500   | 貸付有価証券<br>1,600株（300株）    |
| サイゼリヤ                | 29,200  | 3,095.00 | 90,374,000  | 貸付有価証券<br>2,100株          |
| V Tホールディングス          | 66,700  | 503.00   | 33,550,100  |                           |
| 魚力                   | 5,400   | 2,155.00 | 11,637,000  |                           |
| ポプラ                  | 4,100   | 139.00   | 569,900     | 貸付有価証券                    |

|                                        |        |          |             |                           |
|----------------------------------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
|                                        |        |          |             | 1,800株                    |
| フジ・コーポレーション                            | 9,900  | 1,257.00 | 12,444,300  |                           |
| ユナイテッドアローズ                             | 18,800 | 1,734.00 | 32,599,200  | 貸付有価証券<br>2,100株          |
| ハイデイ日高                                 | 26,000 | 2,040.00 | 53,040,000  | 貸付有価証券<br>12,300株         |
| Y U - W A C r e a t<br>i o n H o l d i | 9,300  | 200.00   | 1,860,000   | 貸付有価証券<br>300株（100株）      |
| コロワイド                                  | 80,900 | 1,873.00 | 151,525,700 | 貸付有価証券<br>38,200株（9,100株） |
| ピーシーデポコーポレー<br>ション                     | 19,600 | 292.00   | 5,723,200   | 貸付有価証券<br>4,500株          |
| 壱番屋                                    | 13,900 | 4,680.00 | 65,052,000  | 貸付有価証券<br>6,400株          |
| トップカルチャー                               | 5,000  | 197.00   | 985,000     | 貸付有価証券<br>100株            |
| P L A N T                              | 3,600  | 660.00   | 2,376,000   | 貸付有価証券<br>200株（200株）      |
| スギホールディングス                             | 35,400 | 5,680.00 | 201,072,000 | 貸付有価証券<br>3,000株          |
| 薬王堂ホールディングス                            | 9,800  | 2,435.00 | 23,863,000  | 貸付有価証券<br>4,600株（600株）    |
| スクロール                                  | 26,100 | 769.00   | 20,070,900  | 貸付有価証券<br>100株            |
| ヨンドシーホールディン<br>グス                      | 15,100 | 1,793.00 | 27,074,300  | 貸付有価証券<br>7,000株          |
| 木曽路                                    | 26,600 | 2,166.00 | 57,615,600  | 貸付有価証券<br>12,400株         |
| S R S ホールディングス                         | 29,000 | 912.00   | 26,448,000  | 貸付有価証券<br>13,600株（900株）   |
| 千趣会                                    | 32,300 | 395.00   | 12,758,500  |                           |
| タカキュー                                  | 10,900 | 80.00    | 872,000     | 貸付有価証券<br>5,700株          |
| リテールパートナーズ                             | 26,100 | 1,338.00 | 34,921,800  | 貸付有価証券<br>12,300株         |
| ケーヨー                                   | 28,300 | 893.00   | 25,271,900  | 貸付有価証券<br>600株            |
| 上新電機                                   | 15,600 | 1,970.00 | 30,732,000  |                           |
| 日本瓦斯                                   | 94,100 | 1,866.00 | 175,590,600 |                           |
| ロイヤルホールディング<br>ス                       | 34,000 | 2,527.00 | 85,918,000  | 貸付有価証券<br>11,700株         |
| 東天紅                                    | 1,100  | 751.00   | 826,100     |                           |

|                      |         |           |               |                          |
|----------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| いなげや                 | 17,100  | 1,316.00  | 22,503,600    | 貸付有価証券<br>800株（700株）     |
| チヨダ                  | 16,800  | 791.00    | 13,288,800    | 貸付有価証券<br>6,600株（100株）   |
| ライフコーポレーション          | 15,300  | 2,770.00  | 42,381,000    |                          |
| リンガーハット              | 22,700  | 2,253.00  | 51,143,100    | 貸付有価証券<br>10,600株        |
| M r M a x H D        | 24,600  | 681.00    | 16,752,600    |                          |
| テンアライド               | 16,700  | 273.00    | 4,559,100     | 貸付有価証券<br>8,600株（1,600株） |
| A O K I ホールディングス     | 32,600  | 766.00    | 24,971,600    | 貸付有価証券<br>600株           |
| オークワ                 | 28,100  | 897.00    | 25,205,700    | 貸付有価証券<br>13,100株        |
| コメリ                  | 27,000  | 2,635.00  | 71,145,000    |                          |
| 青山商事                 | 37,500  | 932.00    | 34,950,000    | 貸付有価証券<br>400株           |
| しまむら                 | 20,600  | 12,650.00 | 260,590,000   | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| はせがわ                 | 7,400   | 331.00    | 2,449,400     |                          |
| 高島屋                  | 132,400 | 1,862.00  | 246,528,800   | 貸付有価証券<br>2,400株         |
| 松屋                   | 29,800  | 1,135.00  | 33,823,000    | 貸付有価証券<br>200株           |
| エイチ・ツー・オー リ<br>テイリング | 85,500  | 1,322.00  | 113,031,000   |                          |
| 近鉄百貨店                | 5,600   | 2,454.00  | 13,742,400    | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| 丸井グループ               | 129,500 | 2,055.00  | 266,122,500   |                          |
| アクシアル リテイリン<br>グ     | 12,000  | 3,520.00  | 42,240,000    |                          |
| 井筒屋                  | 7,400   | 348.00    | 2,575,200     | 貸付有価証券<br>3,500株（200株）   |
| イオン                  | 595,300 | 2,614.00  | 1,556,114,200 | 貸付有価証券<br>18,200株        |
| イズミ                  | 26,700  | 3,005.00  | 80,233,500    | 貸付有価証券<br>4,600株         |
| 平和堂                  | 29,400  | 2,156.00  | 63,386,400    | 貸付有価証券<br>13,800株        |
| フジ                   | 27,000  | 1,828.00  | 49,356,000    | 貸付有価証券<br>12,800株（400株）  |

|                    |         |           |               |                           |
|--------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| ヤオコー               | 19,900  | 6,790.00  | 135,121,000   | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| ゼビオホールディングス        | 23,800  | 956.00    | 22,752,800    |                           |
| ケーズホールディングス        | 139,700 | 1,174.00  | 164,007,800   |                           |
| O l y m p i c グループ | 5,800   | 522.00    | 3,027,600     | 貸付有価証券<br>2,600株          |
| 日産東京販売ホールディングス     | 19,900  | 340.00    | 6,766,000     | 貸付有価証券<br>6,700株          |
| シルバーライフ            | 4,000   | 1,816.00  | 7,264,000     | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| Genky Drug Stores  | 7,700   | 4,230.00  | 32,571,000    | 貸付有価証券<br>900株（900株）      |
| ナルミヤ・インターナショナル     | 2,500   | 924.00    | 2,310,000     | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| ブックオフグループホールディングス  | 10,200  | 1,282.00  | 13,076,400    | 貸付有価証券<br>800株（800株）      |
| ギフトホールディングス        | 3,700   | 4,175.00  | 15,447,500    |                           |
| アインホールディングス        | 24,200  | 5,610.00  | 135,762,000   |                           |
| 元気寿司               | 5,000   | 3,010.00  | 15,050,000    | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| ヤマダホールディングス        | 720,100 | 479.00    | 344,927,900   | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| アークランズ             | 25,700  | 1,452.00  | 37,316,400    |                           |
| ニトリホールディングス        | 71,000  | 16,065.00 | 1,140,615,000 | 貸付有価証券<br>100株            |
| グルメ杵屋              | 14,200  | 1,009.00  | 14,327,800    | 貸付有価証券<br>6,700株          |
| 愛眼                 | 11,500  | 165.00    | 1,897,500     |                           |
| ケーユーホールディングス       | 10,300  | 1,444.00  | 14,873,200    |                           |
| 吉野家ホールディングス        | 68,700  | 2,376.00  | 163,231,200   | 貸付有価証券<br>32,200株（2,000株） |
| 松屋フーズホールディングス      | 8,300   | 3,985.00  | 33,075,500    | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| サガミホールディングス        | 28,200  | 1,262.00  | 35,588,400    | 貸付有価証券<br>13,200株         |
| 関西フードマーケット         | 15,900  | 1,349.00  | 21,449,100    |                           |
| 王将フードサービス          | 11,600  | 6,040.00  | 70,064,000    |                           |
| ミニストップ             | 12,800  | 1,408.00  | 18,022,400    | 貸付有価証券<br>6,000株          |
| アークス               | 32,200  | 2,210.00  | 71,162,000    | 貸付有価証券                    |

|                         |         |           |               |                         |
|-------------------------|---------|-----------|---------------|-------------------------|
|                         |         |           |               | 15,000株                 |
| パローホールディングス             | 33,500  | 1,927.00  | 64,554,500    |                         |
| ベルク                     | 8,700   | 5,500.00  | 47,850,000    | 貸付有価証券<br>4,000株        |
| 大庄                      | 8,400   | 1,036.00  | 8,702,400     | 貸付有価証券<br>4,000株        |
| ファーストリテイリング             | 26,300  | 82,890.00 | 2,180,007,000 |                         |
| サンドラッグ                  | 66,700  | 3,660.00  | 244,122,000   |                         |
| サックスパー ホール<br>ディングス     | 16,700  | 763.00    | 12,742,100    | 貸付有価証券<br>700株（700株）    |
| ヤマザワ                    | 2,900   | 1,474.00  | 4,274,600     | 貸付有価証券<br>1,400株（700株）  |
| やまや                     | 3,200   | 2,607.00  | 8,342,400     | 貸付有価証券<br>1,500株        |
| ベルーナ                    | 42,300  | 683.00    | 28,890,900    |                         |
| いよぎんホールディング<br>ス        | 194,500 | 798.00    | 155,211,000   |                         |
| しずおかフィナンシャル<br>グループ     | 369,400 | 1,098.00  | 405,601,200   | 貸付有価証券<br>15,700株       |
| ちゅうぎんフィナンシャ<br>ルグループ    | 137,600 | 960.00    | 132,096,000   |                         |
| 島根銀行                    | 5,000   | 517.00    | 2,585,000     | 貸付有価証券<br>1,700株        |
| じもとホールディングス             | 9,600   | 434.00    | 4,166,400     | 貸付有価証券<br>600株          |
| めぶきフィナンシャルグ<br>ループ      | 811,200 | 363.00    | 294,465,600   | 貸付有価証券<br>400株          |
| 東京きらぼしフィナン<br>シャルグループ   | 20,900  | 2,976.00  | 62,198,400    |                         |
| 九州フィナンシャルグ<br>ループ       | 287,600 | 508.00    | 146,100,800   |                         |
| ゆうちょ銀行                  | 465,500 | 1,201.00  | 559,065,500   | 貸付有価証券<br>111,100株      |
| 富山第一銀行                  | 40,700  | 642.00    | 26,129,400    | 貸付有価証券<br>19,000株（800株） |
| コンコルディア・フィナ<br>ンシャルグループ | 901,000 | 574.00    | 517,174,000   | 貸付有価証券<br>900株          |
| 西日本フィナンシャル<br>ホールディングス  | 103,500 | 1,121.00  | 116,023,500   | 貸付有価証券<br>200株          |
| 三十三フィナンシャルグ<br>ループ      | 14,600  | 1,700.00  | 24,820,000    | 貸付有価証券<br>300株          |
| 第四北越フィナンシャル             | 25,700  | 3,205.00  | 82,368,500    |                         |

| グループ              |            |          |                |                   |
|-------------------|------------|----------|----------------|-------------------|
| ひろぎんホールディングス      | 213,300    | 686.00   | 146,323,800    |                   |
| おきなわフィナンシャルグループ   | 15,600     | 2,345.00 | 36,582,000     |                   |
| 十六フィナンシャルグループ     | 21,200     | 3,170.00 | 67,204,000     |                   |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 13,800     | 4,245.00 | 58,581,000     |                   |
| プロクレアホールディングス     | 20,000     | 2,353.00 | 47,060,000     |                   |
| あいちフィナンシャルグループ    | 22,900     | 2,344.00 | 53,677,600     | 貸付有価証券<br>900株    |
| S B I 新生銀行        | 48,200     | 2,414.00 | 116,354,800    | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| あおぞら銀行            | 102,800    | 2,632.00 | 270,569,600    |                   |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 10,379,700 | 981.00   | 10,182,485,700 |                   |
| りそなホールディングス       | 2,086,500  | 734.50   | 1,532,534,250  | 貸付有価証券<br>1,900株  |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 297,100    | 4,885.00 | 1,451,333,500  |                   |
| 三井住友フィナンシャルグループ   | 1,194,600  | 5,924.00 | 7,076,810,400  |                   |
| 千葉銀行              | 455,600    | 985.00   | 448,766,000    | 貸付有価証券<br>12,000株 |
| 群馬銀行              | 317,200    | 501.00   | 158,917,200    |                   |
| 武蔵野銀行             | 21,000     | 2,485.00 | 52,185,000     |                   |
| 千葉興業銀行            | 34,000     | 511.00   | 17,374,000     | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 筑波銀行              | 71,700     | 233.00   | 16,706,100     | 貸付有価証券<br>100株    |
| 七十七銀行             | 52,300     | 2,393.00 | 125,153,900    |                   |
| 秋田銀行              | 11,000     | 1,930.00 | 21,230,000     |                   |
| 山形銀行              | 18,200     | 1,278.00 | 23,259,600     | 貸付有価証券<br>100株    |
| 岩手銀行              | 11,200     | 2,404.00 | 26,924,800     |                   |
| 東邦銀行              | 129,300    | 248.00   | 32,066,400     |                   |
| 東北銀行              | 7,100      | 1,024.00 | 7,270,400      | 貸付有価証券<br>200株    |
| ふくおかフィナンシャル       | 130,500    | 3,050.00 | 398,025,000    |                   |

| グループ                |           |          |               |                   |
|---------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| スルガ銀行               | 144,100   | 422.00   | 60,810,200    | 貸付有価証券<br>14,200株 |
| 八十二銀行               | 335,300   | 596.00   | 199,838,800   |                   |
| 山梨中央銀行              | 16,800    | 1,332.00 | 22,377,600    |                   |
| 大垣共立銀行              | 31,200    | 1,978.00 | 61,713,600    |                   |
| 福井銀行                | 14,600    | 1,681.00 | 24,542,600    |                   |
| 清水銀行                | 6,500     | 1,538.00 | 9,997,000     |                   |
| 富山銀行                | 2,200     | 1,764.00 | 3,880,800     | 貸付有価証券<br>200株    |
| 滋賀銀行                | 27,200    | 2,879.00 | 78,308,800    |                   |
| 南都銀行                | 24,600    | 2,648.00 | 65,140,800    | 貸付有価証券<br>100株    |
| 百五銀行                | 153,800   | 415.00   | 63,827,000    | 貸付有価証券<br>900株    |
| 京都銀行                | 51,800    | 6,370.00 | 329,966,000   |                   |
| 紀陽銀行                | 58,500    | 1,616.00 | 94,536,000    |                   |
| ほくほくフィナンシャル<br>グループ | 103,900   | 1,032.00 | 107,224,800   |                   |
| 山陰合同銀行              | 102,300   | 831.00   | 85,011,300    |                   |
| 鳥取銀行                | 4,700     | 1,255.00 | 5,898,500     | 貸付有価証券<br>400株    |
| 百十四銀行               | 14,900    | 1,965.00 | 29,278,500    |                   |
| 四国銀行                | 26,000    | 940.00   | 24,440,000    |                   |
| 阿波銀行                | 24,200    | 2,208.00 | 53,433,600    | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| 大分銀行                | 9,800     | 2,248.00 | 22,030,400    |                   |
| 宮崎銀行                | 10,700    | 2,750.00 | 29,425,000    | 貸付有価証券<br>100株    |
| 佐賀銀行                | 9,600     | 1,827.00 | 17,539,200    |                   |
| 琉球銀行                | 37,500    | 1,079.00 | 40,462,500    |                   |
| セブン銀行               | 585,600   | 267.00   | 156,355,200   | 貸付有価証券<br>6,000株  |
| みずほフィナンシャルグ<br>ループ  | 2,364,300 | 2,129.50 | 5,034,776,850 |                   |
| 高知銀行                | 5,000     | 732.00   | 3,660,000     |                   |
| 山口フィナンシャルグ<br>ループ   | 180,500   | 915.00   | 165,157,500   |                   |
| 長野銀行                | 4,500     | 1,509.00 | 6,790,500     |                   |
| 名古屋銀行               | 10,800    | 3,620.00 | 39,096,000    |                   |

|                    |           |          |               |                           |
|--------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| 北洋銀行               | 247,700   | 297.00   | 73,566,900    |                           |
| 大光銀行               | 4,300     | 1,239.00 | 5,327,700     | 貸付有価証券<br>100株            |
| 愛媛銀行               | 22,000    | 948.00   | 20,856,000    |                           |
| トマト銀行              | 4,800     | 1,085.00 | 5,208,000     |                           |
| 京葉銀行               | 75,900    | 646.00   | 49,031,400    | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| 栃木銀行               | 74,800    | 326.00   | 24,384,800    |                           |
| 北日本銀行              | 5,700     | 2,147.00 | 12,237,900    |                           |
| 東和銀行               | 30,000    | 603.00   | 18,090,000    |                           |
| 福島銀行               | 15,300    | 244.00   | 3,733,200     | 貸付有価証券<br>700株（700株）      |
| 大東銀行               | 5,700     | 725.00   | 4,132,500     | 貸付有価証券<br>900株            |
| トモニホールディングス        | 132,100   | 382.00   | 50,462,200    | 貸付有価証券<br>100株            |
| フィデアホールディングス       | 16,900    | 1,459.00 | 24,657,100    | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| 池田泉州ホールディングス       | 209,300   | 251.00   | 52,534,300    | 貸付有価証券<br>1,400株          |
| F P G              | 66,300    | 1,180.00 | 78,234,000    |                           |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 13,400    | 1,050.00 | 14,070,000    | 貸付有価証券<br>1,600株          |
| マーキュリアホールディングス     | 8,500     | 794.00   | 6,749,000     | 貸付有価証券<br>200株            |
| S B I ホールディングス     | 236,600   | 2,871.00 | 679,278,600   | 貸付有価証券<br>12,100株（900株）   |
| 日本アジア投資            | 11,500    | 229.00   | 2,633,500     | 貸付有価証券<br>4,000株（600株）    |
| ジャフコ グループ          | 54,600    | 2,139.00 | 116,789,400   | 貸付有価証券<br>25,100株（7,700株） |
| 大和証券グループ本社         | 1,169,000 | 626.00   | 731,794,000   |                           |
| 野村ホールディングス         | 3,010,700 | 548.10   | 1,650,164,670 | 貸付有価証券<br>200株            |
| 岡三証券グループ           | 143,500   | 443.00   | 63,570,500    | 貸付有価証券<br>3,200株          |
| 丸三証券               | 54,400    | 427.00   | 23,228,800    | 貸付有価証券<br>2,600株          |
| 東洋証券               | 54,200    | 324.00   | 17,560,800    | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| 東海東京フィナンシャ         | 177,900   | 381.00   | 67,779,900    | 貸付有価証券                    |

|                           |           |          |               |                        |
|---------------------------|-----------|----------|---------------|------------------------|
| ル・ホールディングス                |           |          |               | 10,400株                |
| 光世証券                      | 3,300     | 365.00   | 1,204,500     | 貸付有価証券<br>100株         |
| 水戸証券                      | 43,900    | 298.00   | 13,082,200    |                        |
| いちよし証券                    | 30,100    | 634.00   | 19,083,400    |                        |
| 松井証券                      | 96,600    | 794.00   | 76,700,400    | 貸付有価証券<br>100株         |
| マネックスグループ                 | 182,600   | 513.00   | 93,673,800    | 貸付有価証券<br>4,300株       |
| 極東証券                      | 20,300    | 617.00   | 12,525,100    |                        |
| 岩井コスモホールディングス             | 18,600    | 1,346.00 | 25,035,600    |                        |
| アイザワ証券グループ                | 23,600    | 697.00   | 16,449,200    | 貸付有価証券<br>300株         |
| マネーパートナーズグループ             | 15,100    | 256.00   | 3,865,600     |                        |
| スパークス・グループ                | 18,200    | 1,747.00 | 31,795,400    | 貸付有価証券<br>100株         |
| 小林洋行                      | 6,200     | 234.00   | 1,450,800     | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| かんぽ生命保険                   | 198,500   | 2,364.00 | 469,254,000   | 貸付有価証券<br>2,100株       |
| S O M P Oホールディングス         | 280,600   | 5,641.00 | 1,582,864,600 | 貸付有価証券<br>400株         |
| アニコム ホールディングス             | 55,500    | 537.00   | 29,803,500    |                        |
| M S & A D インシュアランスグループホール | 332,700   | 4,390.00 | 1,460,553,000 |                        |
| 第一生命ホールディングス              | 832,200   | 2,988.00 | 2,486,613,600 | 貸付有価証券<br>2,700株       |
| 東京海上ホールディングス              | 1,646,200 | 2,827.50 | 4,654,630,500 | 貸付有価証券<br>500株         |
| T & Dホールディングス             | 438,700   | 2,129.00 | 933,992,300   |                        |
| アドバンスクリエイト                | 9,500     | 1,202.00 | 11,419,000    | 貸付有価証券<br>3,200株       |
| 全国保証                      | 42,800    | 5,180.00 | 221,704,000   | 貸付有価証券<br>3,500株       |
| あんしん保証                    | 7,100     | 265.00   | 1,881,500     |                        |
| ジェイリース                    | 4,900     | 2,349.00 | 11,510,100    | 貸付有価証券<br>2,300株（900株） |
| イントラスト                    | 5,600     | 925.00   | 5,180,000     |                        |

|                         |           |           |               |                            |
|-------------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| 日本モーゲージサービス             | 8,000     | 884.00    | 7,072,000     | 貸付有価証券<br>3,500株           |
| C a s a                 | 5,600     | 818.00    | 4,580,800     | 貸付有価証券<br>2,200株（100株）     |
| アルヒ                     | 20,200    | 1,101.00  | 22,240,200    | 貸付有価証券<br>6,800株（6,800株）   |
| プレミアグループ                | 27,400    | 1,564.00  | 42,853,600    | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株）   |
| ネットプロテクションズ<br>ホールディングス | 54,000    | 584.00    | 31,536,000    | 貸付有価証券<br>14,000株（13,900株） |
| クレディセゾン                 | 103,600   | 1,792.00  | 185,651,200   | 貸付有価証券<br>100株             |
| 芙蓉総合リース                 | 15,000    | 8,990.00  | 134,850,000   |                            |
| みずほリース                  | 24,300    | 3,560.00  | 86,508,000    |                            |
| 東京センチュリー                | 30,500    | 4,570.00  | 139,385,000   |                            |
| 日本証券金融                  | 65,500    | 1,009.00  | 66,089,500    |                            |
| アイフル                    | 270,700   | 360.00    | 97,452,000    |                            |
| リコーリース                  | 15,500    | 3,915.00  | 60,682,500    | 貸付有価証券<br>7,200株           |
| イオンフィナンシャル<br>サービス      | 93,900    | 1,318.00  | 123,760,200   | 貸付有価証券<br>100株             |
| アコム                     | 291,700   | 322.00    | 93,927,400    | 貸付有価証券<br>3,600株           |
| ジャックス                   | 17,400    | 4,230.00  | 73,602,000    |                            |
| オリエントコーポレー<br>ション       | 42,700    | 1,156.00  | 49,361,200    | 貸付有価証券<br>100株             |
| オリックス                   | 1,093,500 | 2,352.00  | 2,571,912,000 |                            |
| 三菱ＨＣキャピタル               | 637,400   | 678.00    | 432,157,200   | 貸付有価証券<br>3,600株           |
| 九州リースサービス               | 6,800     | 878.00    | 5,970,400     | 貸付有価証券<br>3,100株（100株）     |
| 日本取引所グループ               | 459,300   | 1,955.00  | 897,931,500   |                            |
| イー・ギャランティ               | 26,400    | 2,220.00  | 58,608,000    |                            |
| アサックス                   | 6,600     | 603.00    | 3,979,800     | 貸付有価証券<br>4,200株           |
| ＮＥＣキャピタルソ<br>リューション     | 8,000     | 2,531.00  | 20,248,000    |                            |
| 大東建託                    | 59,900    | 12,610.00 | 755,339,000   |                            |
| いちご                     | 188,200   | 286.00    | 53,825,200    | 貸付有価証券<br>44,500株          |
| 日本駐車場開発                 | 194,600   | 257.00    | 50,012,200    |                            |

|                  |         |          |             |                         |
|------------------|---------|----------|-------------|-------------------------|
| スター・マイカ・ホールディングス | 14,800  | 666.00   | 9,856,800   |                         |
| S R E ホールディングス   | 8,000   | 3,440.00 | 27,520,000  | 貸付有価証券<br>3,700株（400株）  |
| A D ワークスグループ     | 36,600  | 160.00   | 5,856,000   | 貸付有価証券<br>18,100株（700株） |
| ヒューリック           | 381,300 | 1,074.00 | 409,516,200 | 貸付有価証券<br>24,300株       |
| 三栄建築設計           | 7,900   | 1,480.00 | 11,692,000  | 貸付有価証券<br>400株（400株）    |
| 野村不動産ホールディングス    | 102,200 | 2,897.00 | 296,073,400 |                         |
| 三重交通グループホールディングス | 35,000  | 498.00   | 17,430,000  | 貸付有価証券<br>13,700株       |
| サムティ             | 26,000  | 2,032.00 | 52,832,000  | 貸付有価証券<br>9,800株        |
| ディア・ライフ          | 25,100  | 620.00   | 15,562,000  |                         |
| コーセーアールイー        | 4,600   | 743.00   | 3,417,800   | 貸付有価証券<br>2,300株        |
| 地主               | 12,500  | 1,889.00 | 23,612,500  | 貸付有価証券<br>3,700株        |
| プレサンスコーポレーション    | 21,500  | 1,689.00 | 36,313,500  |                         |
| ハウスコム            | 2,300   | 1,117.00 | 2,569,100   |                         |
| J P M C          | 8,300   | 999.00   | 8,291,700   |                         |
| サンセイランディック       | 4,200   | 818.00   | 3,435,600   |                         |
| エストラスト           | 1,800   | 600.00   | 1,080,000   |                         |
| フージャースホールディングス   | 25,200  | 813.00   | 20,487,600  |                         |
| オープンハウスグループ      | 59,800  | 4,860.00 | 290,628,000 |                         |
| 東急不動産ホールディングス    | 491,500 | 635.00   | 312,102,500 | 貸付有価証券<br>100株          |
| 飯田グループホールディングス   | 143,200 | 2,174.00 | 311,316,800 | 貸付有価証券<br>1,000株        |
| イーグランド           | 2,200   | 1,519.00 | 3,341,800   |                         |
| ムゲンエステート         | 9,700   | 513.00   | 4,976,100   | 貸付有価証券<br>500株（500株）    |
| ビーロット            | 9,900   | 608.00   | 6,019,200   | 貸付有価証券<br>400株          |
| ファーストブラザーズ       | 2,900   | 866.00   | 2,511,400   | 貸付有価証券<br>1,600株        |

|                  |         |          |               |                            |
|------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| And Doホールディングス   | 9,700   | 880.00   | 8,536,000     |                            |
| シーアールイー          | 7,400   | 1,070.00 | 7,918,000     | 貸付有価証券<br>800株（700株）       |
| プロパティエージェント      | 1,800   | 1,188.00 | 2,138,400     |                            |
| ケイアイスター不動産       | 7,900   | 4,060.00 | 32,074,000    | 貸付有価証券<br>100株             |
| アグレ都市デザイン        | 2,600   | 1,623.00 | 4,219,800     |                            |
| グッドコムアセット        | 15,100  | 831.00   | 12,548,100    |                            |
| ジェイ・エス・ビー        | 4,000   | 3,870.00 | 15,480,000    |                            |
| ロードスターキャピタル      | 7,000   | 1,515.00 | 10,605,000    | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| テンポイノベーション       | 4,400   | 1,190.00 | 5,236,000     | 貸付有価証券<br>300株             |
| グローバル・リンク・マネジメント | 2,800   | 1,260.00 | 3,528,000     | 貸付有価証券<br>500株（200株）       |
| フェイスネットワーク       | 2,000   | 1,681.00 | 3,362,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| パーク 2 4          | 127,400 | 2,016.00 | 256,838,400   | 貸付有価証券<br>43,900株（16,800株） |
| パラカ              | 5,800   | 1,930.00 | 11,194,000    |                            |
| 三井不動産            | 710,500 | 2,457.00 | 1,745,698,500 |                            |
| 三菱地所             | 986,400 | 1,622.00 | 1,599,940,800 |                            |
| 平和不動産            | 26,500  | 3,585.00 | 95,002,500    |                            |
| 東京建物             | 155,800 | 1,580.00 | 246,164,000   |                            |
| 京阪神ビルディング        | 20,600  | 1,227.00 | 25,276,200    |                            |
| 住友不動産            | 295,500 | 3,080.00 | 910,140,000   | 貸付有価証券<br>200株             |
| テーオーシー           | 29,600  | 623.00   | 18,440,800    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 東京楽天地            | 2,800   | 4,400.00 | 12,320,000    | 貸付有価証券<br>200株             |
| レオパレス 2 1        | 184,000 | 322.00   | 59,248,000    | 貸付有価証券<br>49,400株          |
| スターツコーポレーション     | 23,500  | 2,552.00 | 59,972,000    |                            |
| フジ住宅             | 22,900  | 673.00   | 15,411,700    |                            |
| 空港施設             | 19,700  | 516.00   | 10,165,200    |                            |
| 明和地所             | 7,400   | 923.00   | 6,830,200     | 貸付有価証券<br>3,000株           |

|                        |        |          |             |                          |
|------------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| ゴールドクレスト               | 15,500 | 1,660.00 | 25,730,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| エスリード                  | 7,700  | 2,098.00 | 16,154,600  | 貸付有価証券<br>3,600株（100株）   |
| 日神グループホールディングス         | 26,200 | 449.00   | 11,763,800  | 貸付有価証券<br>12,300株        |
| 日本エスコン                 | 36,700 | 824.00   | 30,240,800  | 貸付有価証券<br>400株           |
| M I R A R T H ホールディングス | 82,600 | 360.00   | 29,736,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| A V A N T I A          | 7,400  | 797.00   | 5,897,800   | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| イオンモール                 | 84,800 | 1,791.00 | 151,876,800 | 貸付有価証券<br>40,000株        |
| 毎日コムネット                | 5,400  | 711.00   | 3,839,400   | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| ファースト住建                | 5,900  | 1,070.00 | 6,313,000   | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| カチタス                   | 43,900 | 2,581.00 | 113,305,900 | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| トーセイ                   | 27,200 | 1,435.00 | 39,032,000  | 貸付有価証券<br>100株           |
| 穴吹興産                   | 2,900  | 2,187.00 | 6,342,300   |                          |
| サンフロンティア不動産            | 27,200 | 1,184.00 | 32,204,800  |                          |
| F J ネクストホールディングス       | 17,200 | 974.00   | 16,752,800  |                          |
| インテリックス                | 3,500  | 573.00   | 2,005,500   |                          |
| ランドビジネス                | 5,300  | 225.00   | 1,192,500   |                          |
| サンネクスタグループ             | 4,300  | 979.00   | 4,209,700   | 貸付有価証券<br>2,400株         |
| グランディハウス               | 12,200 | 570.00   | 6,954,000   |                          |
| 日本空港ビルデング              | 57,800 | 6,400.00 | 369,920,000 |                          |
| 明豊ファシリティワークス           | 7,600  | 801.00   | 6,087,600   |                          |
| 日本工営                   | 10,300 | 3,255.00 | 33,526,500  | 貸付有価証券<br>100株           |
| L I F U L L            | 58,300 | 192.00   | 11,193,600  | 貸付有価証券<br>9,600株（4,300株） |
| M I X I                | 38,800 | 2,592.00 | 100,569,600 | 貸付有価証券<br>200株           |
| ジェイエイシーリクルー            | 15,400 | 2,261.00 | 34,819,400  |                          |

| トメント                 |         |          |             |                           |
|----------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| 日本M & A センターホールディングス | 292,800 | 1,193.00 | 349,310,400 |                           |
| メンバーズ                | 5,000   | 1,526.00 | 7,630,000   | 貸付有価証券<br>1,200株（600株）    |
| 中広                   | 2,100   | 397.00   | 833,700     |                           |
| U T グループ             | 25,100  | 2,344.00 | 58,834,400  |                           |
| アイティメディア             | 6,500   | 1,485.00 | 9,652,500   |                           |
| E・Jホールディングス          | 10,000  | 1,330.00 | 13,300,000  | 貸付有価証券<br>3,500株          |
| オープンアップグループ          | 51,000  | 1,906.00 | 97,206,000  |                           |
| コシダカホールディングス         | 51,100  | 908.00   | 46,398,800  | 貸付有価証券<br>9,400株          |
| アルトナー                | 3,700   | 1,069.00 | 3,955,300   |                           |
| パソナグループ              | 20,700  | 1,924.00 | 39,826,800  | 貸付有価証券<br>3,300株          |
| C D S                | 3,800   | 1,788.00 | 6,794,400   |                           |
| リンクアンドモチベーション        | 49,100  | 595.00   | 29,214,500  | 貸付有価証券<br>3,800株          |
| エス・エム・エス             | 64,900  | 3,340.00 | 216,766,000 |                           |
| サニーサイドアップグループ        | 4,500   | 562.00   | 2,529,000   | 貸付有価証券<br>300株（300株）      |
| パーソルホールディングス         | 191,000 | 2,772.00 | 529,452,000 |                           |
| リニカル                 | 8,600   | 710.00   | 6,106,000   |                           |
| クックパッド               | 46,700  | 221.00   | 10,320,700  | 貸付有価証券<br>21,900株（2,300株） |
| エスクリ                 | 6,200   | 366.00   | 2,269,200   | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス     | 7,400   | 640.00   | 4,736,000   | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| 学情                   | 7,700   | 1,389.00 | 10,695,300  | 貸付有価証券<br>2,700株          |
| スタジオアリス              | 8,500   | 2,110.00 | 17,935,000  | 貸付有価証券<br>4,100株          |
| シミックホールディングス         | 9,400   | 1,771.00 | 16,647,400  |                           |
| エプコ                  | 3,200   | 713.00   | 2,281,600   | 貸付有価証券<br>1,300株（300株）    |
| N J S                | 3,700   | 2,191.00 | 8,106,700   |                           |
| 総合警備保障               | 63,300  | 3,530.00 | 223,449,000 |                           |

|                  |         |          |               |                          |
|------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| カカクコム            | 127,400 | 1,954.00 | 248,939,600   | 貸付有価証券<br>3,400株         |
| セントケア・ホールディング    | 10,900  | 783.00   | 8,534,700     |                          |
| サイネックス           | 2,600   | 555.00   | 1,443,000     |                          |
| ルネサンス            | 11,900  | 894.00   | 10,638,600    | 貸付有価証券<br>5,600株（600株）   |
| ディップ             | 29,900  | 3,720.00 | 111,228,000   |                          |
| デジタルホールディングス     | 13,300  | 1,190.00 | 15,827,000    |                          |
| 新日本科学            | 18,100  | 2,658.00 | 48,109,800    | 貸付有価証券<br>5,300株         |
| キャリアデザインセンター     | 3,200   | 1,957.00 | 6,262,400     | 貸付有価証券<br>300株           |
| ベネフィット・ワン        | 79,100  | 2,129.00 | 168,403,900   |                          |
| エムスリー            | 337,200 | 3,348.00 | 1,128,945,600 |                          |
| ツカダ・グローバルホールディング | 9,700   | 399.00   | 3,870,300     | 貸付有価証券<br>800株           |
| プラス              | 2,000   | 1,175.00 | 2,350,000     |                          |
| アウトソーシング         | 101,600 | 1,225.00 | 124,460,000   |                          |
| ウェルネット           | 11,600  | 679.00   | 7,876,400     | 貸付有価証券<br>4,600株（3,600株） |
| ワールドホールディングス     | 7,700   | 2,676.00 | 20,605,200    |                          |
| ディー・エヌ・エー        | 72,700  | 1,786.00 | 129,842,200   |                          |
| 博報堂D Yホールディングス   | 217,600 | 1,495.00 | 325,312,000   |                          |
| ぐるなび             | 31,400  | 367.00   | 11,523,800    | 貸付有価証券<br>100株           |
| タカミヤ             | 23,100  | 416.00   | 9,609,600     | 貸付有価証券<br>100株           |
| ジャパンベストレスキューシステム | 10,600  | 784.00   | 8,310,400     |                          |
| ファンコミュニケーションズ    | 33,400  | 411.00   | 13,727,400    | 貸付有価証券<br>100株           |
| ライク              | 6,400   | 1,912.00 | 12,236,800    |                          |
| ビジネス・ブレークスルー     | 5,700   | 373.00   | 2,126,100     | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| エスプール            | 49,000  | 679.00   | 33,271,000    |                          |
| W D Bホールディングス    | 8,700   | 2,012.00 | 17,504,400    |                          |
| ティア              | 8,900   | 425.00   | 3,782,500     |                          |

|                          |         |           |               |                        |
|--------------------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| C D G                    | 1,600   | 1,162.00  | 1,859,200     |                        |
| アドウェイズ                   | 23,500  | 647.00    | 15,204,500    | 貸付有価証券<br>600株         |
| バリューコマース                 | 12,800  | 1,764.00  | 22,579,200    |                        |
| インフォマート                  | 177,100 | 326.00    | 57,734,600    | 貸付有価証券<br>2,000株       |
| J Pホールディングス              | 49,100  | 333.00    | 16,350,300    | 貸付有価証券<br>100株         |
| C Lホールディングス              | 4,700   | 797.00    | 3,745,900     | 貸付有価証券<br>2,200株       |
| プレステージ・インター<br>ナショナル     | 71,800  | 682.00    | 48,967,600    |                        |
| アミューズ                    | 9,200   | 1,749.00  | 16,090,800    |                        |
| ドリームインキュベータ              | 5,200   | 2,772.00  | 14,414,400    | 貸付有価証券<br>200株（100株）   |
| クイック                     | 13,000  | 1,840.00  | 23,920,000    |                        |
| T A C                    | 7,400   | 203.00    | 1,502,200     | 貸付有価証券<br>300株         |
| 電通グループ                   | 167,700 | 4,320.00  | 724,464,000   | 貸付有価証券<br>3,300株       |
| テイクアンドグヴィ・ニー<br>ズ        | 5,200   | 1,462.00  | 7,602,400     | 貸付有価証券<br>1,000株（200株） |
| ぴあ                       | 5,700   | 3,125.00  | 17,812,500    | 貸付有価証券<br>2,600株       |
| イオンファンタジー                | 7,400   | 2,900.00  | 21,460,000    | 貸付有価証券<br>3,400株（400株） |
| シーティーエス                  | 18,900  | 785.00    | 14,836,500    |                        |
| ネクシィーズグループ               | 4,700   | 659.00    | 3,097,300     | 貸付有価証券<br>200株（200株）   |
| H . U . グループホール<br>ディングス | 49,900  | 2,664.00  | 132,933,600   |                        |
| アルプス技研                   | 14,800  | 2,316.00  | 34,276,800    |                        |
| 日本空調サービス                 | 18,300  | 713.00    | 13,047,900    |                        |
| オリエンタルランド                | 180,600 | 21,590.00 | 3,899,154,000 |                        |
| ダスキン                     | 38,000  | 3,080.00  | 117,040,000   |                        |
| 明光ネットワークジャパ<br>ン         | 22,400  | 617.00    | 13,820,800    |                        |
| ファルコホールディング<br>ス         | 7,700   | 1,952.00  | 15,030,400    |                        |
| 秀英予備校                    | 3,300   | 425.00    | 1,402,500     | 貸付有価証券<br>1,500株       |

|                    |         |          |             |                          |
|--------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| ラウンドワン             | 142,700 | 477.00   | 68,067,900  | 貸付有価証券<br>200株           |
| リゾートトラスト           | 67,400  | 2,125.00 | 143,225,000 |                          |
| ビー・エム・エル           | 21,200  | 3,150.00 | 66,780,000  |                          |
| りらいあコミュニケーションズ     | 28,200  | 1,453.00 | 40,974,600  |                          |
| リソー教育              | 77,600  | 346.00   | 26,849,600  |                          |
| 早稲田アカデミー           | 9,400   | 1,207.00 | 11,345,800  | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| ユー・エス・エス           | 175,500 | 2,205.00 | 386,977,500 |                          |
| 東京個別指導学院           | 20,200  | 531.00   | 10,726,200  | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株） |
| サイバーエージェント         | 408,300 | 1,210.00 | 494,043,000 | 貸付有価証券<br>600株           |
| 楽天グループ             | 789,800 | 679.00   | 536,274,200 | 貸付有価証券<br>361,100株       |
| クリーク・アンド・リバー社      | 10,000  | 2,271.00 | 22,710,000  | 貸付有価証券<br>1,000株（900株）   |
| モーニングスター           | 27,800  | 484.00   | 13,455,200  | 貸付有価証券<br>2,300株（1,400株） |
| テー・オー・ダブリュー        | 33,400  | 306.00   | 10,220,400  | 貸付有価証券<br>100株           |
| 山田コンサルティンググループ     | 8,600   | 1,511.00 | 12,994,600  |                          |
| セントラルスポーツ          | 6,400   | 2,458.00 | 15,731,200  | 貸付有価証券<br>3,000株         |
| フルキャストホールディングス     | 16,300  | 2,510.00 | 40,913,000  |                          |
| エン・ジャパン            | 30,900  | 2,421.00 | 74,808,900  |                          |
| リソルホールディングス        | 1,400   | 4,895.00 | 6,853,000   | 貸付有価証券<br>800株（200株）     |
| テクノプロ・ホールディングス     | 100,900 | 3,490.00 | 352,141,000 | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| アトラグループ            | 3,400   | 184.00   | 625,600     | 貸付有価証券<br>400株           |
| インターワークス           | 3,900   | 376.00   | 1,466,400   |                          |
| アイ・オールジャパンホールディングス | 8,900   | 1,990.00 | 17,711,000  | 貸付有価証券<br>4,100株（2,000株） |
| K e e P e r 技研     | 10,500  | 3,505.00 | 36,802,500  | 貸付有価証券<br>200株           |
| ファーストロジック          | 2,400   | 884.00   | 2,121,600   |                          |

|                       |           |          |               |                          |
|-----------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| 三機サービス                | 2,300     | 905.00   | 2,081,500     |                          |
| G u n o s y           | 13,500    | 637.00   | 8,599,500     | 貸付有価証券<br>4,900株         |
| デザインワン・ジャパン           | 4,500     | 191.00   | 859,500       | 貸付有価証券<br>900株（800株）     |
| イー・ガーディアン             | 6,500     | 2,360.00 | 15,340,000    | 貸付有価証券<br>600株           |
| リブセンス                 | 7,000     | 263.00   | 1,841,000     | 貸付有価証券<br>800株           |
| ジャパンマテリアル             | 52,200    | 2,355.00 | 122,931,000   |                          |
| ベクトル                  | 26,800    | 1,331.00 | 35,670,800    |                          |
| ウチヤマホールディングス          | 6,400     | 268.00   | 1,715,200     | 貸付有価証券<br>2,700株（200株）   |
| チャーム・ケア・コーポレーション      | 14,200    | 1,070.00 | 15,194,000    | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| キャリアリンク               | 6,300     | 2,513.00 | 15,831,900    |                          |
| I B J                 | 10,400    | 861.00   | 8,954,400     | 貸付有価証券<br>1,000株（900株）   |
| アサンテ                  | 8,400     | 1,633.00 | 13,717,200    |                          |
| バリューHR                | 14,900    | 1,733.00 | 25,821,700    | 貸付有価証券<br>5,400株         |
| M & A キャピタルパートナーズ     | 15,800    | 4,390.00 | 69,362,000    | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| ライドオンエクスプレスホールディングス   | 6,100     | 1,089.00 | 6,642,900     | 貸付有価証券<br>900株（900株）     |
| E R I ホールディングス        | 3,900     | 1,500.00 | 5,850,000     |                          |
| アビスト                  | 2,400     | 2,970.00 | 7,128,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| シグマクシス・ホールディングス       | 25,900    | 1,117.00 | 28,930,300    |                          |
| ウィルグループ               | 14,200    | 1,126.00 | 15,989,200    |                          |
| エスクロー・エージェン<br>ト・ジャパン | 16,000    | 152.00   | 2,432,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| メドピア                  | 13,400    | 1,370.00 | 18,358,000    | 貸付有価証券<br>5,700株（3,500株） |
| レアジョブ                 | 2,900     | 1,026.00 | 2,975,400     | 貸付有価証券<br>500株           |
| リクルートホールディングス         | 1,263,300 | 3,841.00 | 4,852,335,300 | 貸付有価証券<br>8,400株         |
| エラン                   | 22,600    | 1,066.00 | 24,091,600    | 貸付有価証券<br>200株           |

|                       |           |          |               |                          |
|-----------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| 土木管理総合試験所             | 6,400     | 306.00   | 1,958,400     |                          |
| 日本郵政                  | 2,236,300 | 1,197.00 | 2,676,851,100 | 貸付有価証券<br>600株           |
| ベルシステム24ホールディングス      | 22,900    | 1,477.00 | 33,823,300    |                          |
| 鎌倉新書                  | 19,400    | 1,105.00 | 21,437,000    | 貸付有価証券<br>5,700株（5,700株） |
| S M N                 | 3,600     | 458.00   | 1,648,800     | 貸付有価証券<br>1,800株（1,800株） |
| 一蔵                    | 1,900     | 488.00   | 927,200       |                          |
| グローバルキッズCOMPANY       | 2,300     | 788.00   | 1,812,400     | 貸付有価証券<br>1,200株（1,200株） |
| エアトリ                  | 11,000    | 2,515.00 | 27,665,000    | 貸付有価証券<br>3,900株（3,900株） |
| アトラエ                  | 13,400    | 1,033.00 | 13,842,200    | 貸付有価証券<br>100株           |
| ストライク                 | 8,400     | 4,010.00 | 33,684,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（800株）   |
| ソラスト                  | 47,000    | 682.00   | 32,054,000    |                          |
| セラク                   | 6,100     | 1,458.00 | 8,893,800     | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| インソース                 | 42,300    | 1,362.00 | 57,612,600    | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株） |
| ベイカレント・コンサルティング       | 135,100   | 5,550.00 | 749,805,000   | 貸付有価証券<br>400株           |
| Orchestra Holdings    | 3,700     | 1,891.00 | 6,996,700     | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| アイモバイル                | 8,900     | 1,230.00 | 10,947,000    |                          |
| キャリアインデックス            | 5,200     | 321.00   | 1,669,200     |                          |
| MS - Japan            | 5,000     | 1,115.00 | 5,575,000     | 貸付有価証券<br>600株           |
| 船場                    | 2,600     | 745.00   | 1,937,000     | 貸付有価証券<br>200株           |
| ジャパンエレベーターサービスホールディング | 60,800    | 2,010.00 | 122,208,000   | 貸付有価証券<br>300株           |
| フルテック                 | 2,100     | 1,084.00 | 2,276,400     |                          |
| グリーンズ                 | 5,100     | 1,281.00 | 6,533,100     | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| ツナググループ・ホールディングス      | 4,200     | 590.00   | 2,478,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| GameWith              | 4,600     | 322.00   | 1,481,200     | 貸付有価証券                   |

|                                    |        |          |            |                          |
|------------------------------------|--------|----------|------------|--------------------------|
|                                    |        |          |            | 2,300株（400株）             |
| M S & C o n s u l t i<br>n g       | 1,800  | 554.00   | 997,200    |                          |
| ウェルビー                              | 12,500 | 640.00   | 8,000,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| エル・ティー・エス                          | 2,200  | 2,373.00 | 5,220,600  |                          |
| ミダックホールディング<br>ス                   | 10,300 | 2,809.00 | 28,932,700 | 貸付有価証券<br>1,800株         |
| 日総工産                               | 12,800 | 642.00   | 8,217,600  | 貸付有価証券<br>6,000株         |
| キュービーネットホール<br>ディングス               | 8,100  | 1,423.00 | 11,526,300 |                          |
| R P Aホールディングス                      | 23,100 | 331.00   | 7,646,100  | 貸付有価証券<br>4,400株（4,400株） |
| スブリックス                             | 5,300  | 856.00   | 4,536,800  | 貸付有価証券<br>800株（700株）     |
| マネジメントソリュー<br>ションズ                 | 9,400  | 3,625.00 | 34,075,000 | 貸付有価証券<br>4,200株（3,700株） |
| プロレド・パートナーズ                        | 4,200  | 533.00   | 2,238,600  | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| a n d f a c t o r y                | 4,400  | 357.00   | 1,570,800  | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| テノ．ホールディングス                        | 1,900  | 998.00   | 1,896,200  | 貸付有価証券<br>900株（800株）     |
| フロンティア・マネジメ<br>ント                  | 5,700  | 1,289.00 | 7,347,300  |                          |
| ピアラ                                | 2,500  | 497.00   | 1,242,500  | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| コプロ・ホールディング<br>ス                   | 2,500  | 1,190.00 | 2,975,000  |                          |
| ギークス                               | 2,100  | 1,096.00 | 2,301,600  | 貸付有価証券<br>600株           |
| カーブスホールディング<br>ス                   | 52,400 | 783.00   | 41,029,200 | 貸付有価証券<br>3,000株         |
| フォーラムエンジニアリ<br>ング                  | 9,900  | 880.00   | 8,712,000  |                          |
| F a s t F i t n e s<br>s J a p a n | 5,800  | 1,305.00 | 7,569,000  | 貸付有価証券<br>500株（500株）     |
| ダイレクトマーケティング<br>グミックス              | 20,400 | 1,633.00 | 33,313,200 | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| ポピンズ                               | 2,500  | 1,729.00 | 4,322,500  |                          |
| L I T A L I C O                    | 13,300 | 2,569.00 | 34,167,700 | 貸付有価証券                   |

|                      |        |          |             |                           |
|----------------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
|                      |        |          |             | 1,000株                    |
| アドバンテッジリスクマ<br>ネジメント | 6,900  | 470.00   | 3,243,000   | 貸付有価証券<br>600株            |
| リログループ               | 95,000 | 2,152.00 | 204,440,000 | 貸付有価証券<br>800株            |
| 東祥                   | 11,900 | 1,165.00 | 13,863,500  | 貸付有価証券<br>5,100株（400株）    |
| ピーウィズ                | 3,200  | 1,488.00 | 4,761,600   |                           |
| T R E ホールディングス       | 35,900 | 1,487.00 | 53,383,300  |                           |
| 人・夢・技術グループ           | 7,600  | 1,540.00 | 11,704,000  |                           |
| 大栄環境                 | 32,600 | 1,702.00 | 55,485,200  | 貸付有価証券<br>7,900株（7,900株）  |
| エイチ・アイ・エス            | 44,600 | 2,081.00 | 92,812,600  | 貸付有価証券<br>6,800株（500株）    |
| ラックランド               | 5,300  | 2,895.00 | 15,343,500  | 貸付有価証券<br>2,400株（1,800株）  |
| 共立メンテナンス             | 29,200 | 5,240.00 | 153,008,000 | 貸付有価証券<br>13,300株（9,000株） |
| イチネンホールディング<br>ス     | 18,100 | 1,269.00 | 22,968,900  |                           |
| 建設技術研究所              | 8,800  | 3,415.00 | 30,052,000  |                           |
| スペース                 | 12,400 | 881.00   | 10,924,400  |                           |
| 燦ホールディングス            | 7,600  | 2,078.00 | 15,792,800  | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| スバル興業                | 900    | 9,170.00 | 8,253,000   |                           |
| 東京テアトル               | 5,600  | 1,124.00 | 6,294,400   | 貸付有価証券<br>1,300株（100株）    |
| タナベコンサルティング<br>グループ  | 5,900  | 880.00   | 5,192,000   |                           |
| ナガワ                  | 4,600  | 7,610.00 | 35,006,000  | 貸付有価証券<br>2,100株（200株）    |
| 東京都競馬                | 14,300 | 3,700.00 | 52,910,000  |                           |
| 常磐興産                 | 5,200  | 1,237.00 | 6,432,400   | 貸付有価証券<br>2,700株          |
| カナモト                 | 31,300 | 2,240.00 | 70,112,000  |                           |
| 西尾レントオール             | 15,900 | 3,065.00 | 48,733,500  |                           |
| トランス・コスモス            | 21,200 | 3,365.00 | 71,338,000  |                           |
| 乃村工藝社                | 74,400 | 898.00   | 66,811,200  | 貸付有価証券<br>400株            |
| 藤田観光                 | 7,600  | 3,335.00 | 25,346,000  | 貸付有価証券<br>200株（200株）      |

|    |                  |         |          |                 |                        |
|----|------------------|---------|----------|-----------------|------------------------|
|    | KNT - CTホールディングス | 10,200  | 1,737.00 | 17,717,400      | 貸付有価証券<br>1,400株（200株） |
|    | 日本管財             | 17,900  | 2,536.00 | 45,394,400      |                        |
|    | トーカイ             | 15,100  | 1,907.00 | 28,795,700      |                        |
|    | 白洋舎              | 1,500   | 1,569.00 | 2,353,500       | 貸付有価証券<br>700株         |
|    | セコム              | 173,800 | 7,772.00 | 1,350,773,600   |                        |
|    | セントラル警備保障        | 9,200   | 2,474.00 | 22,760,800      | 貸付有価証券<br>4,300株（300株） |
|    | 丹青社              | 33,100  | 707.00   | 23,401,700      |                        |
|    | メイテック            | 68,000  | 2,407.00 | 163,676,000     |                        |
|    | 応用地質             | 15,900  | 1,992.00 | 31,672,800      |                        |
|    | 船井総研ホールディングス     | 35,800  | 2,737.00 | 97,984,600      |                        |
|    | 進学会ホールディングス      | 5,000   | 300.00   | 1,500,000       | 貸付有価証券<br>2,300株（400株） |
|    | オオバ              | 9,600   | 707.00   | 6,787,200       | 貸付有価証券<br>4,900株（200株） |
|    | いであ              | 3,400   | 1,540.00 | 5,236,000       | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
|    | 学究社              | 6,800   | 1,972.00 | 13,409,600      | 貸付有価証券<br>400株（400株）   |
|    | ベネッセホールディングス     | 63,700  | 1,959.00 | 124,788,300     |                        |
|    | イオンディライト         | 18,900  | 3,005.00 | 56,794,500      | 貸付有価証券<br>8,500株（200株） |
|    | ナック              | 7,500   | 970.00   | 7,275,000       | 貸付有価証券<br>2,900株       |
|    | ダイセキ             | 34,800  | 4,035.00 | 140,418,000     |                        |
|    | ステップ             | 7,000   | 1,770.00 | 12,390,000      | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| 小計 | 銘柄数：2,145        |         |          | 475,198,390,320 |                        |
|    | 組入時価比率：98.8%     |         |          | 100.0%          |                        |
| 合計 |                  |         |          | 475,198,390,320 |                        |

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

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

(2)株式以外の有価証券(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類       | 2023年 2月17日現在 |       |               |             |
|----------|---------------|-------|---------------|-------------|
|          | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|          |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引     |               |       |               |             |
| 株価指数先物取引 |               |       |               |             |
| 買建       | 5,729,137,379 | -     | 5,866,075,000 | 136,791,596 |
| 合計       | 5,729,137,379 | -     | 5,866,075,000 | 136,791,596 |

（注）時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

(2023年 2月17日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産の部            |                |
| 流動資産            |                |
| コール・ローン         | 53,915,877     |
| 国債証券            | 20,979,287,140 |
| 未収利息            | 56,674,059     |
| 前払費用            | 3,346,696      |
| 流動資産合計          | 21,093,223,772 |
| 資産合計            | 21,093,223,772 |
| 負債の部            |                |
| 流動負債            |                |
| 未払解約金           | 4,700,812      |
| 未払利息            | 12             |
| 流動負債合計          | 4,700,824      |
| 負債合計            | 4,700,824      |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 16,345,565,387 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 4,742,957,561  |
| 元本等合計           | 21,088,522,948 |
| 純資産合計           | 21,088,522,948 |
| 負債純資産合計         | 21,093,223,772 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                                  |
|-----------------------|------------------------------------------------------------------|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法     | 国債証券<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 |
| 2.費用・収益の計上基準          | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。     |
| 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

## （貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.2902円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (12,902円) |

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 2023年 2月17日現在                                                                                                                                                                                                                                           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1．貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ<br/>ん。</p> <p>2．時価の算定方法</p> <p>国債証券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており<br/>ます。</p> |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年 2月17日現在                      |                 |
|------------------------------------|-----------------|
| 期首                                 | 2022年 2月18日     |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額   | 16,378,722,981円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 6,006,345,227円  |
| 同期中における一部解約元本額                     | 6,039,502,821円  |
| 期末元本額                              | 16,345,565,387円 |
| 期末元本額の内訳＊                          |                 |
| バランスセレクト30                         | 573,670,448円    |
| バランスセレクト50                         | 640,273,060円    |
| バランスセレクト70                         | 322,315,867円    |
| ネクストコア                             | 189,195,513円    |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）   | 252,453,714円    |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用） | 975,567,655円    |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け）               | 26,195,682円     |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け）               | 62,542,450円     |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け）               | 24,029,349円     |
| 野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）         | 4,939,241,416円  |
| 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）          | 187,314,412円    |
| 野村DC運用戦略ファンド                       | 6,942,571,277円  |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）                 | 1,210,194,544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(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2023年2月17日現在)

（単位：円）

| 種類   | 通貨  | 銘柄                | 券面総額        | 評価額         | 備考 |
|------|-----|-------------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券 | 日本円 | 国庫債券 利付（２年）第４３５回  | 90,000,000  | 90,099,900  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（２年）第４３６回  | 280,000,000 | 280,316,400 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（２年）第４３８回  | 400,000,000 | 400,488,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４０回  | 370,000,000 | 370,910,200 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４１回  | 340,000,000 | 340,938,400 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４２回  | 190,000,000 | 190,573,800 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４３回  | 100,000,000 | 100,311,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４４回  | 10,000,000  | 10,032,600  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４５回  | 270,000,000 | 270,904,500 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４６回  | 150,000,000 | 150,487,500 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４７回  | 70,000,000  | 70,010,500  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４８回  | 160,000,000 | 159,920,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１４９回  | 180,000,000 | 179,710,200 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１５０回  | 160,000,000 | 159,540,800 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１５１回  | 90,000,000  | 89,597,700  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１５２回  | 270,000,000 | 269,835,300 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１５３回  | 290,000,000 | 288,251,300 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（５年）第１５４回  | 80,000,000  | 79,727,200  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第１回   | 60,000,000  | 71,869,800  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第２回   | 70,000,000  | 80,929,100  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第３回   | 50,000,000  | 57,910,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第４回   | 80,000,000  | 92,804,800  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第５回   | 60,000,000  | 67,300,200  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第６回   | 80,000,000  | 87,723,200  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第７回   | 80,000,000  | 83,924,800  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第８回   | 80,000,000  | 77,929,600  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第９回   | 50,000,000  | 35,709,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第１０回  | 70,000,000  | 58,869,300  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第１１回  | 50,000,000  | 40,512,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第１２回  | 40,000,000  | 28,910,400  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第１３回  | 60,000,000  | 43,231,800  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第１４回  | 90,000,000  | 69,276,600  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（４０年）第１５回  | 110,000,000 | 92,137,100  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（１０年）第３３４回 | 370,000,000 | 373,370,700 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（１０年）第３３５回 | 200,000,000 | 201,820,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（１０年）第３３６回 | 120,000,000 | 121,242,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（１０年）第３３７回 | 100,000,000 | 100,668,000 |    |

|                   |             |             |  |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（１０年）第３３８回 | 130,000,000 | 131,215,500 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３９回 | 100,000,000 | 101,025,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４０回 | 60,000,000  | 60,666,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４１回 | 200,000,000 | 201,782,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４２回 | 230,000,000 | 230,706,100 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４３回 | 200,000,000 | 200,532,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４４回 | 210,000,000 | 210,373,800 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４５回 | 240,000,000 | 240,182,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４６回 | 270,000,000 | 269,835,300 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４７回 | 220,000,000 | 219,573,200 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４８回 | 160,000,000 | 159,454,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４９回 | 180,000,000 | 179,181,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５０回 | 220,000,000 | 218,563,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５１回 | 180,000,000 | 178,486,200 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５２回 | 170,000,000 | 168,271,100 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５３回 | 30,000,000  | 29,639,100  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５４回 | 20,000,000  | 19,720,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５５回 | 100,000,000 | 98,391,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５６回 | 80,000,000  | 78,561,600  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５７回 | 230,000,000 | 225,411,500 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５８回 | 160,000,000 | 156,534,400 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５９回 | 200,000,000 | 195,032,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６０回 | 220,000,000 | 213,804,800 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６１回 | 220,000,000 | 213,048,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６２回 | 200,000,000 | 193,188,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６３回 | 200,000,000 | 192,832,000 |  |
|                   | 160,000,000 | 154,036,800 |  |

|                   |             |             |  |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（１０年）第３６４回 |             |             |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６５回 | 140,000,000 | 134,694,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６６回 | 50,000,000  | 48,550,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６９回 | 60,000,000  | 60,000,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１回   | 30,000,000  | 34,716,600  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３回   | 40,000,000  | 45,318,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４回   | 30,000,000  | 35,463,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第６回   | 20,000,000  | 23,155,800  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第８回   | 20,000,000  | 22,190,800  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第９回   | 20,000,000  | 21,425,400  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１０回  | 30,000,000  | 31,247,100  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１１回  | 40,000,000  | 43,980,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１２回  | 30,000,000  | 34,188,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１３回  | 60,000,000  | 67,783,800  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１４回  | 120,000,000 | 140,680,800 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１５回  | 100,000,000 | 118,458,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１６回  | 70,000,000  | 83,008,100  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１７回  | 70,000,000  | 82,281,500  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１８回  | 60,000,000  | 69,872,400  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１９回  | 70,000,000  | 81,599,700  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２０回  | 60,000,000  | 71,373,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２１回  | 40,000,000  | 46,682,400  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２２回  | 30,000,000  | 35,762,100  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２３回  | 40,000,000  | 47,730,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２４回  | 20,000,000  | 23,886,800  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２５回  | 50,000,000  | 58,465,500  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２６回  | 60,000,000  | 70,933,800  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２７回  | 70,000,000  | 83,734,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２８回  | 100,000,000 | 119,652,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２９回  | 110,000,000 | 130,232,300 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３０回  | 100,000,000 | 116,872,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３１回  | 120,000,000 | 138,510,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３２回  | 120,000,000 | 140,298,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３３回  | 140,000,000 | 156,942,800 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３４回  | 130,000,000 | 149,754,800 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３５回  | 130,000,000 | 145,468,700 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３６回  | 110,000,000 | 123,181,300 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３７回  | 100,000,000 | 110,224,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３８回  | 60,000,000  | 65,035,200  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３９回  | 80,000,000  | 88,072,000  |  |
|                   |             |             |  |

|      |             |            |            |
|------|-------------|------------|------------|
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４０回 | 50,000,000 | 54,147,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４１回 | 70,000,000 | 74,528,300 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４２回 | 50,000,000 | 53,176,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４３回 | 60,000,000 | 63,794,400 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４４回 | 70,000,000 | 74,342,800 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４５回 | 60,000,000 | 61,413,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４６回 | 90,000,000 | 92,061,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４７回 | 60,000,000 | 62,466,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４８回 | 60,000,000 | 60,102,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第４９回 | 70,000,000 | 70,060,200 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５０回 | 60,000,000 | 52,935,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５１回 | 30,000,000 | 23,434,200 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５２回 | 60,000,000 | 49,077,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５３回 | 30,000,000 | 25,062,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５４回 | 50,000,000 | 43,654,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５５回 | 60,000,000 | 52,234,200 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５６回 | 70,000,000 | 60,763,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５７回 | 50,000,000 | 43,276,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５８回 | 90,000,000 | 77,670,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第５９回 | 50,000,000 | 42,002,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６０回 | 80,000,000 | 70,409,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６１回 | 40,000,000 | 33,389,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６２回 | 30,000,000 | 23,688,300 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６３回 | 40,000,000 | 30,597,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６４回 | 30,000,000 | 22,880,700 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６５回 | 20,000,000 | 15,223,200 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６６回 | 20,000,000 | 15,165,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６７回 | 80,000,000 | 63,936,800 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６８回 | 70,000,000 | 55,855,800 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第６９回 | 60,000,000 | 49,175,400 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第７０回 | 70,000,000 | 57,239,700 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第７１回 | 60,000,000 | 48,996,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第７２回 | 50,000,000 | 40,933,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第７３回 | 50,000,000 | 40,879,500 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第７４回 | 70,000,000 | 62,034,000 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第７５回 | 70,000,000 | 66,943,800 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第７６回 | 60,000,000 | 58,770,600 |
| 国庫債券 | 利付（３０年）第７７回 | 30,000,000 | 30,713,100 |
| 国庫債券 | 利付（２０年）第７１回 | 10,000,000 | 10,303,900 |
| 国庫債券 | 利付（２０年）第７２回 | 20,000,000 | 20,688,400 |
| 国庫債券 | 利付（２０年）第７３回 | 10,000,000 | 10,378,300 |
| 国庫債券 | 利付（２０年）第７４回 | 10,000,000 | 10,396,600 |
| 国庫債券 | 利付（２０年）第７５回 | 40,000,000 | 41,787,600 |

|                   |             |             |  |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（２０年）第７６回  | 37,000,000  | 38,499,610  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７７回  | 35,000,000  | 36,491,350  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７８回  | 10,000,000  | 10,452,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第７９回  | 10,000,000  | 10,475,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８０回  | 10,000,000  | 10,498,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８１回  | 10,000,000  | 10,524,300  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８２回  | 15,000,000  | 15,825,150  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８３回  | 15,000,000  | 15,898,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８４回  | 50,000,000  | 52,852,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８５回  | 13,000,000  | 13,839,930  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８６回  | 10,000,000  | 10,707,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第８８回  | 20,000,000  | 21,516,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９０回  | 20,000,000  | 21,537,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９１回  | 10,000,000  | 10,804,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９２回  | 30,000,000  | 32,313,900  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９３回  | 70,000,000  | 75,369,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９４回  | 70,000,000  | 75,653,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９５回  | 90,000,000  | 98,363,700  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９６回  | 85,000,000  | 92,168,050  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９７回  | 50,000,000  | 54,613,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９８回  | 60,000,000  | 65,263,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第９９回  | 110,000,000 | 120,055,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１００回 | 70,000,000  | 76,958,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０１回 | 70,000,000  | 77,660,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０２回 | 60,000,000  | 66,783,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０３回 | 35,000,000  | 38,773,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０４回 | 10,000,000  | 10,972,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０５回 | 60,000,000  | 66,036,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０６回 | 70,000,000  | 77,427,700  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０７回 | 50,000,000  | 55,172,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０８回 | 50,000,000  | 54,599,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０９回 | 60,000,000  | 65,650,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１０回 | 40,000,000  | 44,244,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１１回 | 10,000,000  | 11,152,300  |  |
|                   | 85,000,000  | 94,267,550  |  |

|                   |             |             |  |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（２０年）第１１２回 |             |             |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１３回 | 60,000,000  | 66,711,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１４回 | 80,000,000  | 89,189,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１５回 | 70,000,000  | 78,507,100  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１６回 | 70,000,000  | 78,724,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１７回 | 70,000,000  | 78,243,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１８回 | 40,000,000  | 44,477,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１９回 | 130,000,000 | 142,652,900 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２０回 | 70,000,000  | 75,818,400  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２１回 | 70,000,000  | 77,383,600  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２２回 | 40,000,000  | 43,926,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２３回 | 70,000,000  | 78,528,100  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２４回 | 30,000,000  | 33,428,400  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２５回 | 40,000,000  | 45,278,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２６回 | 20,000,000  | 22,320,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２７回 | 30,000,000  | 33,247,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２８回 | 80,000,000  | 88,848,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２９回 | 10,000,000  | 11,026,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３０回 | 50,000,000  | 55,234,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３３回 | 50,000,000  | 55,333,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４０回 | 70,000,000  | 77,045,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４１回 | 80,000,000  | 88,004,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４３回 | 70,000,000  | 76,288,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４４回 | 50,000,000  | 54,019,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４５回 | 120,000,000 | 131,940,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４６回 | 160,000,000 | 175,848,000 |  |
|                   | 160,000,000 | 174,145,600 |  |

|                   |             |             |  |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（２０年）第１４７回 |             |             |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４８回 | 170,000,000 | 183,132,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４９回 | 150,000,000 | 161,493,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５０回 | 170,000,000 | 181,002,400 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５１回 | 160,000,000 | 166,465,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５２回 | 130,000,000 | 135,057,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５３回 | 130,000,000 | 136,375,200 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５４回 | 110,000,000 | 113,921,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５５回 | 110,000,000 | 111,136,300 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５６回 | 30,000,000  | 28,031,700  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５７回 | 30,000,000  | 27,177,300  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５８回 | 50,000,000  | 47,010,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５９回 | 30,000,000  | 28,507,200  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６０回 | 30,000,000  | 28,800,300  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６１回 | 30,000,000  | 28,318,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６２回 | 40,000,000  | 37,604,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６３回 | 50,000,000  | 46,842,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６４回 | 60,000,000  | 55,165,800  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６５回 | 50,000,000  | 45,794,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６６回 | 50,000,000  | 47,058,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６７回 | 50,000,000  | 45,464,500  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６８回 | 50,000,000  | 44,549,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６９回 | 50,000,000  | 43,647,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７０回 | 50,000,000  | 43,446,000  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７１回 | 60,000,000  | 51,893,400  |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７２回 | 50,000,000  | 43,834,000  |  |
|                   | 50,000,000  | 43,635,500  |  |

|    |                   |                |                |  |
|----|-------------------|----------------|----------------|--|
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７３回 |                |                |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７４回 | 70,000,000     | 60,810,400     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７５回 | 70,000,000     | 61,670,700     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７６回 | 80,000,000     | 70,220,800     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７７回 | 80,000,000     | 68,681,600     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７８回 | 60,000,000     | 52,307,400     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１７９回 | 40,000,000     | 34,764,800     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１８０回 | 50,000,000     | 45,863,000     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１８１回 | 60,000,000     | 55,946,400     |  |
|    | 国庫債券 利付（２０年）第１８２回 | 50,000,000     | 48,213,000     |  |
| 小計 | 銘柄数：242           | 20,640,000,000 | 20,979,287,140 |  |
|    | 組入時価比率：99.5%      |                | 100.0%         |  |
| 合計 |                   |                | 20,979,287,140 |  |

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

## 第２ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

(2023年 2月17日現在)

|          |                   |
|----------|-------------------|
| 資産の部     |                   |
| 流動資産     |                   |
| 預金       | 11,344,911,225    |
| コール・ローン  | 1,638,972,798     |
| 株式       | 1,434,721,717,399 |
| 投資証券     | 33,874,364,391    |
| 派生商品評価勘定 | 256,506,162       |
| 未収入金     | 6,897,040         |
| 未収配当金    | 1,418,829,443     |
| 差入委託証拠金  | 5,728,056,474     |
| 流動資産合計   | 1,488,990,254,932 |
| 資産合計     | 1,488,990,254,932 |
| 負債の部     |                   |
| 流動負債     |                   |
| 派生商品評価勘定 | 58,042,971        |
| 未払解約金    | 270,235,873       |
| 未払利息     | 392               |
| その他未払費用  | 2,145,500         |
| 流動負債合計   | 330,424,736       |

(2023年 2月17日現在)

|                 |                   |
|-----------------|-------------------|
| 負債合計            | 330,424,736       |
| 純資産の部           |                   |
| 元本等             |                   |
| 元本              | 312,015,803,140   |
| 剰余金             |                   |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 1,176,644,027,056 |
| 元本等合計           | 1,488,659,830,196 |
| 純資産合計           | 1,488,659,830,196 |
| 負債純資産合計         | 1,488,990,254,932 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法     | 株式<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。<br>投資証券<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、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。<br>先物取引<br>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。<br>為替予約取引<br>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<br>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。<br>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。<br>有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>派生商品取引等損益<br>約定日基準で計上しております。<br>為替差損益<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。                                                                                                                                             |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 4,771円    |
| (10,000口当たり純資産額)           | (47,711円) |

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>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。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 2023年 2月17日現在                                                                                             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> |

## 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

| 2023年 2月17日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2022年 2月18日      |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 272,160,916,525円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 62,687,239,414円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 22,832,352,799円  |
| 期末元本額                            | 312,015,803,140円 |
| 期末元本額の内訳＊                        |                  |
| バランスセレクト３０                       | 28,578,517円      |
| バランスセレクト５０                       | 89,462,327円      |
| バランスセレクト７０                       | 110,810,252円     |
| 野村外国株式インデックスファンド                 | 498,791,216円     |
| 野村世界６資産分散投信（安定コース）               | 2,931,851,975円   |
| 野村世界６資産分散投信（分配コース）               | 3,799,243,578円   |
| 野村世界６資産分散投信（成長コース）               | 4,274,092,281円   |
| 野村資産設計ファンド２０１５                   | 8,985,489円       |
| 野村資産設計ファンド２０２０                   | 9,714,965円       |
| 野村資産設計ファンド２０２５                   | 16,239,693円      |
| 野村資産設計ファンド２０３０                   | 25,494,401円      |
| 野村資産設計ファンド２０３５                   | 24,585,610円      |
| 野村資産設計ファンド２０４０                   | 42,937,296円      |
| 野村外国株インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）     | 45,899,536,881円  |
| のむラップ・ファンド（保守型）                  | 1,178,903,328円   |
| のむラップ・ファンド（普通型）                  | 11,952,614,536円  |
| のむラップ・ファンド（積極型）                  | 13,188,576,033円  |
| 野村資産設計ファンド２０４５                   | 9,597,666円       |
| 野村インデックスファンド・外国株式                | 8,718,810,293円   |
| マイ・ロード                           | 1,288,788,875円   |
| ネクストコア                           | 14,254,225円      |
| 野村インデックスファンド・海外５資産バランス           | 191,143,686円     |
| 野村外国株インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）      | 2,596,471,638円   |
| 野村世界６資産分散投信（配分変更コース）             | 187,318,765円     |
| 野村資産設計ファンド２０５０                   | 10,896,311円      |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型 | 2,804,354円       |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型 | 1,796,233円       |
| 野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型 | 1,404,563円       |

|                                                   |                 |
|---------------------------------------------------|-----------------|
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型                | 1,280,127円      |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                                 | 259,266,504円    |
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                                 | 1,151,901,975円  |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                 | 2,799,686円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                 | 3,043,763円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                 | 27,731,853円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                 | 9,550,373円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                 | 38,208,862円     |
| 野村6資産均等バランス                                       | 1,692,415,975円  |
| 野村つみたて外国株投信                                       | 14,216,496,395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）               | 5,432,880,716円  |
| 世界6資産分散ファンド                                       | 39,627,819円     |
| 野村資産設計ファンド2060                                    | 8,619,734円      |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信                                    | 1,550,410,612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 | 7,050,813,038円  |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式                            | 5,969,465,198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）                  | 108,580,987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）                  | 59,608,552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）                  | 459,832,830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）                  | 425,226,654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）                  | 724,789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）                | 4,083,538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）                  | 212,563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）                 | 529,796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）                 | 8,037,694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）                       | 324,046,646円    |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）                    | 3,909,166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）                | 25,809,696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）                | 77,582,146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）                | 2,031,033,038円  |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）                           | 16,884,773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）                | 1,247,082,432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）   | 11,670,308,569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）    | 1,035,193円      |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け）                              | 1,335,500円      |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け）                              | 8,721,265円      |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け）                              | 8,247,751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）         | 94,011,754,865円 |
| マイバランス30（確定拠出年金向け）                                | 1,997,709,592円  |
| マイバランス50（確定拠出年金向け）                                | 7,781,128,996円  |
| マイバランス70（確定拠出年金向け）                                | 7,754,423,432円  |
| マイバランスDC30                                        | 849,314,418円    |
| マイバランスDC50                                        | 1,977,323,690円  |
| マイバランスDC70                                        | 1,824,434,339円  |

|                                 |                 |
|---------------------------------|-----------------|
| 野村ＤＣ外国株式インデックスファンド・ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ | 41,580,443,068円 |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド                    | 528,276,828円    |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）              | 36,585,703円     |
| マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）           | 500,306,497円    |
| マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）           | 495,819,886円    |
| マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）           | 453,812,077円    |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース            | 20,227,610円     |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース          | 9,619,615円      |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース            | 53,686,800円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０     | 10,922,581円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０     | 10,315,033円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０     | 7,840,805円      |
| マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）           | 300,952,946円    |
| マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）           | 212,721,787円    |
| マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）           | 136,216,542円    |
| マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）           | 170,167,485円    |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０     | 5,830,519円      |
| マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）           | 58,650,813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）   | 106,385,889円    |
| みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）     | 57,325,968円     |
| 野村ＤＣバランスファンド（年金運用戦略タイプ）         | 22,554,161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(2023年2月17日現在)

| 種類 | 通貨  | 銘柄                     | 株式数     | 評価額    |               | 備考 |
|----|-----|------------------------|---------|--------|---------------|----|
|    |     |                        |         | 単価     | 金額            |    |
| 株式 | 米ドル | BAKER HUGHES CO        | 221,000 | 32.26  | 7,129,460.00  |    |
|    |     | HALLIBURTON CO         | 195,000 | 38.58  | 7,523,100.00  |    |
|    |     | SCHLUMBERGER LTD       | 309,400 | 55.78  | 17,258,332.00 |    |
|    |     | APA CORPORATION        | 72,000  | 40.14  | 2,890,080.00  |    |
|    |     | CHENIERE ENERGY INC    | 49,500  | 148.80 | 7,365,600.00  |    |
|    |     | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 21,600  | 83.91  | 1,812,456.00  |    |
|    |     | CHEVRON CORP           | 404,700 | 166.57 | 67,410,879.00 |    |
|    |     | CONOCOPHILLIPS         | 277,100 | 108.36 | 30,026,556.00 |    |
|    |     | COTERRA ENERGY INC     | 169,000 | 24.61  | 4,159,090.00  |    |
|    |     | DEVON ENERGY CORP      | 135,600 | 55.72  | 7,555,632.00  |    |
|    |     | DIAMONDBACK ENERGY INC | 36,700  | 141.76 | 5,202,592.00  |    |

|                                      |         |          |                |  |
|--------------------------------------|---------|----------|----------------|--|
| EOG RESOURCES INC                    | 128,200 | 125.14   | 16,042,948.00  |  |
| EQT CORP                             | 70,000  | 31.83    | 2,228,100.00   |  |
| EXXON MOBIL CORP                     | 907,100 | 115.73   | 104,978,683.00 |  |
| HESS CORP                            | 61,300  | 143.76   | 8,812,488.00   |  |
| HF SINCLAIR CORP                     | 34,200  | 53.81    | 1,840,302.00   |  |
| KINDER MORGAN INC                    | 444,000 | 18.09    | 8,031,960.00   |  |
| MARATHON OIL CORP                    | 148,000 | 26.78    | 3,963,440.00   |  |
| MARATHON PETROLEUM CORP              | 108,400 | 126.51   | 13,713,684.00  |  |
| OCCIDENTAL PETE CORP                 | 204,100 | 62.50    | 12,756,250.00  |  |
| ONEOK INC                            | 97,700  | 69.19    | 6,759,863.00   |  |
| OVINTIV INC                          | 53,500  | 46.72    | 2,499,520.00   |  |
| PHILLIPS 66                          | 105,600 | 104.92   | 11,079,552.00  |  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO         | 49,700  | 216.37   | 10,753,589.00  |  |
| TARGA RESOURCES CORP                 | 48,000  | 76.08    | 3,651,840.00   |  |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP              | 1,350   | 1,874.52 | 2,530,602.00   |  |
| VALERO ENERGY CORP                   | 86,400  | 133.97   | 11,575,008.00  |  |
| WILLIAMS COS                         | 266,000 | 32.09    | 8,535,940.00   |  |
| AIR PRODUCTS                         | 48,100  | 280.73   | 13,503,113.00  |  |
| ALBEMARLE CORP                       | 25,200  | 285.62   | 7,197,624.00   |  |
| CELANESE CORP-SERIES A               | 22,800  | 121.23   | 2,764,044.00   |  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC           | 43,500  | 85.31    | 3,710,985.00   |  |
| CORTEVA INC                          | 157,800 | 62.75    | 9,901,950.00   |  |
| DOW INC                              | 156,600 | 58.68    | 9,189,288.00   |  |
| DUPONT DE NEMOURS INC                | 110,200 | 75.47    | 8,316,794.00   |  |
| EASTMAN CHEMICAL CO.                 | 27,200  | 86.91    | 2,363,952.00   |  |
| ECOLAB INC                           | 55,900  | 161.99   | 9,055,241.00   |  |
| FMC CORP                             | 26,700  | 129.00   | 3,444,300.00   |  |
| INTERNATIONAL FLAVORS &<br>FRAGRANCE | 55,300  | 96.05    | 5,311,565.00   |  |
| LINDE PLC                            | 108,500 | 323.50   | 35,099,750.00  |  |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A             | 56,000  | 98.75    | 5,530,000.00   |  |
| MOSAIC CO/THE                        | 76,000  | 50.40    | 3,830,400.00   |  |
| PPG INDUSTRIES                       | 50,900  | 129.15   | 6,573,735.00   |  |
| RPM INTERNATIONAL INC                | 27,800  | 87.78    | 2,440,284.00   |  |
| SHERWIN-WILLIAMS                     | 53,500  | 227.13   | 12,151,455.00  |  |
| WESTLAKE CORPORATION                 | 7,500   | 123.95   | 929,625.00     |  |

|                                       |         |        |               |  |
|---------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| MARTIN MARIETTA MATERIALS             | 13,500  | 368.93 | 4,980,555.00  |  |
| VULCAN MATERIALS CO                   | 28,700  | 185.37 | 5,320,119.00  |  |
| AMCOR PLC                             | 317,000 | 11.41  | 3,616,970.00  |  |
| AVERY DENNISON CORP                   | 18,000  | 182.05 | 3,276,900.00  |  |
| BALL CORP                             | 68,700  | 57.39  | 3,942,693.00  |  |
| CROWN HOLDINGS INC                    | 27,100  | 87.72  | 2,377,212.00  |  |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)            | 73,000  | 38.64  | 2,820,720.00  |  |
| PACKAGING CORP OP AMERICA             | 20,300  | 141.48 | 2,872,044.00  |  |
| SEALED AIR CORP                       | 33,000  | 49.87  | 1,645,710.00  |  |
| WESTROCK CO                           | 57,000  | 33.09  | 1,886,130.00  |  |
| ALCOA CORP                            | 41,000  | 48.77  | 1,999,570.00  |  |
| CLEVELAND-CLIFFS INC                  | 115,000 | 20.59  | 2,367,850.00  |  |
| FREEPORT-MCMORAN INC                  | 311,000 | 42.76  | 13,298,360.00 |  |
| NEWMONT CORP                          | 171,000 | 45.85  | 7,840,350.00  |  |
| NUCOR CORP                            | 57,500  | 169.82 | 9,764,650.00  |  |
| STEEL DYNAMICS                        | 39,800  | 126.18 | 5,021,964.00  |  |
| BOEING CO                             | 122,800 | 212.21 | 26,059,388.00 |  |
| GENERAL DYNAMICS                      | 50,600  | 231.30 | 11,703,780.00 |  |
| HEICO CORP                            | 9,300   | 175.33 | 1,630,569.00  |  |
| HEICO CORP-CLASS A                    | 15,500  | 137.73 | 2,134,815.00  |  |
| HOWMET AEROSPACE INC                  | 83,000  | 42.95  | 3,564,850.00  |  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE          | 8,400   | 218.92 | 1,838,928.00  |  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC             | 41,700  | 211.45 | 8,817,465.00  |  |
| LOCKHEED MARTIN                       | 51,900  | 471.25 | 24,457,875.00 |  |
| NORTHROP GRUMMAN CORP                 | 32,200  | 465.35 | 14,984,270.00 |  |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP            | 321,400 | 100.97 | 32,451,758.00 |  |
| TEXTRON INC                           | 46,400  | 74.55  | 3,459,120.00  |  |
| TRANSDIGM GROUP INC                   | 11,070  | 748.67 | 8,287,776.90  |  |
| ALLEGION PLC                          | 19,700  | 118.75 | 2,339,375.00  |  |
| CARLISLE COS INC                      | 11,400  | 259.85 | 2,962,290.00  |  |
| CARRIER GLOBAL CORP                   | 182,000 | 45.23  | 8,231,860.00  |  |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC        | 27,500  | 64.49  | 1,773,475.00  |  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL<br>PLC | 151,200 | 64.45  | 9,744,840.00  |  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC              | 7,100   | 266.85 | 1,894,635.00  |  |
|                                       | 49,600  | 55.81  | 2,768,176.00  |  |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| MASCO CORP                   |         |        |               |  |
| OWENS CORNING INC            | 21,100  | 101.68 | 2,145,448.00  |  |
| SMITH (A.O.) CORP            | 27,900  | 67.72  | 1,889,388.00  |  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC       | 50,900  | 184.04 | 9,367,636.00  |  |
| QUANTA SERVICES INC          | 30,900  | 155.32 | 4,799,388.00  |  |
| AMETEK INC                   | 50,100  | 144.55 | 7,241,955.00  |  |
| EATON CORP PLC               | 87,200  | 174.11 | 15,182,392.00 |  |
| EMERSON ELEC                 | 129,700 | 85.70  | 11,115,290.00 |  |
| GENERAC HOLDINGS INC         | 13,100  | 129.91 | 1,701,821.00  |  |
| HUBBELL INC                  | 11,300  | 250.25 | 2,827,825.00  |  |
| PLUG POWER INC               | 118,000 | 15.84  | 1,869,120.00  |  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      | 24,800  | 295.88 | 7,337,824.00  |  |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 32,000  | 52.38  | 1,676,160.00  |  |
| 3M CORP                      | 120,100 | 112.00 | 13,451,200.00 |  |
| GENERAL ELECTRIC CO          | 239,700 | 84.05  | 20,146,785.00 |  |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC  | 146,600 | 199.36 | 29,226,176.00 |  |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 34,000  | 51.85  | 1,762,900.00  |  |
| CATERPILLAR INC DEL          | 114,900 | 246.52 | 28,325,148.00 |  |
| CUMMINS INC                  | 30,500  | 253.97 | 7,746,085.00  |  |
| DEERE & COMPANY              | 63,200  | 402.96 | 25,467,072.00 |  |
| DOVER CORP                   | 31,300  | 154.94 | 4,849,622.00  |  |
| FORTIVE CORP                 | 74,900  | 68.70  | 5,145,630.00  |  |
| IDEX CORP                    | 16,200  | 225.09 | 3,646,458.00  |  |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC      | 67,200  | 237.48 | 15,958,656.00 |  |
| INGERSOLL-RAND INC           | 88,500  | 57.39  | 5,079,015.00  |  |
| NORDSON CORP                 | 11,200  | 242.48 | 2,715,776.00  |  |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | 91,700  | 83.59  | 7,665,203.00  |  |
| PACCAR                       | 112,800 | 74.87  | 8,445,336.00  |  |
| PARKER HANNIFIN CORP         | 28,200  | 354.54 | 9,998,028.00  |  |
| PENTAIR PLC                  | 37,300  | 56.34  | 2,101,482.00  |  |
| SNAP-ON INC                  | 11,500  | 252.45 | 2,903,175.00  |  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   | 32,700  | 90.20  | 2,949,540.00  |  |
| WABTEC CORP                  | 38,400  | 104.38 | 4,008,192.00  |  |
| XYLEM INC                    | 39,600  | 106.25 | 4,207,500.00  |  |
| AERCAP HOLDINGS NV           | 29,000  | 63.15  | 1,831,350.00  |  |
|                              | 126,000 | 53.02  | 6,680,520.00  |  |

|                                             |         |        |                |  |
|---------------------------------------------|---------|--------|----------------|--|
| FASTENAL CO                                 |         |        |                |  |
| FERGUSON PLC                                | 45,600  | 148.37 | 6,765,672.00   |  |
| GRAINGER(W.W.) INC                          | 10,110  | 670.09 | 6,774,609.90   |  |
| UNITED RENTALS INC                          | 15,400  | 462.02 | 7,115,108.00   |  |
| CINTAS CORP                                 | 19,800  | 441.36 | 8,738,928.00   |  |
| COPART INC                                  | 92,100  | 68.93  | 6,348,453.00   |  |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A                  | 47,900  | 129.99 | 6,226,521.00   |  |
| ROLLINS INC                                 | 47,000  | 36.18  | 1,700,460.00   |  |
| WASTE CONNECTIONS INC                       | 55,200  | 136.36 | 7,527,072.00   |  |
| WASTE MANAGEMENT INC                        | 90,500  | 152.27 | 13,780,435.00  |  |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC                  | 25,900  | 103.73 | 2,686,607.00   |  |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH<br>INC        | 34,800  | 112.20 | 3,904,560.00   |  |
| FEDEX CORPORATION                           | 54,200  | 211.67 | 11,472,514.00  |  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B                  | 159,300 | 185.55 | 29,558,115.00  |  |
| DELTA AIR LINES INC                         | 36,000  | 38.28  | 1,378,080.00   |  |
| SOUTHWEST AIRLINES                          | 34,000  | 35.41  | 1,203,940.00   |  |
| ZIM INTEGRATED SHIPPING SERV                | 17,000  | 21.25  | 361,250.00     |  |
| CSX CORP                                    | 465,000 | 31.11  | 14,466,150.00  |  |
| GRAB HOLDINGS LTD-CL A                      | 290,000 | 3.67   | 1,064,300.00   |  |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC                 | 17,900  | 187.95 | 3,364,305.00   |  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION<br>HOLDINGS INC | 33,800  | 59.99  | 2,027,662.00   |  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP                       | 51,000  | 230.02 | 11,731,020.00  |  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE                   | 20,500  | 351.93 | 7,214,565.00   |  |
| U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING                | 19,170  | 57.70  | 1,106,109.00   |  |
| UBER TECHNOLOGIES INC                       | 321,000 | 36.22  | 11,626,620.00  |  |
| UNION PAC CORP                              | 135,900 | 200.52 | 27,250,668.00  |  |
| APTIV PLC                                   | 58,800  | 120.73 | 7,098,924.00   |  |
| BORGWARNER INC                              | 50,000  | 50.32  | 2,516,000.00   |  |
| LEAR CORP                                   | 12,300  | 142.98 | 1,758,654.00   |  |
| FORD MOTOR COMPANY                          | 866,000 | 12.91  | 11,180,060.00  |  |
| GENERAL MOTORS CO                           | 299,000 | 43.10  | 12,886,900.00  |  |
| LUCID GROUP INC                             | 98,000  | 10.63  | 1,041,740.00   |  |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A                     | 66,000  | 20.68  | 1,364,880.00   |  |
| TESLA INC                                   | 579,700 | 202.04 | 117,122,588.00 |  |

|                              |           |          |                |  |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|--|
| DR HORTON INC                | 71,000    | 97.15    | 6,897,650.00   |  |
| GARMIN LTD                   | 33,100    | 97.15    | 3,215,665.00   |  |
| LENNAR CORP-A                | 54,800    | 101.30   | 5,551,240.00   |  |
| MOHAWK INDUSTRIES            | 10,900    | 116.02   | 1,264,618.00   |  |
| NEWELL BRANDS INC            | 85,000    | 15.30    | 1,300,500.00   |  |
| NVR INC                      | 690       | 5,119.96 | 3,532,772.40   |  |
| PULTEGROUP INC               | 51,000    | 55.91    | 2,851,410.00   |  |
| WHIRLPOOL CORP               | 11,300    | 145.12   | 1,639,856.00   |  |
| HASBRO INC                   | 28,100    | 58.46    | 1,642,726.00   |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 25,600    | 321.83   | 8,238,848.00   |  |
| NIKE INC-B                   | 275,000   | 124.38   | 34,204,500.00  |  |
| V F CORP                     | 72,000    | 27.07    | 1,949,040.00   |  |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 82,000    | 139.42   | 11,432,440.00  |  |
| ARAMARK                      | 50,000    | 38.32    | 1,916,000.00   |  |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 8,610     | 2,493.18 | 21,466,279.80  |  |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC    | 48,000    | 52.18    | 2,504,640.00   |  |
| CARNIVAL CORP                | 206,000   | 11.60    | 2,389,600.00   |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 6,100     | 1,621.24 | 9,889,564.00   |  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 26,600    | 145.76   | 3,877,216.00   |  |
| DOMINOS PIZZA INC            | 8,000     | 356.83   | 2,854,640.00   |  |
| EXPEDIA GROUP INC            | 33,800    | 111.53   | 3,769,714.00   |  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 60,300    | 148.28   | 8,941,284.00   |  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 74,000    | 56.82    | 4,204,680.00   |  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA   | 59,500    | 175.79   | 10,459,505.00  |  |
| MCDONALD'S CORP              | 160,100   | 265.83   | 42,559,383.00  |  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 70,000    | 44.20    | 3,094,000.00   |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 49,000    | 73.90    | 3,621,100.00   |  |
| STARBUCKS CORP               | 249,700   | 107.54   | 26,852,738.00  |  |
| VAIL RESORTS INC             | 8,900     | 248.27   | 2,209,603.00   |  |
| WYNN RESORTS LTD             | 22,800    | 108.47   | 2,473,116.00   |  |
| YUM BRANDS INC               | 62,000    | 131.72   | 8,166,640.00   |  |
| GENUINE PARTS CO             | 30,500    | 179.15   | 5,464,075.00   |  |
| LKQ CORP                     | 56,300    | 57.90    | 3,259,770.00   |  |
| POOL CORP                    | 8,800     | 389.70   | 3,429,360.00   |  |
| AMAZON.COM INC               | 1,995,600 | 98.15    | 195,868,140.00 |  |

|                                |         |          |               |  |
|--------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| CHEWY INC - CLASS A            | 20,000  | 47.23    | 944,600.00    |  |
| DOORDASH INC-A                 | 49,000  | 66.89    | 3,277,610.00  |  |
| EBAY INC                       | 121,000 | 48.66    | 5,887,860.00  |  |
| ETSY INC                       | 28,000  | 130.31   | 3,648,680.00  |  |
| MERCADOLIBRE INC               | 9,930   | 1,119.64 | 11,118,025.20 |  |
| DOLLAR GENERAL CORP            | 49,000  | 228.82   | 11,212,180.00 |  |
| DOLLAR TREE INC                | 48,900  | 146.85   | 7,180,965.00  |  |
| TARGET CORP                    | 100,700 | 174.54   | 17,576,178.00 |  |
| ADVANCE AUTO PARTS             | 13,100  | 150.19   | 1,967,489.00  |  |
| AUTOZONE                       | 4,240   | 2,571.35 | 10,902,524.00 |  |
| BATH & BODY WORKS INC          | 50,400  | 42.91    | 2,162,664.00  |  |
| BEST BUY COMPANY INC           | 44,700  | 88.20    | 3,942,540.00  |  |
| BURLINGTON STORES INC          | 14,300  | 226.90   | 3,244,670.00  |  |
| CARMAX INC                     | 33,300  | 74.32    | 2,474,856.00  |  |
| HOME DEPOT                     | 222,800 | 321.24   | 71,572,272.00 |  |
| LOWES COS INC                  | 135,100 | 214.01   | 28,912,751.00 |  |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,        | 13,760  | 862.00   | 11,861,120.00 |  |
| ROSS STORES INC                | 76,200  | 115.32   | 8,787,384.00  |  |
| TJX COS INC                    | 251,600 | 79.62    | 20,032,392.00 |  |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY         | 24,500  | 236.98   | 5,806,010.00  |  |
| ULTA BEAUTY INC                | 11,100  | 531.56   | 5,900,316.00  |  |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION   | 96,400  | 504.10   | 48,595,240.00 |  |
| KROGER CO                      | 146,000 | 43.85    | 6,402,100.00  |  |
| SYSCO CORP                     | 111,300 | 77.47    | 8,622,411.00  |  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC   | 159,000 | 36.32    | 5,774,880.00  |  |
| WALMART INC                    | 328,100 | 144.27   | 47,334,987.00 |  |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B         | 67,500  | 65.42    | 4,415,850.00  |  |
| COCA COLA CO                   | 894,200 | 59.22    | 52,954,524.00 |  |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS | 46,300  | 56.73    | 2,626,599.00  |  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A     | 34,700  | 227.26   | 7,885,922.00  |  |
| KEURIG DR PEPPER INC           | 169,000 | 35.90    | 6,067,100.00  |  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B     | 41,900  | 51.40    | 2,153,660.00  |  |
| MONSTER BEVERAGE CORP          | 86,900  | 104.04   | 9,041,076.00  |  |
| PEPSICO INC                    | 300,400 | 175.51   | 52,723,204.00 |  |
| ARCHER DANIELS MIDLAND         | 120,800 | 81.42    | 9,835,536.00  |  |

|                                |         |        |               |  |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| BUNGE LIMITED                  | 33,900  | 97.55  | 3,306,945.00  |  |
| CAMPBELL SOUP CO               | 43,900  | 50.89  | 2,234,071.00  |  |
| CONAGRA BRANDS INC             | 104,000 | 35.82  | 3,725,280.00  |  |
| DARLING INGREDIENTS INC        | 33,700  | 67.72  | 2,282,164.00  |  |
| GENERAL MILLS                  | 130,800 | 75.11  | 9,824,388.00  |  |
| HERSHEY CO/THE                 | 32,100  | 235.22 | 7,550,562.00  |  |
| HORMEL FOODS CORP              | 67,000  | 44.95  | 3,011,650.00  |  |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW          | 22,700  | 147.22 | 3,341,894.00  |  |
| KELLOGG CO                     | 55,200  | 66.84  | 3,689,568.00  |  |
| KRAFT HEINZ CO/THE             | 159,000 | 39.78  | 6,325,020.00  |  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC       | 30,300  | 100.01 | 3,030,303.00  |  |
| MCCORMICK & CO INC.            | 55,000  | 74.31  | 4,087,050.00  |  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC     | 297,000 | 65.68  | 19,506,960.00 |  |
| TYSON FOODS INC-CL A           | 62,400  | 60.69  | 3,787,056.00  |  |
| ALTRIA GROUP INC               | 394,000 | 47.40  | 18,675,600.00 |  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL    | 337,400 | 100.30 | 33,841,220.00 |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC         | 52,000  | 82.79  | 4,305,080.00  |  |
| CLOROX CO                      | 26,700  | 152.67 | 4,076,289.00  |  |
| COLGATE PALMOLIVE CO.          | 172,000 | 72.77  | 12,516,440.00 |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP            | 74,200  | 126.47 | 9,384,074.00  |  |
| PROCTER & GAMBLE CO            | 519,200 | 137.14 | 71,203,088.00 |  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A    | 50,200  | 249.53 | 12,526,406.00 |  |
| ABBOTT LABORATORIES            | 381,100 | 106.08 | 40,427,088.00 |  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC           | 16,100  | 326.17 | 5,251,337.00  |  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.      | 110,200 | 39.80  | 4,385,960.00  |  |
| BECTON,DICKINSON               | 62,400  | 241.94 | 15,097,056.00 |  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP         | 311,000 | 46.48  | 14,455,280.00 |  |
| DENTSPLY SIRONA INC            | 49,000  | 35.80  | 1,754,200.00  |  |
| DEXCOM INC                     | 85,400  | 117.26 | 10,014,004.00 |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP      | 134,900 | 77.28  | 10,425,072.00 |  |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC | 78,500  | 70.91  | 5,566,435.00  |  |
| HOLOGIC INC                    | 54,500  | 82.62  | 4,502,790.00  |  |
| IDEXX LABORATORIES INC         | 18,200  | 506.40 | 9,216,480.00  |  |
| INSULET CORP                   | 15,000  | 298.91 | 4,483,650.00  |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC         | 78,100  | 240.16 | 18,756,496.00 |  |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| MASIMO CORP                  | 10,600  | 164.90 | 1,747,940.00  |  |
| MEDTRONIC PLC                | 289,400 | 84.20  | 24,367,480.00 |  |
| NOVOCURE LTD                 | 21,200  | 86.64  | 1,836,768.00  |  |
| RESMED INC                   | 31,400  | 213.91 | 6,716,774.00  |  |
| STERIS PLC                   | 22,200  | 191.68 | 4,255,296.00  |  |
| STRYKER CORP                 | 74,400  | 263.21 | 19,582,824.00 |  |
| TELEFLEX INC                 | 10,300  | 246.35 | 2,537,405.00  |  |
| THE COOPER COMPANIES, INC.   | 10,500  | 343.73 | 3,609,165.00  |  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC   | 45,200  | 125.11 | 5,654,972.00  |  |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 33,300  | 160.47 | 5,343,651.00  |  |
| CARDINAL HEALTH INC          | 58,300  | 78.64  | 4,584,712.00  |  |
| CENTENE CORP                 | 125,600 | 73.01  | 9,170,056.00  |  |
| CIGNA CORP                   | 66,100  | 299.43 | 19,792,323.00 |  |
| CVS HEALTH CORP              | 285,700 | 87.97  | 25,133,029.00 |  |
| DAVITA INC                   | 12,500  | 83.42  | 1,042,750.00  |  |
| ELEVANCE HEALTH INC          | 52,230  | 486.99 | 25,435,487.70 |  |
| HCA HEALTHCARE INC           | 49,900  | 263.15 | 13,131,185.00 |  |
| HENRY SCHEIN INC             | 30,100  | 82.82  | 2,492,882.00  |  |
| HUMANA INC                   | 27,500  | 505.69 | 13,906,475.00 |  |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 20,000  | 256.09 | 5,121,800.00  |  |
| MCKESSON CORP                | 31,200  | 363.75 | 11,349,000.00 |  |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | 12,400  | 292.97 | 3,632,828.00  |  |
| QUEST DIAGNOSTICS INC        | 25,200  | 146.66 | 3,695,832.00  |  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 203,570 | 487.35 | 99,209,839.50 |  |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 14,300  | 149.98 | 2,144,714.00  |  |
| ABBVIE INC                   | 384,800 | 149.53 | 57,539,144.00 |  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 26,500  | 219.85 | 5,826,025.00  |  |
| AMGEN INC                    | 116,400 | 234.22 | 27,263,208.00 |  |
| BIOGEN INC                   | 31,300  | 271.53 | 8,498,889.00  |  |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  | 40,200  | 107.29 | 4,313,058.00  |  |
| EXACT SCIENCES CORP          | 39,800  | 63.77  | 2,538,046.00  |  |
| GILEAD SCIENCES INC          | 272,800 | 83.39  | 22,748,792.00 |  |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC     | 46,700  | 109.62 | 5,119,254.00  |  |
| INCYTE CORP                  | 41,100  | 78.24  | 3,215,664.00  |  |
| MODERNA INC                  | 72,200  | 172.31 | 12,440,782.00 |  |

|                            |           |        |               |  |
|----------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 20,800    | 102.79 | 2,138,032.00  |  |
| REGENERON PHARMACEUTICALS  | 23,450    | 736.33 | 17,266,938.50 |  |
| SEAGEN INC                 | 30,000    | 160.91 | 4,827,300.00  |  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS     | 55,600    | 292.04 | 16,237,424.00 |  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO    | 464,700   | 70.85  | 32,923,995.00 |  |
| CATALENT INC               | 36,500    | 71.89  | 2,623,985.00  |  |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC   | 95,000    | 13.25  | 1,258,750.00  |  |
| ELI LILLY & CO.            | 175,800   | 326.07 | 57,323,106.00 |  |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC   | 13,400    | 146.32 | 1,960,688.00  |  |
| JOHNSON & JOHNSON          | 572,200   | 158.24 | 90,544,928.00 |  |
| MERCK & CO INC             | 551,400   | 106.51 | 58,729,614.00 |  |
| PFIZER INC                 | 1,221,500 | 42.95  | 52,463,425.00 |  |
| ROYALTY PHARMA PLC-CL A    | 78,000    | 37.24  | 2,904,720.00  |  |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 236,000   | 10.10  | 2,383,600.00  |  |
| VIATRIS INC                | 267,000   | 11.65  | 3,110,550.00  |  |
| ZOETIS INC                 | 102,400   | 173.93 | 17,810,432.00 |  |
| BANK OF AMERICA CORP       | 1,574,000 | 35.28  | 55,530,720.00 |  |
| CITIGROUP                  | 420,000   | 51.46  | 21,613,200.00 |  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP   | 109,000   | 42.81  | 4,666,290.00  |  |
| FIFTH THIRD BANCORP        | 151,000   | 36.66  | 5,535,660.00  |  |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 2,510     | 749.16 | 1,880,391.60  |  |
| FIRST HORIZON CORP         | 113,000   | 24.82  | 2,804,660.00  |  |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA     | 39,500    | 130.72 | 5,163,440.00  |  |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC  | 317,000   | 15.34  | 4,862,780.00  |  |
| JPMORGAN CHASE & CO        | 638,300   | 141.82 | 90,523,706.00 |  |
| KEYCORP                    | 200,000   | 19.08  | 3,816,000.00  |  |
| M & T BANK CORP            | 38,800    | 159.68 | 6,195,584.00  |  |
| PNC FINANCIAL              | 89,800    | 158.30 | 14,215,340.00 |  |
| REGIONS FINANCIAL CORP     | 200,000   | 23.66  | 4,732,000.00  |  |
| SIGNATURE BANK             | 14,300    | 127.02 | 1,816,386.00  |  |
| SVB FINANCIAL GROUP        | 12,500    | 301.93 | 3,774,125.00  |  |
| TRUIST FINANCIAL CORP      | 290,000   | 47.96  | 13,908,400.00 |  |
| US BANCORP                 | 309,000   | 48.55  | 15,001,950.00 |  |
| WEBSTER FINANCIAL CORP     | 37,000    | 55.25  | 2,044,250.00  |  |
| WELLS FARGO CO             | 826,000   | 47.22  | 39,003,720.00 |  |

|                              |         |          |               |  |
|------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 86,000  | 72.09    | 6,199,740.00  |  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B  | 283,200 | 308.18   | 87,276,576.00 |  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC       | 79,000  | 32.86    | 2,595,940.00  |  |
| AFLAC INC                    | 131,900 | 69.13    | 9,118,247.00  |  |
| ALLSTATE CORP                | 57,900  | 137.10   | 7,938,090.00  |  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 15,500  | 131.21   | 2,033,755.00  |  |
| AMERICAN INTL GROUP          | 166,900 | 62.16    | 10,374,504.00 |  |
| AON PLC                      | 45,800  | 310.25   | 14,209,450.00 |  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD       | 79,000  | 67.10    | 5,300,900.00  |  |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO      | 45,800  | 188.63   | 8,639,254.00  |  |
| ASSURANT INC                 | 11,300  | 132.94   | 1,502,222.00  |  |
| BROWN & BROWN INC            | 52,800  | 57.37    | 3,029,136.00  |  |
| CHUBB LTD                    | 90,500  | 210.26   | 19,028,530.00 |  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    | 32,200  | 125.89   | 4,053,658.00  |  |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A  | 5,400   | 240.62   | 1,299,348.00  |  |
| EVEREST RE GROUP LTD         | 8,500   | 380.36   | 3,233,060.00  |  |
| FNF GROUP                    | 59,000  | 42.94    | 2,533,460.00  |  |
| GLOBE LIFE INC               | 19,700  | 121.54   | 2,394,338.00  |  |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES  | 70,800  | 77.49    | 5,486,292.00  |  |
| LINCOLN NATIONAL CORP        | 33,200  | 34.47    | 1,144,404.00  |  |
| LOEWS CORP                   | 45,300  | 61.66    | 2,793,198.00  |  |
| MARKEL CORP                  | 2,980   | 1,322.12 | 3,939,917.60  |  |
| MARSH & MCLENNAN COS         | 108,200 | 166.51   | 18,016,382.00 |  |
| METLIFE INC                  | 148,800 | 72.47    | 10,783,536.00 |  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    | 53,600  | 91.38    | 4,897,968.00  |  |
| PROGRESSIVE CO               | 127,900 | 142.54   | 18,230,866.00 |  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC     | 80,400  | 103.11   | 8,290,044.00  |  |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 51,700  | 183.06   | 9,464,202.00  |  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC     | 24,300  | 242.36   | 5,889,348.00  |  |
| WR BERKLEY CORP              | 45,300  | 66.85    | 3,028,305.00  |  |
| ACCENTURE PLC-CL A           | 137,700 | 281.22   | 38,723,994.00 |  |
| AFFIRM HOLDINGS INC          | 42,000  | 13.58    | 570,360.00    |  |
| AKamai TECHNOLOGIES          | 33,600  | 77.07    | 2,589,552.00  |  |
| AUTOMATIC DATA PROCESS       | 90,800  | 227.48   | 20,655,184.00 |  |
| BLOCK INC                    | 116,300 | 78.63    | 9,144,669.00  |  |

|                                    |         |        |               |  |
|------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 25,900  | 143.59 | 3,718,981.00  |  |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A           | 57,000  | 68.32  | 3,894,240.00  |  |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP      | 113,200 | 66.36  | 7,511,952.00  |  |
| EPAM SYSTEMS INC                   | 12,200  | 346.01 | 4,221,322.00  |  |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION      | 132,400 | 69.16  | 9,156,784.00  |  |
| FISERV INC                         | 131,900 | 115.95 | 15,293,805.00 |  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 15,700  | 214.33 | 3,364,981.00  |  |
| GARTNER INC                        | 17,500  | 346.00 | 6,055,000.00  |  |
| GLOBAL PAYMENTS INC                | 61,100  | 117.35 | 7,170,085.00  |  |
| GODADDY INC - CLASS A              | 34,500  | 79.42  | 2,739,990.00  |  |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES    | 196,600 | 135.00 | 26,541,000.00 |  |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC        | 16,000  | 165.16 | 2,642,560.00  |  |
| MASTERCARD INC                     | 187,800 | 367.55 | 69,025,890.00 |  |
| MONGODB INC                        | 15,100  | 217.33 | 3,281,683.00  |  |
| OKTA INC                           | 33,500  | 75.27  | 2,521,545.00  |  |
| PAYCHEX INC                        | 71,200  | 114.66 | 8,163,792.00  |  |
| PAYPAL HOLDINGS INC                | 238,200 | 76.73  | 18,277,086.00 |  |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A              | 48,700  | 164.40 | 8,006,280.00  |  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS         | 49,300  | 62.32  | 3,072,376.00  |  |
| TOAST INC-CLASS A                  | 52,000  | 20.03  | 1,041,560.00  |  |
| TWILIO INC - A                     | 37,200  | 75.45  | 2,806,740.00  |  |
| VERISIGN INC                       | 20,700  | 207.42 | 4,293,594.00  |  |
| VISA INC-CLASS A SHARES            | 355,900 | 225.83 | 80,372,897.00 |  |
| WESTERN UNION CO                   | 88,000  | 14.10  | 1,240,800.00  |  |
| WIX.COM LTD                        | 12,200  | 86.56  | 1,056,032.00  |  |
| ADOBE INC                          | 101,850 | 365.16 | 37,191,546.00 |  |
| ANSYS INC                          | 18,800  | 273.24 | 5,136,912.00  |  |
| ASPEN TECHNOLOGY INC               | 6,100   | 213.19 | 1,300,459.00  |  |
| AUTODESK INC.                      | 46,900  | 222.13 | 10,417,897.00 |  |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B        | 40,000  | 40.98  | 1,639,200.00  |  |
| BILL.COM HOLDINGS INC              | 19,600  | 96.51  | 1,891,596.00  |  |
| BLACK KNIGHT INC                   | 33,000  | 64.47  | 2,127,510.00  |  |
| CADENCE DESIGN SYS INC             | 59,600  | 194.62 | 11,599,352.00 |  |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC           | 29,900  | 75.86  | 2,268,214.00  |  |
| CHECK POINT SOFTWARE               | 21,800  | 123.98 | 2,702,764.00  |  |

|                              |           |        |                |  |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| TECHNOLOGIES LTD.            |           |        |                |  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 44,900    | 115.12 | 5,168,888.00   |  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 9,500     | 146.04 | 1,387,380.00   |  |
| DATADOG INC - CLASS A        | 53,700    | 82.47  | 4,428,639.00   |  |
| DOCUSIGN INC                 | 42,200    | 66.65  | 2,812,630.00   |  |
| DROPBOX INC-CLASS A          | 57,000    | 23.96  | 1,365,720.00   |  |
| DYNATRACE INC                | 44,000    | 43.77  | 1,925,880.00   |  |
| FAIR ISAAC CORP              | 5,540     | 687.80 | 3,810,412.00   |  |
| FORTINET INC                 | 146,000   | 61.39  | 8,962,940.00   |  |
| GEN DIGITAL INC              | 128,000   | 21.35  | 2,732,800.00   |  |
| HUBSPOT INC                  | 10,200    | 361.93 | 3,691,686.00   |  |
| INTUIT INC                   | 58,300    | 408.36 | 23,807,388.00  |  |
| MICROSOFT CORP               | 1,542,000 | 262.15 | 404,235,300.00 |  |
| ORACLE CORPORATION           | 348,000   | 87.72  | 30,526,560.00  |  |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A  | 354,000   | 9.71   | 3,437,340.00   |  |
| PALO ALTO NETWORKS INC       | 65,600    | 172.02 | 11,284,512.00  |  |
| PAYCOM SOFTWARE INC          | 10,900    | 307.45 | 3,351,205.00   |  |
| PAYLOCITY HOLDING CORP       | 8,700     | 209.20 | 1,820,040.00   |  |
| PTC INC                      | 23,800    | 131.46 | 3,128,748.00   |  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       | 23,300    | 422.97 | 9,855,201.00   |  |
| SALESFORCE INC               | 217,640   | 168.11 | 36,587,460.40  |  |
| SERVICENOW INC               | 43,800    | 453.69 | 19,871,622.00  |  |
| SPLUNK INC                   | 34,800    | 107.09 | 3,726,732.00   |  |
| SYNOPSYS INC                 | 33,000    | 359.71 | 11,870,430.00  |  |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 9,200     | 339.09 | 3,119,628.00   |  |
| UNITY SOFTWARE INC           | 52,000    | 40.72  | 2,117,440.00   |  |
| VMWARE INC - CLASS A         | 46,700    | 116.26 | 5,429,342.00   |  |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 43,200    | 187.75 | 8,110,800.00   |  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 50,000    | 77.91  | 3,895,500.00   |  |
| ZSCALER INC                  | 17,800    | 132.93 | 2,366,154.00   |  |
| ARISTA NETWORKS INC          | 53,300    | 141.68 | 7,551,544.00   |  |
| CISCO SYSTEMS                | 900,900   | 50.99  | 45,936,891.00  |  |
| F5 INC                       | 12,400    | 146.80 | 1,820,320.00   |  |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 72,000    | 31.53  | 2,270,160.00   |  |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 36,700    | 267.36 | 9,812,112.00   |  |
|                              |           |        |                |  |

|                              |           |        |                |  |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| APPLE INC                    | 3,497,800 | 153.71 | 537,646,838.00 |  |
| DELL TECHNOLOGIES-C          | 59,000    | 42.72  | 2,520,480.00   |  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 285,000   | 16.46  | 4,691,100.00   |  |
| HP INC                       | 222,000   | 30.27  | 6,719,940.00   |  |
| NETAPP INC                   | 49,100    | 67.95  | 3,336,345.00   |  |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 41,700    | 70.53  | 2,941,101.00   |  |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 67,000    | 42.57  | 2,852,190.00   |  |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 129,400   | 81.36  | 10,527,984.00  |  |
| ARROW ELECTRS INC            | 13,700    | 123.66 | 1,694,142.00   |  |
| CDW CORPORATION              | 28,900    | 214.25 | 6,191,825.00   |  |
| COGNEX CORP                  | 38,000    | 55.31  | 2,101,780.00   |  |
| CORNING INC                  | 174,000   | 35.35  | 6,150,900.00   |  |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC    | 38,800    | 186.97 | 7,254,436.00   |  |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 69,100    | 132.00 | 9,121,200.00   |  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC    | 10,200    | 438.58 | 4,473,516.00   |  |
| TRIMBLE INC                  | 53,400    | 54.97  | 2,935,398.00   |  |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 11,500    | 333.44 | 3,834,560.00   |  |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 351,348   | 80.08  | 28,135,947.84  |  |
| ANALOG DEVICES INC           | 111,500   | 193.83 | 21,612,045.00  |  |
| APPLIED MATERIALS            | 187,200   | 115.39 | 21,601,008.00  |  |
| BROADCOM INC                 | 87,890    | 600.54 | 52,781,460.60  |  |
| ENPHASE ENERGY INC           | 29,600    | 202.80 | 6,002,880.00   |  |
| ENTEGRIS INC                 | 33,400    | 87.03  | 2,906,802.00   |  |
| FIRST SOLAR INC              | 21,400    | 165.01 | 3,531,214.00   |  |
| INTEL CORP                   | 893,500   | 28.20  | 25,196,700.00  |  |
| KLA CORP                     | 30,800    | 392.83 | 12,099,164.00  |  |
| LAM RESEARCH                 | 29,800    | 501.33 | 14,939,634.00  |  |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 186,000   | 45.69  | 8,498,340.00   |  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         | 119,300   | 84.64  | 10,097,552.00  |  |
| MICRON TECHNOLOGY            | 239,600   | 60.05  | 14,387,980.00  |  |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 9,800     | 513.37 | 5,031,026.00   |  |
| NVIDIA CORP                  | 541,940   | 220.02 | 119,237,638.80 |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 57,200    | 191.23 | 10,938,356.00  |  |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 94,800    | 84.13  | 7,975,524.00   |  |
| QORVO INC                    | 22,500    | 104.44 | 2,349,900.00   |  |
|                              |           |        |                |  |

|                           |           |        |               |  |
|---------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| QUALCOMM INC              | 244,400   | 130.16 | 31,811,104.00 |  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC    | 35,700    | 119.21 | 4,255,797.00  |  |
| SOLAREGE TECHNOLOGIES INC | 12,300    | 314.94 | 3,873,762.00  |  |
| TERADYNE INC              | 34,300    | 106.30 | 3,646,090.00  |  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC     | 198,900   | 176.08 | 35,022,312.00 |  |
| WOLFSPEED INC             | 26,100    | 80.79  | 2,108,619.00  |  |
| AT & T INC                | 1,551,000 | 19.26  | 29,872,260.00 |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A      | 31,000    | 20.72  | 642,320.00    |  |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C      | 64,000    | 21.26  | 1,360,640.00  |  |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC    | 216,000   | 3.84   | 829,440.00    |  |
| VERIZON COMMUNICATIONS    | 914,000   | 39.84  | 36,413,760.00 |  |
| T-MOBILE US INC           | 135,900   | 146.73 | 19,940,607.00 |  |
| ALLIANT ENERGY CORP       | 55,100    | 53.14  | 2,928,014.00  |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER   | 112,700   | 90.70  | 10,221,890.00 |  |
| CONSTELLATION ENERGY      | 70,800    | 85.63  | 6,062,604.00  |  |
| DUKE ENERGY CORP          | 168,400   | 98.29  | 16,552,036.00 |  |
| EDISON INTERNATIONAL      | 82,200    | 67.22  | 5,525,484.00  |  |
| ENTERGY CORP              | 45,100    | 108.27 | 4,882,977.00  |  |
| EVERGY INC                | 48,400    | 61.01  | 2,952,884.00  |  |
| EVERSOURCE ENERGY         | 74,500    | 78.72  | 5,864,640.00  |  |
| EXELON CORPORATION        | 214,000   | 42.49  | 9,092,860.00  |  |
| FIRSTENERGY CORP          | 120,000   | 40.57  | 4,868,400.00  |  |
| NEXTERA ENERGY INC        | 427,600   | 75.69  | 32,365,044.00 |  |
| NRG ENERGY INC            | 49,000    | 34.08  | 1,669,920.00  |  |
| PG&E CORP                 | 324,000   | 15.55  | 5,038,200.00  |  |
| PPL CORPORATION           | 163,000   | 28.45  | 4,637,350.00  |  |
| SOUTHERN CO.              | 236,000   | 65.86  | 15,542,960.00 |  |
| XCEL ENERGY INC           | 119,200   | 67.26  | 8,017,392.00  |  |
| ATMOS ENERGY CORP         | 29,700    | 115.69 | 3,435,993.00  |  |
| UGI CORP                  | 45,000    | 38.70  | 1,741,500.00  |  |
| AMEREN CORPORATION        | 57,200    | 85.84  | 4,910,048.00  |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC    | 135,000   | 29.05  | 3,921,750.00  |  |
| CMS ENERGY CORP           | 63,400    | 60.97  | 3,865,498.00  |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC   | 76,100    | 91.66  | 6,975,326.00  |  |
| DOMINION ENERGY INC       | 182,600   | 58.10  | 10,609,060.00 |  |
|                           |           |        |               |  |

|                               |         |        |               |  |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| DTE ENERGY COMPANY            | 42,900  | 113.40 | 4,864,860.00  |  |
| NISOURCE INC                  | 86,000  | 26.88  | 2,311,680.00  |  |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE         | 109,000 | 61.77  | 6,732,930.00  |  |
| SEMPRA ENERGY                 | 69,000  | 157.47 | 10,865,430.00 |  |
| WEC ENERGY GROUP INC          | 68,900  | 91.61  | 6,311,929.00  |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC   | 39,100  | 147.46 | 5,765,686.00  |  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC       | 52,500  | 45.51  | 2,389,275.00  |  |
| ALLY FINANCIAL INC            | 68,000  | 31.29  | 2,127,720.00  |  |
| AMERICAN EXPRESS CO           | 138,700 | 177.94 | 24,680,278.00 |  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 84,300  | 111.55 | 9,403,665.00  |  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 60,200  | 111.63 | 6,720,126.00  |  |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 103,800 | 35.65  | 3,700,470.00  |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 23,800  | 349.47 | 8,317,386.00  |  |
| ARES MANAGEMENT CORP - A      | 32,600  | 83.50  | 2,722,100.00  |  |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP   | 165,000 | 51.29  | 8,462,850.00  |  |
| BLACKROCK INC                 | 32,810  | 713.00 | 23,393,530.00 |  |
| BLACKSTONE INC                | 153,600 | 94.44  | 14,505,984.00 |  |
| CARLYLE GROUP INC/THE         | 45,000  | 34.81  | 1,566,450.00  |  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC       | 22,700  | 126.73 | 2,876,771.00  |  |
| CME GROUP INC                 | 78,700  | 188.50 | 14,834,950.00 |  |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A  | 26,200  | 65.59  | 1,718,458.00  |  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC  | 8,400   | 427.17 | 3,588,228.00  |  |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 65,000  | 31.20  | 2,028,000.00  |  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR         | 13,000  | 50.08  | 651,040.00    |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP           | 74,300  | 370.20 | 27,505,860.00 |  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 121,300 | 107.13 | 12,994,869.00 |  |
| INVESCO LTD                   | 77,000  | 18.46  | 1,421,420.00  |  |
| KKR & CO INC-A                | 121,000 | 57.55  | 6,963,550.00  |  |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC    | 17,400  | 248.19 | 4,318,506.00  |  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC      | 7,900   | 359.54 | 2,840,366.00  |  |
| MOODYS CORP                   | 35,900  | 302.50 | 10,859,750.00 |  |
| MORGAN STANLEY                | 280,200 | 99.57  | 27,899,514.00 |  |
| MSCI INC                      | 17,680  | 552.99 | 9,776,863.20  |  |
| NASDAQ INC                    | 74,700  | 58.44  | 4,365,468.00  |  |
| NORTHERN TRUST CORP           | 42,500  | 95.72  | 4,068,100.00  |  |
|                               |         |        |               |  |

|                               |         |          |               |
|-------------------------------|---------|----------|---------------|
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 42,700  | 114.02   | 4,868,654.00  |
| S&P GLOBAL INC                | 74,195  | 357.82   | 26,548,454.90 |
| SCHWAB(CHARLES)CORP           | 316,500 | 80.34    | 25,427,610.00 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 26,000  | 61.96    | 1,610,960.00  |
| STATE STREET CORP             | 79,000  | 93.27    | 7,368,330.00  |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 49,900  | 119.08   | 5,942,092.00  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A  | 24,300  | 73.26    | 1,780,218.00  |
| AES CORP                      | 143,000 | 26.37    | 3,770,910.00  |
| VISTRA CORP                   | 84,000  | 22.82    | 1,916,880.00  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A     | 30,700  | 173.03   | 5,312,021.00  |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 63,900  | 148.28   | 9,475,092.00  |
| AVANTOR INC                   | 150,000 | 24.37    | 3,655,500.00  |
| BIO TECHNE CORP               | 34,500  | 76.24    | 2,630,280.00  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A        | 4,670   | 455.91   | 2,129,099.70  |
| CHARLES RIVER LABORATORIES    | 11,300  | 254.25   | 2,873,025.00  |
| DANAHER CORP                  | 150,400 | 255.75   | 38,464,800.00 |
| ILLUMINA INC                  | 33,800  | 211.82   | 7,159,516.00  |
| IQVIA HOLDINGS INC            | 41,000  | 224.00   | 9,184,000.00  |
| METTLER-TOLEDO INTL           | 4,870   | 1,534.51 | 7,473,063.70  |
| PERKINELMER INC               | 27,400  | 134.88   | 3,695,712.00  |
| REPLIGEN CORP                 | 11,100  | 198.10   | 2,198,910.00  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC  | 85,270  | 557.58   | 47,544,846.60 |
| WATERS CORP                   | 13,000  | 327.33   | 4,255,290.00  |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES  | 16,200  | 319.77   | 5,180,274.00  |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS  | 28,900  | 96.48    | 2,788,272.00  |
| CLARIVATE PLC                 | 65,000  | 10.86    | 705,900.00    |
| COSTAR GROUP INC              | 85,700  | 78.18    | 6,700,026.00  |
| EQUIFAX INC                   | 26,600  | 213.00   | 5,665,800.00  |
| JACOBS SOLUTIONS INC          | 27,500  | 122.55   | 3,370,125.00  |
| LEIDOS HOLDINGS INC           | 27,500  | 99.43    | 2,734,325.00  |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 24,700  | 82.90    | 2,047,630.00  |
| TRUNSON                       | 43,100  | 70.48    | 3,037,688.00  |
| VERISK ANALYTICS INC          | 33,600  | 176.22   | 5,920,992.00  |
| CBRE GROUP INC                | 70,300  | 88.50    | 6,221,550.00  |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD    | 260,000 | 4.74     | 1,232,400.00  |
| ZILLOW GROUP INC - C          | 33,200  | 47.90    | 1,590,280.00  |

|                                      |           |        |                     |  |
|--------------------------------------|-----------|--------|---------------------|--|
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A         | 24,700    | 400.37 | 9,889,139.00        |  |
| COMCAST CORP-CL A                    | 958,100   | 39.72  | 38,055,732.00       |  |
| DISH NETWORK CORP-A                  | 51,000    | 14.10  | 719,100.00          |  |
| FOX CORP-CLASS A                     | 68,000    | 36.73  | 2,497,640.00        |  |
| FOX CORP-CLASS B                     | 30,000    | 33.99  | 1,019,700.00        |  |
| INTERPUBRIC GROUP                    | 85,000    | 37.20  | 3,162,000.00        |  |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C             | 27,100    | 94.00  | 2,547,400.00        |  |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C               | 34,000    | 33.84  | 1,150,560.00        |  |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP               | 17,000    | 33.92  | 576,640.00          |  |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I               | 86,000    | 18.70  | 1,608,200.00        |  |
| OMNICOM GROUP                        | 45,600    | 93.20  | 4,249,920.00        |  |
| PARAMOUNT GLOBAL                     | 129,000   | 23.50  | 3,031,500.00        |  |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC               | 171,000   | 4.61   | 788,310.00          |  |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A          | 98,000    | 63.07  | 6,180,860.00        |  |
| ACTIVISION BLIZZARD INC              | 171,400   | 77.51  | 13,285,214.00       |  |
| DISNEY (WALT) CO                     | 396,800   | 105.83 | 41,993,344.00       |  |
| ELECTRONIC ARTS                      | 60,100    | 111.72 | 6,714,372.00        |  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C         | 43,700    | 69.96  | 3,057,252.00        |  |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN         | 38,600    | 78.21  | 3,018,906.00        |  |
| NETFLIX INC                          | 96,800    | 350.71 | 33,948,728.00       |  |
| ROBLOX CORP -CLASS A                 | 79,000    | 43.58  | 3,442,820.00        |  |
| ROKU INC                             | 27,700    | 70.57  | 1,954,789.00        |  |
| SEA LTD-ADR                          | 78,100    | 66.83  | 5,219,423.00        |  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE<br>INC | 36,500    | 112.52 | 4,106,980.00        |  |
| WARNER BROS DISCOVERY INC            | 497,000   | 15.31  | 7,609,070.00        |  |
| ALPHABET INC-CL A                    | 1,305,000 | 95.51  | 124,640,550.00      |  |
| ALPHABET INC-CL C                    | 1,207,200 | 95.78  | 115,625,616.00      |  |
| MATCH GROUP INC                      | 63,000    | 43.92  | 2,766,960.00        |  |
| META PLATFORMS INC-CLASS A           | 496,400   | 172.44 | 85,599,216.00       |  |
| PINTEREST INC- CLASS A               | 129,000   | 24.84  | 3,204,360.00        |  |
| SNAP INC-A                           | 248,000   | 10.73  | 2,661,040.00        |  |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC            | 54,000    | 26.40  | 1,425,600.00        |  |
| 小計 銘柄数：601                           |           |        | 7,706,302,081.84    |  |
|                                      |           |        | (1,035,726,999,799) |  |

|       | 組入時価比率：69.6%                   |         |        | 72.2%         |  |
|-------|--------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| カナダドル | LUMINE GROUP INC               | 12,991  | 14.34  | 186,420.75    |  |
|       | ARC RESOURCES LTD              | 148,000 | 15.53  | 2,298,440.00  |  |
|       | CAMECO CORP                    | 94,000  | 38.73  | 3,640,620.00  |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 243,600 | 78.68  | 19,166,448.00 |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC             | 304,000 | 24.85  | 7,554,400.00  |  |
|       | ENBRIDGE INC                   | 443,000 | 52.71  | 23,350,530.00 |  |
|       | IMPERIAL OIL                   | 50,000  | 69.21  | 3,460,500.00  |  |
|       | KEYERA CORP                    | 48,000  | 31.15  | 1,495,200.00  |  |
|       | PARKLAND CORP                  | 36,000  | 30.47  | 1,096,920.00  |  |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP          | 120,000 | 46.50  | 5,580,000.00  |  |
|       | SUNCOR ENERGY INC              | 295,000 | 45.67  | 13,472,650.00 |  |
|       | TC ENERGY CORP                 | 218,000 | 57.05  | 12,436,900.00 |  |
|       | TOURMALINE OIL CORP            | 68,200  | 62.13  | 4,237,266.00  |  |
|       | NUTRIEN LTD                    | 118,300 | 104.88 | 12,407,304.00 |  |
|       | CCL INDUSTRIES INC - CL B      | 32,000  | 60.84  | 1,946,880.00  |  |
|       | AGNICO EAGLE MINES LTD         | 99,200  | 66.35  | 6,581,920.00  |  |
|       | BARRICK GOLD                   | 383,000 | 22.80  | 8,732,400.00  |  |
|       | FIRST QUANTUM MINERALS LTD     | 128,000 | 26.78  | 3,427,840.00  |  |
|       | FRANCO-NEVADA CORP             | 41,900  | 181.44 | 7,602,336.00  |  |
|       | IVANHOE MINES LTD-CL A         | 141,000 | 12.58  | 1,773,780.00  |  |
|       | KINROSS GOLD CORP              | 300,000 | 5.29   | 1,587,000.00  |  |
|       | LUNDIN MINING CORP             | 137,000 | 8.92   | 1,222,040.00  |  |
|       | PAN AMERICAN SILVER CORP       | 43,000  | 21.83  | 938,690.00    |  |
|       | TECK RESOURCES LTD-CLS B       | 104,000 | 59.05  | 6,141,200.00  |  |
|       | WHEATON PRECIOUS METALS CORP   | 100,000 | 57.00  | 5,700,000.00  |  |
|       | WEST FRASER TIMBER             | 14,200  | 109.42 | 1,553,764.00  |  |
|       | CAE INC                        | 67,000  | 31.77  | 2,128,590.00  |  |
|       | WSP GLOBAL INC                 | 27,700  | 170.41 | 4,720,357.00  |  |
|       | TOROMONT INDUSTRIES LTD        | 17,000  | 111.51 | 1,895,670.00  |  |
|       | GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT | 38,000  | 42.19  | 1,603,220.00  |  |
|       | RITCHIE BROS. AUCTIONEERS      | 23,700  | 84.31  | 1,998,147.00  |  |
|       | AIR CANADA                     | 43,000  | 23.15  | 995,450.00    |  |
|       | CANADIAN NATL RAILWAY CO       | 127,500 | 158.03 | 20,148,825.00 |  |
|       | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD   | 203,500 | 105.48 | 21,465,180.00 |  |

|                                        |         |          |               |  |
|----------------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| TFI INTERNATIONAL INC                  | 17,000  | 172.00   | 2,924,000.00  |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC                | 58,700  | 75.92    | 4,456,504.00  |  |
| BRP INC/CA- SUB VOTING                 | 7,400   | 119.94   | 887,556.00    |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC                  | 37,000  | 40.10    | 1,483,700.00  |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL<br>INC | 62,500  | 89.44    | 5,590,000.00  |  |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A               | 11,500  | 173.00   | 1,989,500.00  |  |
| DOLLARAMA INC                          | 59,000  | 79.25    | 4,675,750.00  |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC           | 178,000 | 64.84    | 11,541,520.00 |  |
| EMPIRE CO LTD A                        | 39,000  | 36.80    | 1,435,200.00  |  |
| LOBLAW COMPANIES                       | 35,600  | 118.43   | 4,216,108.00  |  |
| METRO INC                              | 53,000  | 71.52    | 3,790,560.00  |  |
| WESTON(GEORGE)LTD                      | 15,700  | 168.86   | 2,651,102.00  |  |
| SAPUTO INC                             | 57,000  | 36.32    | 2,070,240.00  |  |
| BANK OF MONTREAL                       | 145,800 | 135.11   | 19,699,038.00 |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX            | 260,000 | 73.47    | 19,102,200.00 |  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF<br>COMMERCE  | 195,000 | 62.23    | 12,134,850.00 |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA                | 73,800  | 100.49   | 7,416,162.00  |  |
| ROYAL BANK OF CANADA                   | 302,900 | 138.54   | 41,963,766.00 |  |
| TORONTO DOMINION BANK                  | 395,900 | 92.65    | 36,680,135.00 |  |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP          | 83,000  | 19.38    | 1,608,540.00  |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD            | 4,940   | 868.83   | 4,292,020.20  |  |
| GREAT-WEST LIFECO INC                  | 64,000  | 36.13    | 2,312,320.00  |  |
| IA FINANCIAL CORP INC                  | 24,100  | 89.66    | 2,160,806.00  |  |
| INTACT FINANCIAL CORP                  | 38,400  | 200.51   | 7,699,584.00  |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP                | 416,000 | 27.12    | 11,281,920.00 |  |
| POWER CORPORATION OF CANADA            | 124,000 | 35.87    | 4,447,880.00  |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                 | 128,000 | 68.20    | 8,729,600.00  |  |
| CGI INC                                | 46,300  | 124.77   | 5,776,851.00  |  |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG             | 14,000  | 44.56    | 623,840.00    |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A                  | 260,000 | 60.39    | 15,701,400.00 |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC             | 4,330   | 2,364.70 | 10,239,151.00 |  |
| DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)             | 17,800  | 101.37   | 1,804,386.00  |  |
| OPEN TEXT CORP                         | 56,000  | 47.47    | 2,658,320.00  |  |
| BCE INC                                | 14,400  | 60.99    | 878,256.00    |  |

|     |                             |         |        |                  |  |
|-----|-----------------------------|---------|--------|------------------|--|
| 小計  | TELUS CORP                  | 98,600  | 27.29  | 2,690,794.00     |  |
|     | ROGERS COMMUNICATIONS-CL B  | 79,000  | 65.55  | 5,178,450.00     |  |
|     | EMERA INC                   | 56,000  | 54.10  | 3,029,600.00     |  |
|     | FORTIS INC                  | 106,000 | 54.95  | 5,824,700.00     |  |
|     | HYDRO ONE LTD               | 70,000  | 35.72  | 2,500,400.00     |  |
|     | ALTAGAS LTD                 | 60,000  | 24.36  | 1,461,600.00     |  |
|     | ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 139,000 | 10.46  | 1,453,940.00     |  |
|     | CANADIAN UTILITIES LTD A    | 27,000  | 36.30  | 980,100.00       |  |
|     | BROOKFIELD ASSET MGMT-A     | 74,500  | 47.64  | 3,549,180.00     |  |
|     | BROOKFIELD CORP             | 306,000 | 48.45  | 14,825,700.00    |  |
|     | IGM FINANCIAL INC           | 21,000  | 42.64  | 895,440.00       |  |
|     | ONEX CORPORATION            | 16,900  | 68.09  | 1,150,721.00     |  |
|     | TMX GROUP LTD               | 11,300  | 134.90 | 1,524,370.00     |  |
|     | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A  | 29,000  | 39.91  | 1,157,390.00     |  |
|     | NORTHLAND POWER INC         | 53,000  | 33.31  | 1,765,430.00     |  |
|     | THOMSON REUTERS CORP        | 36,500  | 166.71 | 6,084,915.00     |  |
|     | FIRSTSERVICE CORP           | 8,500   | 191.27 | 1,625,795.00     |  |
|     | QUEBECOR INC-CL B           | 34,000  | 32.66  | 1,110,440.00     |  |
|     | SHAW COMMUNICATIONS INC-B   | 104,000 | 39.25  | 4,082,000.00     |  |
|     | 銘柄数：87                      |         |        | 538,360,617.95   |  |
|     |                             |         |        | (53,706,855,246) |  |
|     | 組入時価比率：3.6%                 |         |        | 3.7%             |  |
| ユーロ | TENARIS SA                  | 101,000 | 17.34  | 1,751,845.00     |  |
|     | ENI SPA                     | 545,000 | 14.71  | 8,019,130.00     |  |
|     | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 109,000 | 11.94  | 1,302,005.00     |  |
|     | NESTE OYJ                   | 91,000  | 45.14  | 4,107,740.00     |  |
|     | OMV AG                      | 32,000  | 46.20  | 1,478,400.00     |  |
|     | REPSOL SA                   | 302,000 | 15.40  | 4,652,310.00     |  |
|     | TOTALENERGIES SE            | 541,500 | 59.94  | 32,457,510.00    |  |
|     | AIR LIQUIDE SA              | 114,500 | 148.38 | 16,989,510.00    |  |
|     | AKZO NOBEL                  | 39,400  | 70.80  | 2,789,520.00     |  |
|     | ARKEMA                      | 13,600  | 93.44  | 1,270,784.00     |  |
|     | BASF SE                     | 199,700 | 52.40  | 10,464,280.00    |  |
|     | COVESTRO AG                 | 43,000  | 42.55  | 1,829,650.00     |  |
|     | EVONIK INDUSTRIES AG        | 48,000  | 20.14  | 966,720.00       |  |
|     |                             |         |        |                  |  |

|                             |         |        |               |
|-----------------------------|---------|--------|---------------|
| KONINKLIJKE DSM NV          | 37,400  | 125.70 | 4,701,180.00  |
| OCI                         | 21,000  | 29.98  | 629,580.00    |
| SOLVAY SA                   | 16,400  | 109.35 | 1,793,340.00  |
| SYMRISE AG                  | 28,900  | 97.08  | 2,805,612.00  |
| UMICORE                     | 44,000  | 32.50  | 1,430,000.00  |
| CRH PLC                     | 166,000 | 44.32  | 7,357,120.00  |
| HEIDELBERGCEMENT AG         | 30,600  | 63.78  | 1,951,668.00  |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 55,000  | 36.16  | 1,988,800.00  |
| ARCELORMITTAL               | 111,000 | 28.86  | 3,203,460.00  |
| VOESTALPINE AG              | 24,000  | 34.32  | 823,680.00    |
| STORA ENSO OYJ-R            | 119,000 | 13.65  | 1,624,350.00  |
| UPM-KYMMENE OYJ             | 113,000 | 34.26  | 3,871,380.00  |
| AIRBUS SE                   | 129,300 | 124.94 | 16,154,742.00 |
| DASSAULT AVIATION SA        | 5,000   | 163.20 | 816,000.00    |
| MTU AERO ENGINES AG         | 11,900  | 230.00 | 2,737,000.00  |
| RHEINMETALL AG              | 9,400   | 248.10 | 2,332,140.00  |
| SAFRAN SA                   | 74,400  | 134.10 | 9,977,040.00  |
| THALES SA                   | 23,500  | 128.80 | 3,026,800.00  |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)  | 107,000 | 53.09  | 5,680,630.00  |
| KINGSPAN GROUP PLC          | 33,400  | 59.96  | 2,002,664.00  |
| ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV | 50,094  | 27.34  | 1,369,569.96  |
| BOUYGUES                    | 52,000  | 31.75  | 1,651,000.00  |
| EIFFAGE SA                  | 18,100  | 103.35 | 1,870,635.00  |
| FERROVIAL SA                | 105,847 | 27.29  | 2,888,564.63  |
| VINCI                       | 116,900 | 108.60 | 12,695,340.00 |
| LEGRAND SA                  | 59,100  | 89.18  | 5,270,538.00  |
| PRYSMIAN SPA                | 54,000  | 37.93  | 2,048,220.00  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE       | 117,600 | 156.00 | 18,345,600.00 |
| SIEMENS ENERGY AG           | 99,000  | 19.46  | 1,927,035.00  |
| SIEMENS AG                  | 166,500 | 147.38 | 24,538,770.00 |
| ALSTOM                      | 71,000  | 27.50  | 1,952,500.00  |
| CNH INDUSTRIAL NV           | 221,000 | 15.35  | 3,393,455.00  |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG    | 97,000  | 30.98  | 3,005,545.00  |
| GEA GROUP AG                | 34,000  | 41.86  | 1,423,240.00  |
| KNORR-BREMSE AG             | 15,200  | 63.86  | 970,672.00    |
| KONE OYJ                    | 76,000  | 48.63  | 3,695,880.00  |

|                                     |         |          |               |  |
|-------------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| RATIONAL AG                         | 1,050   | 624.50   | 655,725.00    |  |
| WARTSILA OYJ                        | 101,000 | 9.46     | 955,864.00    |  |
| BRENTAG SE                          | 34,100  | 73.80    | 2,516,580.00  |  |
| IMCD NV                             | 12,600  | 153.00   | 1,927,800.00  |  |
| DEUTSCHE POST AG-REG                | 218,000 | 41.15    | 8,970,700.00  |  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG              | 137,000 | 9.65     | 1,322,324.00  |  |
| ADP                                 | 6,100   | 136.45   | 832,345.00    |  |
| AENA SME SA                         | 15,800  | 141.30   | 2,232,540.00  |  |
| GETLINK                             | 93,000  | 16.63    | 1,547,055.00  |  |
| CONTINENTAL AG                      | 23,200  | 70.62    | 1,638,384.00  |  |
| MICHELIN (CGDE)                     | 147,000 | 30.17    | 4,434,990.00  |  |
| VALEO SA                            | 45,000  | 21.46    | 965,700.00    |  |
| BAYER MOTOREN WERK                  | 71,700  | 99.24    | 7,115,508.00  |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD        | 12,500  | 91.65    | 1,145,625.00  |  |
| DR ING HC F PORSCHE AG              | 25,500  | 114.90   | 2,929,950.00  |  |
| FERRARI NV                          | 27,100  | 250.60   | 6,791,260.00  |  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG              | 174,300 | 72.58    | 12,650,694.00 |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE        | 31,900  | 56.00    | 1,786,400.00  |  |
| RENAULT SA                          | 40,000  | 43.56    | 1,742,600.00  |  |
| STELLANTIS NV                       | 485,000 | 15.90    | 7,713,440.00  |  |
| VOLKSWAGEN AG                       | 6,300   | 168.40   | 1,060,920.00  |  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                  | 40,000  | 130.98   | 5,239,200.00  |  |
| SEB SA                              | 5,400   | 100.30   | 541,620.00    |  |
| ADIDAS AG                           | 38,200  | 144.92   | 5,535,944.00  |  |
| HERMES INTERNATIONAL                | 6,940   | 1,741.00 | 12,082,540.00 |  |
| KERING SA                           | 16,310  | 596.70   | 9,732,177.00  |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 60,240  | 823.30   | 49,595,592.00 |  |
| MONCLER SPA                         | 45,500  | 58.16    | 2,646,280.00  |  |
| PUMA SE                             | 24,100  | 62.76    | 1,512,516.00  |  |
| ACCOR SA                            | 39,000  | 30.77    | 1,200,030.00  |  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC           | 36,300  | 150.60   | 5,466,780.00  |  |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM          | 24,000  | 37.05    | 889,200.00    |  |
| SODEXO                              | 18,200  | 86.40    | 1,572,480.00  |  |
| D'IETEREN GROUP                     | 5,700   | 186.80   | 1,064,760.00  |  |
| DELIVERY HERO SE                    | 38,000  | 41.74    | 1,586,120.00  |  |

|                               |         |        |               |  |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV      | 43,000  | 21.90  | 941,700.00    |  |
| PROSUS NV                     | 180,100 | 74.80  | 13,471,480.00 |  |
| ZALANDO SE                    | 50,000  | 39.21  | 1,960,500.00  |  |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA | 236,000 | 28.47  | 6,718,920.00  |  |
| CARREFOUR SUPERMARCHE         | 130,000 | 18.19  | 2,364,700.00  |  |
| HELLOFRESH SE                 | 31,800  | 22.16  | 704,688.00    |  |
| JERONIMO MARTINS              | 64,000  | 20.24  | 1,295,360.00  |  |
| KESKO OYJ-B SHS               | 58,000  | 20.07  | 1,164,060.00  |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 228,000 | 29.21  | 6,659,880.00  |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV    | 188,800 | 55.38  | 10,455,744.00 |  |
| DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV      | 107,000 | 10.51  | 1,125,105.00  |  |
| HEINEKEN HOLDING NV           | 22,000  | 77.80  | 1,711,600.00  |  |
| HEINEKEN NV                   | 56,800  | 94.28  | 5,355,104.00  |  |
| PERNOD RICARD SA              | 44,500  | 195.80 | 8,713,100.00  |  |
| REMY COINTREAU                | 4,900   | 169.10 | 828,590.00    |  |
| DANONE                        | 140,100 | 51.69  | 7,241,769.00  |  |
| JDE PEET'S BV                 | 21,000  | 27.38  | 574,980.00    |  |
| KERRY GROUP PLC-A             | 34,300  | 91.06  | 3,123,358.00  |  |
| HENKEL AG & CO KGAA           | 22,900  | 63.55  | 1,455,295.00  |  |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG    | 38,300  | 66.70  | 2,554,610.00  |  |
| BEIERSDORF AG                 | 21,400  | 113.55 | 2,429,970.00  |  |
| LOREAL-ORD                    | 52,300  | 391.60 | 20,480,680.00 |  |
| BIOMERIEUX                    | 8,800   | 98.00  | 862,400.00    |  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR      | 8,600   | 136.65 | 1,175,190.00  |  |
| DIASORIN ITALIA SPA           | 6,000   | 117.85 | 707,100.00    |  |
| ESSILORLUXOTTICA              | 63,800  | 175.55 | 11,200,090.00 |  |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV        | 197,000 | 15.97  | 3,146,878.00  |  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG       | 61,400  | 50.24  | 3,084,736.00  |  |
| AMPLIFON SPA                  | 24,000  | 28.16  | 675,840.00    |  |
| FRESENIUS MEDICAL CARE        | 45,000  | 37.46  | 1,685,700.00  |  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA        | 92,000  | 28.54  | 2,625,680.00  |  |
| ARGENX SE                     | 12,000  | 346.60 | 4,159,200.00  |  |
| GRIFOLS SA                    | 63,000  | 13.92  | 876,960.00    |  |
| BAYER AG-REG                  | 215,300 | 59.45  | 12,799,585.00 |  |
| IPSEN                         | 7,300   | 106.80 | 779,640.00    |  |

|                                      |           |        |               |  |
|--------------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| MERCK KGAA                           | 28,300    | 184.10 | 5,210,030.00  |  |
| ORION OYJ                            | 24,200    | 45.31  | 1,096,502.00  |  |
| RECORDATI SPA                        | 24,000    | 41.38  | 993,120.00    |  |
| SANOFI                               | 248,300   | 87.85  | 21,813,155.00 |  |
| UCB SA                               | 26,300    | 76.48  | 2,011,424.00  |  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA                 | 82,000    | 16.53  | 1,355,460.00  |  |
| AIB GROUP PLC                        | 230,000   | 3.98   | 916,780.00    |  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. | 1,311,000 | 7.01   | 9,190,110.00  |  |
| BANCO SANTANDER SA                   | 3,680,000 | 3.55   | 13,078,720.00 |  |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC            | 225,000   | 9.81   | 2,208,150.00  |  |
| BNP PARIBAS                          | 241,100   | 65.80  | 15,864,380.00 |  |
| CAIXABANK                            | 950,000   | 4.08   | 3,880,750.00  |  |
| COMMERZBANK AG                       | 236,000   | 11.50  | 2,714,000.00  |  |
| CREDIT AGRICOLE SA                   | 265,000   | 11.80  | 3,127,000.00  |  |
| ERSTE GROUP BANK AG                  | 76,000    | 36.42  | 2,767,920.00  |  |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA          | 129,000   | 16.94  | 2,185,905.00  |  |
| ING GROEP NV                         | 826,000   | 13.26  | 10,959,368.00 |  |
| INTESA SANPAOLO                      | 3,670,000 | 2.55   | 9,362,170.00  |  |
| KBC GROEP NV                         | 55,600    | 71.58  | 3,979,848.00  |  |
| MEDIOBANCA S.P.A.                    | 124,000   | 10.28  | 1,274,720.00  |  |
| SOCIETE GENERALE                     | 175,000   | 28.00  | 4,900,000.00  |  |
| UNICREDIT SPA                        | 420,000   | 19.42  | 8,158,920.00  |  |
| EURAZEO SE                           | 10,700    | 64.85  | 693,895.00    |  |
| EXOR NV                              | 24,300    | 76.72  | 1,864,296.00  |  |
| GROUPE BRUXELLES LAM                 | 21,400    | 80.10  | 1,714,140.00  |  |
| SOFINA SA                            | 3,700     | 236.40 | 874,680.00    |  |
| WENDEL                               | 6,000     | 101.60 | 609,600.00    |  |
| AEGON NV                             | 410,000   | 5.21   | 2,139,380.00  |  |
| AGEAS                                | 36,000    | 43.85  | 1,578,600.00  |  |
| ALLIANZ SE-REG                       | 88,500    | 221.05 | 19,562,925.00 |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI               | 242,000   | 18.30  | 4,429,810.00  |  |
| AXA SA                               | 410,000   | 28.30  | 11,603,000.00 |  |
| HANNOVER RUECK SE                    | 13,000    | 181.25 | 2,356,250.00  |  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG           | 30,700    | 329.10 | 10,103,370.00 |  |
| NN GROUP NV                          | 59,000    | 40.93  | 2,414,870.00  |  |

|                                   |           |          |               |  |
|-----------------------------------|-----------|----------|---------------|--|
| POSTE ITALIANE SPA                | 120,000   | 10.23    | 1,227,600.00  |  |
| SAMPO OYJ-A SHS                   | 106,000   | 45.76    | 4,850,560.00  |  |
| ADYEN NV                          | 4,780     | 1,461.60 | 6,986,448.00  |  |
| AMADEUS IT GROUP SA               | 99,500    | 57.76    | 5,747,120.00  |  |
| BECHTLE AG                        | 15,700    | 40.89    | 641,973.00    |  |
| CAPGEMINI SA                      | 35,800    | 188.55   | 6,750,090.00  |  |
| EDENRED                           | 53,500    | 52.14    | 2,789,490.00  |  |
| NEXI SPA                          | 130,000   | 7.87     | 1,023,880.00  |  |
| WORLDLINE SA                      | 54,000    | 41.86    | 2,260,440.00  |  |
| DASSAULT SYSTEMES SE              | 147,000   | 38.29    | 5,629,365.00  |  |
| NEMETSCHEK SE                     | 11,000    | 51.74    | 569,140.00    |  |
| SAP SE                            | 227,300   | 111.00   | 25,230,300.00 |  |
| NOKIA OYJ                         | 1,180,000 | 4.44     | 5,249,820.00  |  |
| ASM INTERNATIONAL NV              | 10,300    | 327.05   | 3,368,615.00  |  |
| ASML HOLDING NV                   | 88,470    | 623.00   | 55,116,810.00 |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 282,000   | 36.09    | 10,177,380.00 |  |
| STMICROELECTRONICS NV             | 151,000   | 46.54    | 7,027,540.00  |  |
| CELLNEX TELECOM SA                | 118,000   | 37.91    | 4,473,380.00  |  |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG              | 709,000   | 20.52    | 14,548,680.00 |  |
| ELISA OYJ                         | 31,700    | 52.52    | 1,664,884.00  |  |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL      | 72,000    | 10.37    | 747,000.00    |  |
| KONINKLIJKE KPN NV                | 730,000   | 3.19     | 2,330,890.00  |  |
| ORANGE SA                         | 435,000   | 10.61    | 4,617,960.00  |  |
| TELECOM ITALIA SPA                | 1,930,000 | 0.30     | 590,194.00    |  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 210,000   | 2.81     | 590,100.00    |  |
| TELEFONICA SA                     | 1,140,000 | 3.77     | 4,298,940.00  |  |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE      | 25,000    | 20.90    | 522,500.00    |  |
| ACCIONA S.A.                      | 5,800     | 183.30   | 1,063,140.00  |  |
| ELECTRICITE DE FRANCE             | 128,000   | 11.86    | 1,518,080.00  |  |
| ELIA GROUP SA/NV                  | 6,626     | 129.00   | 854,754.00    |  |
| ENDESA S.A.                       | 65,000    | 18.71    | 1,216,475.00  |  |
| ENEL SPA                          | 1,769,000 | 5.37     | 9,506,606.00  |  |
| ENERGIAS DE PORTUGAL              | 588,000   | 4.63     | 2,725,968.00  |  |
| FORTUM OYJ                        | 100,000   | 14.43    | 1,443,000.00  |  |
| IBERDROLA SA                      | 1,333,358 | 10.83    | 14,440,267.14 |  |

|                                         |         |        |                  |  |
|-----------------------------------------|---------|--------|------------------|--|
| RED ELECTRICA CORPORACION SA            | 89,000  | 16.17  | 1,439,130.00     |  |
| TERNA SPA                               | 301,000 | 7.37   | 2,220,778.00     |  |
| VERBUND AG                              | 14,500  | 79.75  | 1,156,375.00     |  |
| ENAGAS SA                               | 48,000  | 16.80  | 806,640.00       |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA                 | 32,000  | 26.37  | 843,840.00       |  |
| SNAM SPA                                | 460,000 | 4.79   | 2,204,780.00     |  |
| E.ON SE                                 | 488,000 | 9.99   | 4,875,120.00     |  |
| ENGIE                                   | 396,000 | 13.37  | 5,296,104.00     |  |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                    | 141,000 | 28.55  | 4,025,550.00     |  |
| AMUNDI SA                               | 12,800  | 63.25  | 809,600.00       |  |
| DEUTSCHE BANK AG-REG                    | 446,000 | 11.86  | 5,289,560.00     |  |
| DEUTSCHE BOERSE AG                      | 41,500  | 171.15 | 7,102,725.00     |  |
| EURONEXT NV                             | 18,000  | 77.58  | 1,396,440.00     |  |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES<br>S A | 14,000  | 37.30  | 522,200.00       |  |
| EDP RENOVAVEIS SA                       | 66,000  | 20.04  | 1,322,640.00     |  |
| RWE AG                                  | 138,000 | 39.11  | 5,397,180.00     |  |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE                  | 30,600  | 68.06  | 2,082,636.00     |  |
| QIAGEN N.V.                             | 47,900  | 44.73  | 2,142,567.00     |  |
| SARTORIUS AG-VORZUG                     | 5,100   | 434.10 | 2,213,910.00     |  |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH                | 6,000   | 334.00 | 2,004,000.00     |  |
| BUREAU VERITAS SA                       | 61,000  | 26.24  | 1,600,640.00     |  |
| RANDSTAD NV                             | 25,500  | 58.82  | 1,499,910.00     |  |
| TELEPERFORMANCE                         | 12,500  | 262.60 | 3,282,500.00     |  |
| WOLTERS KLUWER                          | 56,500  | 104.60 | 5,909,900.00     |  |
| AROUNDTOWN SA                           | 206,000 | 2.51   | 517,060.00       |  |
| LEG IMMOBILIEN SE                       | 17,000  | 70.40  | 1,196,800.00     |  |
| VONOVIA SE                              | 158,000 | 25.28  | 3,994,240.00     |  |
| PUBLICIS GROUPE                         | 49,800  | 75.14  | 3,741,972.00     |  |
| VIVENDI SE                              | 164,000 | 9.80   | 1,607,856.00     |  |
| BOLLORE SE                              | 202,000 | 5.15   | 1,040,300.00     |  |
| UBISOFT ENTERTAINMENT                   | 17,300  | 19.68  | 340,550.50       |  |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV                | 154,000 | 22.80  | 3,511,200.00     |  |
| SCOUT24 SE                              | 17,900  | 53.04  | 949,416.00       |  |
| 小計 銘柄数：222                              |         |        | 1,045,881,746.23 |  |

|     |                                   |           |        |                   |  |
|-----|-----------------------------------|-----------|--------|-------------------|--|
|     |                                   |           |        | (149,770,266,060) |  |
|     | 組入時価比率：10.1%                      |           |        | 10.4%             |  |
| 英債券 | BP PLC                            | 4,095,000 | 5.67   | 23,243,220.00     |  |
|     | SHELL PLC-NEW                     | 1,581,000 | 25.87  | 40,908,375.00     |  |
|     | CRODA INTERNATIONAL PLC           | 31,100    | 69.82  | 2,171,402.00      |  |
|     | JOHNSON MATTHEY PLC               | 40,000    | 22.45  | 898,000.00        |  |
|     | ANGLO AMERICAN PLC                | 279,000   | 32.61  | 9,099,585.00      |  |
|     | ANTOFAGASTA PLC                   | 89,000    | 17.21  | 1,532,135.00      |  |
|     | GLENCORE PLC                      | 2,122,000 | 5.07   | 10,767,028.00     |  |
|     | RIO TINTO PLC-REG                 | 245,900   | 61.39  | 15,095,801.00     |  |
|     | MONDI PLC                         | 101,000   | 14.89  | 1,504,395.00      |  |
|     | BAE SYSTEMS PLC                   | 677,000   | 8.88   | 6,011,760.00      |  |
|     | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          | 1,850,000 | 1.13   | 2,105,300.00      |  |
|     | DCC PLC                           | 21,200    | 45.93  | 973,716.00        |  |
|     | MELROSE INDUSTRIES PLC            | 870,000   | 1.44   | 1,254,540.00      |  |
|     | SMITHS GROUP PLC                  | 80,000    | 17.77  | 1,422,000.00      |  |
|     | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC      | 15,500    | 121.15 | 1,877,825.00      |  |
|     | ASHTED GROUP PLC                  | 94,600    | 57.32  | 5,422,472.00      |  |
|     | BUNZLE                            | 71,000    | 30.72  | 2,181,120.00      |  |
|     | RENTOKIL INTIAL PLC               | 554,000   | 5.10   | 2,825,400.00      |  |
|     | BARRATT DEVELOPMENTS PLC          | 207,000   | 4.67   | 967,104.00        |  |
|     | PERSIMMON PLC                     | 64,000    | 14.31  | 916,160.00        |  |
|     | TAYLOR WIMPEY PLC                 | 710,000   | 1.21   | 860,520.00        |  |
|     | THE BERKELEY GRP HOLDINGS         | 24,300    | 41.73  | 1,014,039.00      |  |
|     | BURBERRY GROUP PLC                | 82,000    | 25.33  | 2,077,060.00      |  |
|     | COMPASS GROUP PLC                 | 381,000   | 19.09  | 7,273,290.00      |  |
|     | ENTAIN PLC                        | 132,000   | 13.94  | 1,840,080.00      |  |
|     | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 41,300    | 56.70  | 2,341,710.00      |  |
|     | WHITBREAD PLC                     | 46,000    | 31.47  | 1,447,620.00      |  |
|     | NEXT PLC                          | 28,600    | 68.40  | 1,956,240.00      |  |
|     | JD SPORTS FASHION PLC             | 610,000   | 1.83   | 1,116,605.00      |  |
|     | KINGFISHER PLC                    | 450,000   | 2.81   | 1,268,550.00      |  |
|     | OCADO GROUP PLC                   | 122,000   | 6.31   | 769,820.00        |  |
|     | SAINSBURY                         | 410,000   | 2.64   | 1,085,680.00      |  |
|     | TESCO PLC                         | 1,610,000 | 2.50   | 4,026,610.00      |  |

|                              |            |        |               |  |
|------------------------------|------------|--------|---------------|--|
| COCA-COLA HBC AG-DI          | 46,000     | 20.67  | 950,820.00    |  |
| DIAGEO PLC                   | 498,000    | 35.93  | 17,895,630.00 |  |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 79,000     | 19.35  | 1,528,650.00  |  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 463,000    | 31.28  | 14,482,640.00 |  |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 196,000    | 19.78  | 3,877,860.00  |  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC  | 155,600    | 57.30  | 8,915,880.00  |  |
| HALEON PLC                   | 1,080,000  | 3.31   | 3,578,040.00  |  |
| UNILEVER PLC                 | 554,300    | 42.31  | 23,452,433.00 |  |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 182,000    | 11.56  | 2,104,830.00  |  |
| NMC HEALTH PLC               | 13,300     | 0.00   | 6.65          |  |
| ASTRAZENECA PLC              | 337,280    | 113.62 | 38,321,753.60 |  |
| GSK PLC                      | 890,000    | 14.55  | 12,949,500.00 |  |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC    | 37,000     | 17.75  | 656,750.00    |  |
| BARCLAYS PLC                 | 3,450,000  | 1.74   | 6,025,770.00  |  |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 4,346,000  | 6.18   | 26,875,664.00 |  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 14,980,000 | 0.52   | 7,930,412.00  |  |
| NATWEST GROUP PLC            | 1,180,000  | 3.05   | 3,606,080.00  |  |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 534,000    | 7.59   | 4,054,128.00  |  |
| M&G PLC                      | 500,000    | 2.00   | 1,000,000.00  |  |
| ADMIRAL GROUP PLC            | 42,000     | 22.31  | 937,020.00    |  |
| AVIVA PLC                    | 610,000    | 4.47   | 2,731,580.00  |  |
| LEGAL & GENERAL              | 1,270,000  | 2.59   | 3,295,650.00  |  |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC   | 170,000    | 6.35   | 1,079,500.00  |  |
| PRUDENTIAL PLC               | 599,000    | 13.10  | 7,846,900.00  |  |
| SAGE GROUP PLC (THE)         | 220,000    | 7.68   | 1,691,360.00  |  |
| HALMA PLC                    | 83,000     | 22.60  | 1,875,800.00  |  |
| BT GROUP PLC                 | 1,510,000  | 1.42   | 2,147,975.00  |  |
| VODAFONE GROUP PLC           | 5,780,000  | 1.01   | 5,867,856.00  |  |
| SSE PLC                      | 232,000    | 17.32  | 4,018,240.00  |  |
| NATIONAL GRID PLC            | 804,000    | 10.48  | 8,429,940.00  |  |
| SEVERN TRENT PLC             | 53,000     | 27.57  | 1,461,210.00  |  |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC   | 151,000    | 10.35  | 1,563,605.00  |  |
| 3I GROUP PLC                 | 213,000    | 16.41  | 3,495,330.00  |  |
| ABRDN PLC                    | 500,000    | 2.16   | 1,080,000.00  |  |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC      | 82,000     | 8.66   | 710,448.00    |  |

|        |                                 |         |            |                  |  |
|--------|---------------------------------|---------|------------|------------------|--|
|        | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 72,000  | 76.96      | 5,541,120.00     |  |
|        | SCHRODERS PLC                   | 141,176 | 5.00       | 707,009.40       |  |
|        | ST JAMES S PLACE PLC            | 118,000 | 12.53      | 1,479,130.00     |  |
|        | PEARSON                         | 143,000 | 9.15       | 1,308,736.00     |  |
|        | EXPERIAN PLC                    | 198,000 | 30.05      | 5,949,900.00     |  |
|        | INTERTEK GROUP PLC              | 35,000  | 44.97      | 1,573,950.00     |  |
|        | RELX PLC                        | 421,000 | 24.84      | 10,457,640.00    |  |
|        | INFORMA PLC                     | 326,000 | 6.76       | 2,203,760.00     |  |
|        | WPP PLC                         | 235,000 | 10.03      | 2,358,225.00     |  |
|        | AUTO TRADER GROUP PLC           | 195,000 | 6.08       | 1,186,380.00     |  |
| 小計     | 銘柄数：78                          |         |            | 417,460,273.65   |  |
|        |                                 |         |            | (67,119,262,797) |  |
|        | 組入時価比率：4.5%                     |         |            | 4.7%             |  |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG                 | 41,000  | 15.95      | 653,950.00       |  |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG       | 1,630   | 723.50     | 1,179,305.00     |  |
|        | GIVAUDAN-REG                    | 2,040   | 2,895.00   | 5,905,800.00     |  |
|        | SIKA AG-REG                     | 31,800  | 264.00     | 8,395,200.00     |  |
|        | HOLCIM LTD                      | 122,100 | 56.64      | 6,915,744.00     |  |
|        | SIG GROUP AG                    | 66,000  | 22.22      | 1,466,520.00     |  |
|        | GEBERIT AG-REG                  | 7,960   | 516.80     | 4,113,728.00     |  |
|        | ABB LTD                         | 339,000 | 31.52      | 10,685,280.00    |  |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG        | 4,900   | 192.00     | 940,800.00       |  |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT     | 8,500   | 200.50     | 1,704,250.00     |  |
|        | VAT GROUP AG                    | 6,000   | 289.20     | 1,735,200.00     |  |
|        | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG      | 11,700  | 243.40     | 2,847,780.00     |  |
|        | CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A   | 113,200 | 146.60     | 16,595,120.00    |  |
|        | THE SWATCH GROUP AG-B           | 6,200   | 329.70     | 2,044,140.00     |  |
|        | THE SWATCH GROUP AG-REG         | 10,500  | 60.60      | 636,300.00       |  |
|        | BARRY CALLEBAUT AG              | 810     | 1,935.00   | 1,567,350.00     |  |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC      | 227     | 10,280.00  | 2,333,560.00     |  |
|        | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG     | 24      | 103,300.00 | 2,479,200.00     |  |
|        | NESTLE SA-REG                   | 598,500 | 107.90     | 64,578,150.00    |  |
|        | ALCON INC                       | 107,300 | 69.22      | 7,427,306.00     |  |
|        | SONOVA HOLDING AG-REG           | 11,600  | 241.00     | 2,795,600.00     |  |
|        | STRAUMANN HOLDING AG-REG        | 24,000  | 132.20     | 3,172,800.00     |  |
|        |                                 | 470,800 | 79.36      | 37,362,688.00    |  |

|               |                              |         |          |                  |  |
|---------------|------------------------------|---------|----------|------------------|--|
|               | NOVARTIS AG-REG              |         |          |                  |  |
|               | ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 152,900 | 275.30   | 42,093,370.00    |  |
|               | ROCHE HOLDINGS AG-BEARER     | 6,000   | 293.60   | 1,761,600.00     |  |
|               | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 6,500   | 83.90    | 545,350.00       |  |
|               | BALOISE HOLDING AG           | 9,900   | 152.30   | 1,507,770.00     |  |
|               | SWISS LIFE HOLDING AG        | 6,800   | 551.00   | 3,746,800.00     |  |
|               | SWISS RE LTD                 | 64,900  | 96.16    | 6,240,784.00     |  |
|               | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 32,900  | 438.60   | 14,429,940.00    |  |
|               | TEMENOS AG-REG               | 13,700  | 69.76    | 955,712.00       |  |
|               | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 37,600  | 54.20    | 2,037,920.00     |  |
|               | SWISSCOM AG-REG              | 5,690   | 568.60   | 3,235,334.00     |  |
|               | BKW AG                       | 4,600   | 132.50   | 609,500.00       |  |
|               | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG   | 789,999 | 2.79     | 2,211,207.20     |  |
|               | JULIUS BAER GROUP LTD        | 46,300  | 61.86    | 2,864,118.00     |  |
|               | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 4,820   | 932.80   | 4,496,096.00     |  |
|               | UBS GROUP AG                 | 733,000 | 20.41    | 14,960,530.00    |  |
|               | BACHEM HOLDING AG-REG B      | 7,900   | 86.20    | 680,980.00       |  |
|               | LONZA AG-REG                 | 16,360  | 555.00   | 9,079,800.00     |  |
|               | ADECCO GROUP AG-REG          | 33,000  | 34.79    | 1,148,070.00     |  |
|               | SGS SA-REG                   | 1,350   | 2,203.00 | 2,974,050.00     |  |
|               | SWISS PRIME SITE-REG         | 17,500  | 82.15    | 1,437,625.00     |  |
| 小計            | 銘柄数：43                       |         |          | 304,552,327.20   |  |
|               |                              |         |          | (44,117,450,118) |  |
|               | 組入時価比率：3.0%                  |         |          | 3.1%             |  |
| スウェーデン<br>ローナ | BOLIDEN AB                   | 59,000  | 446.20   | 26,325,800.00    |  |
|               | HOLMEN AB-B SHARES           | 19,000  | 429.20   | 8,154,800.00     |  |
|               | SVENSKA CELLULOSA AB-B       | 137,000 | 150.70   | 20,645,900.00    |  |
|               | ASSA ABLOY AB-B              | 218,000 | 256.20   | 55,851,600.00    |  |
|               | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 338,000 | 125.30   | 42,351,400.00    |  |
|               | SKANSKA AB-B SHS             | 77,000  | 194.05   | 14,941,850.00    |  |
|               | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 33,000  | 234.80   | 7,748,400.00     |  |
|               | LIFCO AB-B SHS               | 52,000  | 218.60   | 11,367,200.00    |  |
|               | ALFA LAVAL AB                | 63,000  | 355.00   | 22,365,000.00    |  |
|               | ATLAS COPCO AB-A SHS         | 577,000 | 126.08   | 72,748,160.00    |  |
|               | ATLAS COPCO AB-B SHS         | 334,000 | 111.24   | 37,154,160.00    |  |

|                                  |         |          |                  |  |
|----------------------------------|---------|----------|------------------|--|
| EPIROC AB - A                    | 141,000 | 205.70   | 29,003,700.00    |  |
| EPIROC AB - B                    | 89,000  | 176.90   | 15,744,100.00    |  |
| HUSQVARNA AB-B SHS               | 94,000  | 92.74    | 8,717,560.00     |  |
| INDUTRADE AB                     | 55,000  | 238.20   | 13,101,000.00    |  |
| SANDVIK AB                       | 229,000 | 219.30   | 50,219,700.00    |  |
| SKF AB-B SHARES                  | 78,000  | 201.70   | 15,732,600.00    |  |
| VOLVO AB-A SHS                   | 40,000  | 218.00   | 8,720,000.00     |  |
| VOLVO AB-B SHS                   | 330,000 | 208.60   | 68,838,000.00    |  |
| SECURITAS AB-B SHS               | 110,857 | 92.56    | 10,260,923.92    |  |
| VOLVO CAR AB-B                   | 120,000 | 51.70    | 6,204,000.00     |  |
| ELECTROLUX AB-B                  | 53,000  | 128.30   | 6,799,900.00     |  |
| EVOLUTION AB                     | 40,600  | 1,325.00 | 53,795,000.00    |  |
| HENNES&MAURITZ AB-B              | 162,000 | 129.22   | 20,933,640.00    |  |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B              | 132,000 | 274.30   | 36,207,600.00    |  |
| GETINGE AB-B SHS                 | 53,000  | 234.20   | 12,412,600.00    |  |
| SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB      | 36,000  | 236.80   | 8,524,800.00     |  |
| NORDEA BANK ABP                  | 725,000 | 128.80   | 93,380,000.00    |  |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 349,000 | 128.10   | 44,706,900.00    |  |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A          | 320,000 | 108.00   | 34,560,000.00    |  |
| SWEDBANK AB                      | 197,000 | 209.00   | 41,173,000.00    |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS          | 31,000  | 289.90   | 8,986,900.00     |  |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS          | 32,000  | 288.70   | 9,238,400.00     |  |
| INVESTOR AB-A SHS                | 105,000 | 210.70   | 22,123,500.00    |  |
| INVESTOR AB-B SHS                | 401,000 | 205.00   | 82,205,000.00    |  |
| KINNEVIK AB - B                  | 56,000  | 165.70   | 9,279,200.00     |  |
| LUNDBERGS AB-B SHS               | 15,500  | 494.50   | 7,664,750.00     |  |
| ERICSSON LM-B                    | 620,000 | 60.91    | 37,764,200.00    |  |
| HEXAGON AB-B SHS                 | 431,000 | 119.80   | 51,633,800.00    |  |
| TELIA CO AB                      | 580,000 | 26.38    | 15,300,400.00    |  |
| TELE 2 AB-B SHS                  | 116,000 | 93.00    | 10,788,000.00    |  |
| EQT AB                           | 68,000  | 250.00   | 17,000,000.00    |  |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS      | 141,000 | 54.55    | 7,691,550.00     |  |
| SAGAX AB-B                       | 40,000  | 259.80   | 10,392,000.00    |  |
| EMBRACER GROUP AB                | 134,000 | 58.75    | 7,872,500.00     |  |
| 小計銘柄数：45                         |         |          | 1,196,629,493.92 |  |

|               |                           |         |           |                                   |  |
|---------------|---------------------------|---------|-----------|-----------------------------------|--|
|               |                           |         |           | (15,364,722,701)                  |  |
|               | 組入時価比率：1.0%               |         |           | 1.1%                              |  |
| ノルウェーク<br>ローネ | AKER BP ASA               | 72,000  | 284.80    | 20,505,600.00                     |  |
|               | EQUINOR ASA               | 206,000 | 326.00    | 67,156,000.00                     |  |
|               | YARA INTERNATIONAL ASA    | 37,000  | 467.10    | 17,282,700.00                     |  |
|               | NORSK HYDRO               | 291,000 | 77.26     | 22,482,660.00                     |  |
|               | KONGSBERG GRUPPEN ASA     | 21,000  | 425.00    | 8,925,000.00                      |  |
|               | MOWI ASA                  | 84,000  | 174.80    | 14,683,200.00                     |  |
|               | ORKLA ASA                 | 153,000 | 69.90     | 10,694,700.00                     |  |
|               | SALMAR ASA                | 16,000  | 430.60    | 6,889,600.00                      |  |
|               | DNB BANK ASA              | 205,000 | 198.35    | 40,661,750.00                     |  |
|               | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 40,000  | 184.50    | 7,380,000.00                      |  |
|               | TELENOR ASA               | 146,000 | 116.10    | 16,950,600.00                     |  |
|               | ADEVINTA ASA              | 63,000  | 87.70     | 5,525,100.00                      |  |
|               | 小計 銘柄数：12                 |         |           | 239,136,910.00<br>(3,125,519,413) |  |
|               | 組入時価比率：0.2%               |         |           | 0.2%                              |  |
| デンマークク<br>ローネ | CHR HANSEN HOLDING A/S    | 23,500  | 502.80    | 11,815,800.00                     |  |
|               | NOVOZYMES A/S-B SHARES    | 44,500  | 351.30    | 15,632,850.00                     |  |
|               | ROCKWOOL A/S-B SHS        | 1,700   | 1,729.50  | 2,940,150.00                      |  |
|               | VESTAS WIND SYSTEMS A/S   | 221,000 | 206.55    | 45,647,550.00                     |  |
|               | DSV A/S                   | 40,600  | 1,286.00  | 52,211,600.00                     |  |
|               | A P MOLLER - MAERSK A/S-A | 720     | 15,340.00 | 11,044,800.00                     |  |
|               | AP MOLLER-MAERSK A/S-B    | 1,090   | 15,570.00 | 16,971,300.00                     |  |
|               | PANDORA A/S               | 20,000  | 670.40    | 13,408,000.00                     |  |
|               | CARLSBERG B               | 21,800  | 988.00    | 21,538,400.00                     |  |
|               | COLOPLAST-B               | 25,900  | 812.80    | 21,051,520.00                     |  |
|               | DEMANT A/S                | 20,100  | 222.90    | 4,480,290.00                      |  |
|               | GENMAB A/S                | 14,400  | 2,747.00  | 39,556,800.00                     |  |
|               | NOVO NORDISK A/S-B        | 360,300 | 969.50    | 349,310,850.00                    |  |
|               | DANSKE BANK AS            | 148,000 | 152.90    | 22,629,200.00                     |  |
|               | TRYG A/S                  | 76,000  | 155.45    | 11,814,200.00                     |  |
|               | ORSTED A/S                | 41,000  | 628.20    | 25,756,200.00                     |  |
|               | 小計 銘柄数：16                 |         |           | 665,809,510.00                    |  |

|     |                               |           |        |                  |  |
|-----|-------------------------------|-----------|--------|------------------|--|
|     |                               |           |        | (12,796,858,782) |  |
|     | 組入時価比率：0.9%                   |           |        | 0.9%             |  |
| 豪ドル | AMPOL LTD                     | 49,000    | 31.92  | 1,564,080.00     |  |
|     | SANTOS LTD.                   | 710,000   | 7.01   | 4,977,100.00     |  |
|     | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON  | 48,000    | 29.26  | 1,404,480.00     |  |
|     | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD     | 413,000   | 35.00  | 14,455,000.00    |  |
|     | ORICA LTD                     | 99,000    | 15.95  | 1,579,050.00     |  |
|     | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC   | 101,000   | 32.49  | 3,281,490.00     |  |
|     | BHP GROUP LIMITED             | 1,103,000 | 48.12  | 53,076,360.00    |  |
|     | BLUESCOPE STEEL LTD           | 104,000   | 19.74  | 2,052,960.00     |  |
|     | FORTESCUE METALS GROUP LTD    | 371,000   | 22.32  | 8,280,720.00     |  |
|     | IGO LTD                       | 150,000   | 14.05  | 2,107,500.00     |  |
|     | MINERAL RESOURCES LTD         | 37,500    | 86.67  | 3,250,125.00     |  |
|     | NEWCREST MINING               | 191,000   | 23.90  | 4,564,900.00     |  |
|     | NORTHERN STAR RESOURCES LTD   | 257,000   | 11.38  | 2,924,660.00     |  |
|     | PILBARA MINERALS LTD          | 540,000   | 4.69   | 2,532,600.00     |  |
|     | RIO TINTO LTD                 | 81,800    | 123.68 | 10,117,024.00    |  |
|     | SOUTH32 LTD                   | 1,010,000 | 4.66   | 4,706,600.00     |  |
|     | REECE LTD                     | 49,000    | 17.25  | 845,250.00       |  |
|     | BRAMBLES LTD                  | 295,000   | 12.22  | 3,604,900.00     |  |
|     | QANTAS AIRWAYS LIMITED        | 220,000   | 6.57   | 1,445,400.00     |  |
|     | AURIZON HOLDINGS LTD          | 380,000   | 3.46   | 1,314,800.00     |  |
|     | TRANSURBAN GROUP              | 666,000   | 14.15  | 9,423,900.00     |  |
|     | ARISTOCRAT LEISURE LTD        | 134,000   | 36.35  | 4,870,900.00     |  |
|     | LOTTERY CORP LTD/THE          | 480,000   | 5.06   | 2,428,800.00     |  |
|     | WESFARMERS LIMITED            | 249,000   | 51.32  | 12,778,680.00    |  |
|     | COLES GROUP LTD               | 293,000   | 18.24  | 5,344,320.00     |  |
|     | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA | 330,000   | 6.91   | 2,280,300.00     |  |
|     | WOOLWORTHS GROUP LTD          | 263,000   | 36.49  | 9,596,870.00     |  |
|     | TREASURY WINE ESTATES LTD     | 156,000   | 13.84  | 2,159,040.00     |  |
|     | COCHLEAR LTD                  | 14,100    | 226.62 | 3,195,342.00     |  |
|     | RAMSAY HEALTH CARE LTD        | 41,000    | 66.85  | 2,740,850.00     |  |
|     | SONIC HEALTHCARE LTD          | 99,000    | 33.20  | 3,286,800.00     |  |
|     | CSL LIMITED                   | 104,400   | 302.99 | 31,632,156.00    |  |
|     | ANZ GROUP HOLDINGS LTD        | 656,000   | 24.92  | 16,347,520.00    |  |

|            |                                          |         |        |                  |  |
|------------|------------------------------------------|---------|--------|------------------|--|
|            | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA           | 370,300 | 101.50 | 37,585,450.00    |  |
|            | NATIONAL AUSTRALIA BANK                  | 688,000 | 30.51  | 20,990,880.00    |  |
|            | WESTPAC BANKING CORP                     | 767,000 | 22.76  | 17,456,920.00    |  |
|            | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD            | 540,000 | 4.78   | 2,581,200.00     |  |
|            | MEDIBANK PRIVATE LTD                     | 590,000 | 3.08   | 1,817,200.00     |  |
|            | QBE INSURANCE                            | 332,000 | 13.40  | 4,448,800.00     |  |
|            | SUNCORP GROUP LTD                        | 268,000 | 12.80  | 3,430,400.00     |  |
|            | COMPUTERSHARE LTD                        | 113,000 | 23.26  | 2,628,380.00     |  |
|            | WISETECH GLOBAL LTD                      | 33,000  | 58.62  | 1,934,460.00     |  |
|            | XERO LIMITED                             | 28,300  | 82.41  | 2,332,203.00     |  |
|            | TELSTRA GROUP LTD                        | 850,000 | 4.22   | 3,587,000.00     |  |
|            | ORIGIN ENERGY LTD                        | 370,000 | 6.88   | 2,545,600.00     |  |
|            | APA GROUP                                | 257,000 | 10.78  | 2,770,460.00     |  |
|            | ASX LTD                                  | 41,500  | 70.25  | 2,915,375.00     |  |
|            | MACQUARIE GROUP LIMITED                  | 79,200  | 194.11 | 15,373,512.00    |  |
|            | IDP EDUCATION LTD                        | 46,000  | 31.56  | 1,451,760.00     |  |
|            | REA GROUP LTD                            | 12,500  | 128.58 | 1,607,250.00     |  |
|            | SEEK LTD                                 | 70,000  | 25.26  | 1,768,200.00     |  |
| 小計         | 銘柄数：51                                   |         |        | 361,395,527.00   |  |
|            |                                          |         |        | (33,320,667,589) |  |
|            | 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 | 8.75   | 2,362,500.00     |  |
|            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L | 127,000 | 26.22  | 3,329,940.00     |  |
|            | SPARK NEW ZEALAND LTD                    | 430,000 | 5.28   | 2,270,400.00     |  |
|            | MERCURY NZ LTD                           | 137,000 | 6.45   | 883,650.00       |  |
|            | MERIDIAN ENERGY LTD                      | 300,000 | 5.49   | 1,647,000.00     |  |
|            | 小計 銘柄数：5                                 |         |        | 10,493,490.00    |  |
|            |                                          |         |        | (880,193,941)    |  |
|            | 組入時価比率：0.1%                              |         |        | 0.1%             |  |
| 香港ドル       | XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD              | 430,000 | 15.30  | 6,579,000.00     |  |
|            | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD                | 584,040 | 47.90  | 27,975,516.00    |  |
|            | TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED    | 304,000 | 103.10 | 31,342,400.00    |  |
|            | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS              | 280,000 | 16.80  | 4,704,000.00     |  |
|            | MTR CORP                                 | 340,000 | 40.35  | 13,719,000.00    |  |

|        |    |                                    |           |        |                  |  |
|--------|----|------------------------------------|-----------|--------|------------------|--|
|        |    | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L       | 466,000   | 52.50  | 24,465,000.00    |  |
|        |    | SANDS CHINA LTD                    | 512,000   | 29.05  | 14,873,600.00    |  |
|        |    | BUDWEISER BREWING CO APAC LT       | 350,000   | 23.55  | 8,242,500.00     |  |
|        |    | WH GROUP LIMITED                   | 1,759,806 | 4.62   | 8,130,303.72     |  |
|        |    | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         | 780,000   | 26.20  | 20,436,000.00    |  |
|        |    | HANG SENG BANK                     | 172,000   | 123.70 | 21,276,400.00    |  |
|        |    | AIA GROUP LTD                      | 2,598,000 | 85.20  | 221,349,600.00   |  |
|        |    | HKT TRUST AND HKT LTD              | 849,600   | 10.50  | 8,920,800.00     |  |
|        |    | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD     | 134,000   | 42.85  | 5,741,900.00     |  |
|        |    | CLP HLDGS                          | 366,000   | 56.70  | 20,752,200.00    |  |
|        |    | POWER ASSETS HOLDINGS LTD          | 310,000   | 42.90  | 13,299,000.00    |  |
|        |    | HONG KONG & CHINA GAS              | 2,410,383 | 7.60   | 18,318,910.80    |  |
|        |    | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 264,000   | 334.60 | 88,334,400.00    |  |
|        |    | CK ASSET HOLDINGS LTD              | 441,040   | 50.55  | 22,294,572.00    |  |
|        |    | ESR GROUP LTD                      | 440,000   | 14.54  | 6,397,600.00     |  |
|        |    | HANG LUNG PROPERTIES LTD           | 460,000   | 16.02  | 7,369,200.00     |  |
|        |    | HENDERSON LAND                     | 310,443   | 27.55  | 8,552,704.65     |  |
|        |    | NEW WORLD DEVELOPMENT              | 309,916   | 22.30  | 6,911,126.80     |  |
|        |    | SINO LAND CO.LTD                   | 730,000   | 10.30  | 7,519,000.00     |  |
|        |    | SUN HUNG KAI PROPERTIES            | 322,000   | 111.10 | 35,774,200.00    |  |
|        |    | SWIRE PACIFIC-A                    | 104,000   | 65.65  | 6,827,600.00     |  |
|        |    | SWIRE PROPERTIES LTD               | 230,000   | 21.10  | 4,853,000.00     |  |
|        |    | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT       | 350,000   | 43.85  | 15,347,500.00    |  |
|        | 小計 | 銘柄数：28                             |           |        | 680,307,033.97   |  |
|        |    |                                    |           |        | (11,646,856,421) |  |
|        |    | 組入時価比率：0.8%                        |           |        | 0.8%             |  |
| シンガポール |    | SINGAPORE TECH ENGINEERING         | 310,000   | 3.65   | 1,131,500.00     |  |
|        |    | JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD         | 21,000    | 28.61  | 600,810.00       |  |
|        |    | KEPPEL CORP.                       | 313,000   | 7.13   | 2,231,690.00     |  |
|        |    | SINGAPORE AIRLINES LTD             | 280,000   | 5.85   | 1,638,000.00     |  |
|        |    | GENTING SINGAPORE LTD              | 1,410,000 | 1.01   | 1,424,100.00     |  |
|        |    | WILMAR INTERNATIONAL LTD           | 440,000   | 3.97   | 1,746,800.00     |  |
|        |    | DBS GROUP HLDGS                    | 394,000   | 34.80  | 13,711,200.00    |  |
|        |    | OCBC-ORD                           | 740,000   | 13.00  | 9,620,000.00     |  |

|    |       |                                      |           |                     |                 |               |  |
|----|-------|--------------------------------------|-----------|---------------------|-----------------|---------------|--|
|    | 小計    | UNITED OVERSEAS BANK                 | 256,000   | 30.70               | 7,859,200.00    |               |  |
|    |       | VENTURE CORP LTD                     | 58,000    | 18.44               | 1,069,520.00    |               |  |
|    |       | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 1,790,000 | 2.47                | 4,421,300.00    |               |  |
|    |       | SINGAPORE EXCHANGE LTD               | 199,000   | 8.99                | 1,789,010.00    |               |  |
|    |       | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI         | 600,000   | 3.81                | 2,286,000.00    |               |  |
|    |       | CITY DEVELOPMENTS LTD                | 100,000   | 7.86                | 786,000.00      |               |  |
|    |       | UOL GROUP LIMITED                    | 87,000    | 6.85                | 595,950.00      |               |  |
|    |       | 銘柄数：15                               |           |                     | 50,911,080.00   |               |  |
|    |       |                                      |           |                     | (5,116,563,540) |               |  |
|    |       | 組入時価比率：0.3%                          |           |                     | 0.4%            |               |  |
|    | 新シェケル | ICL GROUP LTD                        | 157,000   | 26.76               | 4,201,320.00    |               |  |
|    |       | ELBIT SYSTEMS LTD                    | 5,900     | 578.00              | 3,410,200.00    |               |  |
|    |       | BANK HAPOLIM BM                      | 273,000   | 30.95               | 8,449,350.00    |               |  |
|    |       | BANK LEUMI LE-ISRAEL                 | 337,000   | 30.20               | 10,177,400.00   |               |  |
|    |       | ISRAEL DISCOUNT BANK-A               | 280,000   | 18.34               | 5,135,200.00    |               |  |
|    |       | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD             | 33,000    | 115.40              | 3,808,200.00    |               |  |
|    |       | NICE LTD                             | 13,800    | 784.40              | 10,824,720.00   |               |  |
|    |       | TOWER SEMICONDUCTOR LTD              | 22,000    | 145.20              | 3,194,400.00    |               |  |
|    |       | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO         | 470,000   | 5.49                | 2,580,300.00    |               |  |
|    |       | AZRIELI GROUP                        | 8,600     | 210.60              | 1,811,160.00    |               |  |
|    |       | 小計                                   | 銘柄数：10    |                     |                 | 53,592,250.00 |  |
|    |       |                                      |           |                     | (2,029,500,992) |               |  |
|    |       | 組入時価比率：0.1%                          |           |                     | 0.1%            |               |  |
| 合計 |       |                                      |           | 1,434,721,717,399   |                 |               |  |
|    |       |                                      |           | (1,434,721,717,399) |                 |               |  |

(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(2023年2月17日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄                           | 券面総額   | 評価額          | 備考 |
|------|-----|------------------------------|--------|--------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 34,000 | 5,508,340.00 |    |
|      |     | AMERICAN HOMES 4 RENT-A      | 67,000 | 2,244,500.00 |    |

|                              |         |               |                |
|------------------------------|---------|---------------|----------------|
| AMERICAN TOWER CORP          | 101,300 | 21,475,600.00 |                |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT    | 103,000 | 2,236,130.00  |                |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 30,700  | 5,529,684.00  |                |
| BOSTON PROPERTIES            | 33,600  | 2,398,032.00  |                |
| CAMDEN PROPERTY TRUST        | 21,500  | 2,581,075.00  |                |
| CROWN CASTLE INC             | 94,800  | 13,249,248.00 |                |
| DIGITAL REALTY TRUST INC     | 61,800  | 6,975,984.00  |                |
| EQUINIX INC                  | 19,940  | 14,400,468.60 |                |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 37,500  | 2,680,500.00  |                |
| EQUITY RESIDENTIAL           | 79,100  | 5,219,809.00  |                |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 14,300  | 3,390,244.00  |                |
| EXTRA SPACE STORAGE INC      | 29,700  | 4,717,548.00  |                |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 56,000  | 2,959,600.00  |                |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC  | 86,000  | 1,799,120.00  |                |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 114,000 | 2,959,440.00  |                |
| HOST HOTELS & RESORTS INC    | 158,000 | 2,741,300.00  |                |
| INVITATION HOMES INC         | 136,000 | 4,432,240.00  |                |
| IRON MOUNTAIN INC            | 62,000  | 3,295,920.00  |                |
| KIMCO REALTY CORP            | 133,000 | 2,808,960.00  |                |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 135,000 | 1,730,700.00  |                |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 25,000  | 4,200,000.00  |                |
| PROLOGIS INC                 | 200,912 | 25,272,720.48 |                |
| PUBLIC STORAGE               | 34,100  | 10,214,996.00 |                |
| REALTY INCOME CORP           | 135,700 | 8,998,267.00  |                |
| REGENCY CENTERS CORP         | 31,900  | 2,060,740.00  |                |
| SBA COMMUNICATIONS CORP      | 23,400  | 6,636,006.00  |                |
| SIMON PROPERTY GROUP INC     | 71,300  | 8,866,155.00  |                |
| SUN COMMUNITIES INC          | 27,000  | 4,262,760.00  |                |
| UDR INC                      | 73,000  | 3,282,810.00  |                |
| VENTAS INC                   | 87,000  | 4,428,300.00  |                |
| VICI PROPERTIES INC          | 208,000 | 7,090,720.00  |                |
| WELLTOWER INC                | 100,400 | 7,836,220.00  |                |
| WEYERHAEUSER CO              | 159,000 | 5,157,960.00  |                |
| WP CAREY INC                 | 41,600  | 3,498,976.00  |                |
| 小計                           | 銘柄数：36  | 2,826,552     | 217,141,073.08 |

|       |                              |           |                  |  |
|-------|------------------------------|-----------|------------------|--|
|       |                              |           | (29,183,760,221) |  |
|       | 組入時価比率：2.0%                  |           | 86.2%            |  |
| カナダドル | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 21,000    | 1,048,950.00     |  |
|       | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 28,000    | 620,480.00       |  |
| 小計    | 銘柄数：2                        | 49,000    | 1,669,430.00     |  |
|       |                              |           | (166,542,336)    |  |
|       | 組入時価比率：0.0%                  |           | 0.5%             |  |
| ユーロ   | COVIVIO                      | 11,300    | 712,465.00       |  |
|       | GECINA SA                    | 9,600     | 1,064,640.00     |  |
|       | KLEPIERRE                    | 49,000    | 1,161,790.00     |  |
|       | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 23,900    | 1,433,522.00     |  |
|       | WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 37,000    | 1,098,900.00     |  |
| 小計    | 銘柄数：5                        | 130,800   | 5,471,317.00     |  |
|       |                              |           | (783,492,594)    |  |
|       | 組入時価比率：0.1%                  |           | 2.3%             |  |
| 英ポンド  | BRITISH LAND                 | 183,000   | 820,023.00       |  |
|       | LAND SECURITIES GROUP PLC    | 152,000   | 1,066,736.00     |  |
|       | SEGRO PLC                    | 265,000   | 2,215,930.00     |  |
| 小計    | 銘柄数：3                        | 600,000   | 4,102,689.00     |  |
|       |                              |           | (659,630,337)    |  |
|       | 組入時価比率：0.0%                  |           | 1.9%             |  |
| 豪ドル   | DEXUS/AU                     | 219,000   | 1,920,630.00     |  |
|       | GOODMAN GROUP                | 366,000   | 7,404,180.00     |  |
|       | GPT GROUP                    | 440,000   | 2,090,000.00     |  |
|       | LENLEASE GROUP               | 135,000   | 1,085,400.00     |  |
|       | MIRVAC GROUP                 | 890,000   | 2,029,200.00     |  |
|       | SCENTRE GROUP                | 1,100,000 | 3,267,000.00     |  |
|       | STOCKLAND TRUST GROUP        | 540,000   | 2,127,600.00     |  |
|       | VICINITY CENTRES             | 800,000   | 1,672,000.00     |  |
| 小計    | 銘柄数：8                        | 4,490,000 | 21,596,010.00    |  |
|       |                              |           | (1,991,152,122)  |  |
|       | 組入時価比率：0.1%                  |           | 5.9%             |  |
| 香港ドル  | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS  | 470,000   | 2,368,800.00     |  |
|       | LINK REIT                    | 463,000   | 24,886,250.00    |  |
| 小計    | 銘柄数：2                        | 933,000   | 27,255,050.00    |  |
|       |                              |           | (466,606,456)    |  |

|  |          |                                        |           |                                    |  |
|--|----------|----------------------------------------|-----------|------------------------------------|--|
|  |          | 組入時価比率：0.0%                            |           | 1.4%                               |  |
|  | シンガポールドル | CAPITALAND ASCENDAS REIT               | 710,040   | 1,966,810.80                       |  |
|  |          | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 1,160,021 | 2,227,240.32                       |  |
|  |          | MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | 710,029   | 1,178,648.14                       |  |
|  |          | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST    | 490,000   | 828,100.00                         |  |
|  | 小計       | 銘柄数：4                                  | 3,070,090 | 6,200,799.26<br>(623,180,325)      |  |
|  |          | 組入時価比率：0.0%                            |           | 1.8%                               |  |
|  | 合計       |                                        |           | 33,874,364,391<br>(33,874,364,391) |  |

(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        | 2023年 2月17日現在  |       |                |             |
|-----------|----------------|-------|----------------|-------------|
|           | 契約額等（円）        |       | 時価（円）          | 評価損益（円）     |
|           |                | うち1年超 |                |             |
| 市場取引      |                |       |                |             |
| 株価指数先物取引  |                |       |                |             |
| 買建        | 18,917,450,335 | -     | 19,109,893,147 | 192,442,812 |
| 市場取引以外の取引 |                |       |                |             |
| 為替予約取引    |                |       |                |             |
| 買建        | 1,226,640,156  | -     | 1,232,660,535  | 6,020,379   |
| 米ドル       | 887,272,412    | -     | 893,275,215    | 6,002,803   |
| カナダドル     | 69,653,983     | -     | 69,796,020     | 142,037     |
| ユーロ       | 143,013,996    | -     | 143,155,700    | 141,704     |
| 英ポンド      | 80,613,500     | -     | 80,351,450     | 262,050     |
| 豪ドル       | 46,086,265     | -     | 46,082,150     | 4,115       |
| 合計        | -              | -     | -              | 198,463,191 |

（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）

(2023年 2月17日現在)

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| <b>資産の部</b>     |                 |
| 流動資産            |                 |
| 預金              | 2,355,537,371   |
| コール・ローン         | 1,008,335,478   |
| 国債証券            | 669,729,928,066 |
| 派生商品評価勘定        | 1,851,913       |
| 未収利息            | 6,120,437,039   |
| 前払費用            | 670,473,510     |
| その他未収収益         | 7,430,135       |
| 流動資産合計          | 679,893,993,512 |
| 資産合計            | 679,893,993,512 |
| <b>負債の部</b>     |                 |
| 流動負債            |                 |
| 未払金             | 696,813,642     |
| 未払解約金           | 589,223,205     |
| 未払利息            | 241             |
| その他未払費用         | 3,357,894       |
| 流動負債合計          | 1,289,394,982   |
| 負債合計            | 1,289,394,982   |
| <b>純資産の部</b>    |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 271,144,260,947 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 407,460,337,583 |
| 元本等合計           | 678,604,598,530 |
| 純資産合計           | 678,604,598,530 |
| 負債純資産合計         | 679,893,993,512 |

### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

## （貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額       |                  |
| 1口当たり純資産額                        | 2.5027円          |
| (10,000口当たり純資産額)                 | (25,027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       | 115,539,485,172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                             | 120,746,866,665円 |
| なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。         |                  |

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日 |                                                                                                            |
|--------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> |
| 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

| 2023年 2月17日現在                                           |  |
|---------------------------------------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                      |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |  |
| 2. 時価の算定方法                                              |  |
| 国債証券                                                    |  |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。                          |  |
| 派生商品評価勘定                                                |  |
| デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。                           |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務                                     |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |  |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年 2月17日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2022年 2月18日      |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 248,128,706,565円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 52,180,281,670円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 29,164,727,288円  |
| 期末元本額                            | 271,144,260,947円 |
| 期末元本額の内訳*                        |                  |
| バランスセレクト30                       | 81,143,935円      |
| バランスセレクト50                       | 82,879,954円      |
| バランスセレクト70                       | 82,764,609円      |
| 野村外国債券インデックスファンド                 | 262,333,203円     |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース）               | 3,583,306,689円   |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース）               | 23,217,159,171円  |

|                                                                 |                 |
|-----------------------------------------------------------------|-----------------|
| 野村世界 6 資産分散投信（成長コース）                                            | 2,238,767,810円  |
| 野村資産設計ファンド 2 0 1 5                                              | 21,876,240円     |
| 野村資産設計ファンド 2 0 2 0                                              | 23,644,460円     |
| 野村資産設計ファンド 2 0 2 5                                              | 39,171,312円     |
| 野村資産設計ファンド 2 0 3 0                                              | 51,189,596円     |
| 野村資産設計ファンド 2 0 3 5                                              | 41,137,845円     |
| 野村資産設計ファンド 2 0 4 0                                              | 64,660,299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）                                   | 75,930,643,194円 |
| のむラップ・ファンド（保守型）                                                 | 6,393,085,013円  |
| のむラップ・ファンド（普通型）                                                 | 27,479,287,335円 |
| のむラップ・ファンド（積極型）                                                 | 8,202,755,480円  |
| 野村外国債券インデックス（野村 S M A 向け）                                       | 450,495,574円    |
| 野村資産設計ファンド 2 0 4 5                                              | 12,338,154円     |
| 野村インデックスファンド・外国債券                                               | 1,029,353,067円  |
| マイ・ロード                                                          | 7,894,761,395円  |
| ネクストコア                                                          | 75,105,924円     |
| 野村インデックスファンド・海外 5 資産バランス                                        | 350,423,483円    |
| 野村外国債券インデックス B コース（野村 S M A ・ E W 向け）                           | 7,858,293,007円  |
| 野村世界 6 資産分散投信（配分変更コース）                                          | 1,170,455,706円  |
| 野村資産設計ファンド 2 0 5 0                                              | 11,184,253円     |
| 野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 2 6 - 2 0 2 8 年目標型                   | 4,498,566円      |
| 野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 2 9 - 2 0 3 1 年目標型                   | 3,000,585円      |
| 野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 3 2 - 2 0 3 4 年目標型                   | 1,898,021円      |
| 野村ターゲットデートファンド 2 0 1 6 2 0 3 5 - 2 0 3 7 年目標型                   | 1,587,407円      |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                                               | 969,268,372円    |
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                                               | 1,329,297,599円  |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                               | 3,999,637円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                               | 2,900,642円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                               | 9,394,047円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                               | 1,915,744円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                               | 9,479,668円      |
| 野村 6 資産均等バランス                                                   | 3,102,704,205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）                           | 7,085,987,259円  |
| 世界 6 資産分散ファンド                                                   | 72,646,812円     |
| 野村資産設計ファンド 2 0 6 0                                              | 5,964,741円      |
| N E X T F U N D S 外国債券・ F T S E 世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信 | 10,377,036,114円 |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券                                          | 8,077,910,934円  |
| 野村外国債券インデックスファンド V A（適格機関投資家専用）                                 | 6,176,429円      |
| グローバル・インデックス・バランス 2 5 V A（適格機関投資家専用）                            | 955,783,088円    |
| グローバル・インデックス・バランス 5 0 V A（適格機関投資家専用）                            | 174,512,934円    |
| グローバル・インデックス・バランス 4 0 V A（適格機関投資家専用）                            | 980,262,126円    |
| グローバル・インデックス・バランス 6 0 V A（適格機関投資家専用）                            | 388,409,962円    |
| ワールド・インデックス・ファンド V A 安定型（適格機関投資家専用）                             | 1,326,158円      |
| ワールド・インデックス・ファンド V A バランス型（適格機関投資家専用）                           | 8,156,151円      |
| ワールド・インデックス・ファンド V A 積極型（適格機関投資家専用）                             | 70,793円         |
| 野村インデックス・バランス 6 0 V A（適格機関投資家専用）                                | 2,653,097,928円  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス 3 5 V A（適格機関投資家専用）                           | 4,362,071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）              | 22,104,967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）                 | 7,168,481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）             | 165,286,452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）             | 141,957,182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）             | 1,862,267,983円  |
| 野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）                        | 61,662,356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）                 | 782,020,246円    |
| ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）             | 1,977,556,122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） | 5,695,228円      |
| バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）                           | 3,677,926円      |
| バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）                           | 8,042,993円      |
| バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）                           | 6,225,532円      |
| 野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）                       | 615,159,875円    |
| マイバランス３０（確定拠出年金向け）                             | 5,493,861,881円  |
| マイバランス５０（確定拠出年金向け）                             | 7,029,114,939円  |
| マイバランス７０（確定拠出年金向け）                             | 5,571,150,929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）                     | 23,577,166,513円 |
| マイバランスＤＣ３０                                     | 2,299,164,878円  |
| マイバランスＤＣ５０                                     | 1,760,192,905円  |
| マイバランスＤＣ７０                                     | 1,344,301,722円  |
| 野村ＤＣ外国債券インデックスファンド                             | 9,526,711,170円  |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド                                   | 2,786,558,598円  |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）                             | 280,597,567円    |
| マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）                          | 380,876,551円    |
| マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）                          | 908,998,074円    |
| マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）                          | 369,767,187円    |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース                           | 24,722,144円     |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース                         | 58,792,726円     |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース                           | 28,121,139円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０                    | 21,931,434円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０                    | 15,533,655円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０                    | 8,046,614円      |
| マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）                          | 311,088,904円    |
| マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）                          | 167,382,903円    |
| マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）                          | 100,499,895円    |
| マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）                          | 124,787,296円    |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０                    | 4,034,605円      |
| マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）                          | 43,009,760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）                  | 65,012,366円     |
| みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）                    | 262,795,979円    |
| 野村ＤＣバランスファンド（年金運用戦略タイプ）                        | 41,348,569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(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2023年2月17日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄               | 券面総額           | 評価額            | 備考 |
|------|-----|------------------|----------------|----------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY BOND | 63,000,000.00  | 60,703,939.80  |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 162,300,000.00 | 169,742,964.39 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 44,200,000.00  | 48,001,889.52  |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 158,750,000.00 | 168,535,445.25 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 100,000.00     | 105,666.01     |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 100,000.00     | 83,242.18      |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 1,200,000.00   | 1,143,351.48   |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 8,000,000.00   | 7,793,484.80   |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 9,300,000.00   | 9,080,634.39   |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 200,000.00     | 192,282.34     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 9,300,000.00   | 9,094,094.28   |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 100,000.00     | 95,274.15      |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,200,000.00   | 1,164,995.64   |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 400,000.00     | 389,378.80     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 19,900,000.00  | 19,199,018.52  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 22,200,000.00  | 21,097,170.60  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 50,850,000.00  | 49,254,977.88  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 18,400,000.00  | 17,851,593.52  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 100,000.00     | 94,833.98      |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 2,700,000.00   | 2,605,605.30   |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 700,000.00     | 677,509.70     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 3,800,000.00   | 3,689,117.14   |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 127,100,000.00 | 123,267,134.27 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 14,400,000.00  | 13,583,249.28  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 18,400,000.00  | 17,718,624.08  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 300,000.00     | 290,695.29     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 100,000.00     | 93,972.65      |    |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 25,200,000.00 | 24,209,718.12 |  |
| US TREASURY N/B | 4,450,000.00  | 4,262,178.40  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 292,195.29    |  |
| US TREASURY N/B | 4,800,000.00  | 4,505,437.44  |  |
| US TREASURY N/B | 4,300,000.00  | 4,132,702.91  |  |
| US TREASURY N/B | 750,000.00    | 716,748.00    |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 973,144.50    |  |
| US TREASURY N/B | 10,800,000.00 | 10,102,429.08 |  |
| US TREASURY N/B | 2,050,000.00  | 1,958,870.94  |  |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 9,465,624.99  |  |
| US TREASURY N/B | 900,000.00    | 878,431.59    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,277.34     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 95,847.65     |  |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00  | 1,992,046.77  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,410.15     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 287,566.38    |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 473,300.75    |  |
| US TREASURY N/B | 50,000.00     | 47,916.99     |  |
| US TREASURY N/B | 9,500,000.00  | 8,863,944.60  |  |
| US TREASURY N/B | 1,150,000.00  | 1,098,811.43  |  |
| US TREASURY N/B | 2,400,000.00  | 2,267,859.36  |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 187,015.62    |  |
| US TREASURY N/B | 1,900,000.00  | 1,817,097.49  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 94,757.81     |  |
| US TREASURY N/B | 5,700,000.00  | 5,332,394.46  |  |
| US TREASURY N/B | 3,700,000.00  | 3,552,288.97  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 281,812.50    |  |
| US TREASURY N/B | 25,100,000.00 | 23,846,468.35 |  |
| US TREASURY N/B | 3,200,000.00  | 3,009,312.32  |  |
| US TREASURY N/B | 3,800,000.00  | 3,662,398.20  |  |
| US TREASURY N/B | 17,300,000.00 | 16,135,628.69 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 94,359.37     |  |
| US TREASURY N/B | 32,700,000.00 | 31,416,266.67 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,855.46     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 95,984.37     |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 48,800,000.00 | 47,074,841.92 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,339.84     |  |
| US TREASURY N/B | 11,150,000.00 | 10,577,690.57 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,156.25     |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 963,984.30    |  |
| US TREASURY N/B | 6,500,000.00  | 5,901,034.75  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,398.43     |  |
| US TREASURY N/B | 3,000,000.00  | 2,882,343.60  |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 181,226.56    |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 289,757.79    |  |
| US TREASURY N/B | 5,200,000.00  | 5,009,062.24  |  |
| US TREASURY N/B | 4,000,000.00  | 3,612,656.00  |  |
| US TREASURY N/B | 36,750,000.00 | 34,632,567.90 |  |
| US TREASURY N/B | 700,000.00    | 671,289.01    |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 180,039.06    |  |
| US TREASURY N/B | 43,750,000.00 | 42,177,734.37 |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 179,789.06    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,375.00     |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 179,078.12    |  |
| US TREASURY N/B | 51,300,000.00 | 48,452,444.73 |  |
| US TREASURY N/B | 13,200,000.00 | 12,679,217.76 |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 179,156.24    |  |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 9,540,625.00  |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 178,945.30    |  |
| US TREASURY N/B | 16,600,000.00 | 15,816,687.50 |  |
| US TREASURY N/B | 17,100,000.00 | 15,232,358.52 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00  | 1,847,734.20  |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 947,968.70    |  |
| US TREASURY N/B | 2,200,000.00  | 1,961,437.50  |  |
| US TREASURY N/B | 5,000,000.00  | 4,702,148.00  |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 179,484.36    |  |
| US TREASURY N/B | 42,300,000.00 | 39,889,229.94 |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 268,253.88    |  |
| US TREASURY N/B | 1,800,000.00  | 1,654,804.62  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 280,224.60    |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 2,600,000.00  | 2,318,570.28  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 92,589.84     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 268,195.29    |  |
| US TREASURY N/B | 3,200,000.00  | 2,957,499.84  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 88,359.37     |  |
| US TREASURY N/B | 32,950,000.00 | 30,012,813.93 |  |
| US TREASURY N/B | 12,000,000.00 | 10,873,593.60 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 88,539.06     |  |
| US TREASURY N/B | 11,500,000.00 | 10,500,937.50 |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 266,238.27    |  |
| US TREASURY N/B | 5,600,000.00  | 5,104,093.68  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 268,183.59    |  |
| US TREASURY N/B | 13,300,000.00 | 12,275,483.71 |  |
| US TREASURY N/B | 55,000,000.00 | 50,075,778.50 |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 448,164.05    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,375.00     |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 179,000.00    |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 180,414.06    |  |
| US TREASURY N/B | 36,950,000.00 | 34,334,630.96 |  |
| US TREASURY N/B | 2,900,000.00  | 2,576,015.48  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,419.92     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 260,250.00    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,650.39     |  |
| US TREASURY N/B | 17,000,000.00 | 14,625,312.50 |  |
| US TREASURY N/B | 350,000.00    | 330,797.84    |  |
| US TREASURY N/B | 67,500,000.00 | 62,801,365.50 |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 171,554.68    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,974.60     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 256,734.36    |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 289,142.55    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 84,875.00     |  |
| US TREASURY N/B | 1,400,000.00  | 1,320,949.14  |  |
| US TREASURY N/B | 20,300,000.00 | 18,745,383.37 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 85,167.96     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 95,880.85     |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 84,457.03     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 254,191.38    |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 920,683.50    |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 255,199.20    |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 424,257.80    |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 426,015.60    |  |
| US TREASURY N/B | 28,200,000.00 | 26,506,897.38 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 86,683.59     |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00  | 1,305,820.20  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 86,906.25     |  |
| US TREASURY N/B | 53,600,000.00 | 50,569,295.20 |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 433,632.80    |  |
| US TREASURY N/B | 16,400,000.00 | 14,195,608.76 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 85,164.06     |  |
| US TREASURY N/B | 16,150,000.00 | 15,210,964.71 |  |
| US TREASURY N/B | 10,100,000.00 | 8,646,151.46  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 86,039.06     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 259,464.84    |  |
| US TREASURY N/B | 2,400,000.00  | 2,286,093.60  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 86,980.46     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 86,300.78     |  |
| US TREASURY N/B | 3,200,000.00  | 2,816,374.72  |  |
| US TREASURY N/B | 35,050,000.00 | 32,422,616.95 |  |
| US TREASURY N/B | 18,000,000.00 | 15,953,905.80 |  |
| US TREASURY N/B | 8,100,000.00  | 7,374,163.86  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,667.96     |  |
| US TREASURY N/B | 28,900,000.00 | 26,283,194.59 |  |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00  | 1,951,605.39  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 286,898.43    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 92,144.53     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 260,648.43    |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 949,199.20    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 87,460.93     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 80,289.06     |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 170,835.92    |  |

|                 |                |                |  |
|-----------------|----------------|----------------|--|
| US TREASURY N/B | 86,200,000.00  | 98,527,272.36  |  |
| US TREASURY N/B | 400,000.00     | 317,937.48     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 79,035.15      |  |
| US TREASURY N/B | 161,450,000.00 | 177,390,023.08 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 81,763.67      |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 84,460.93      |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 81,445.31      |  |
| US TREASURY N/B | 35,650,000.00  | 29,146,659.26  |  |
| US TREASURY N/B | 6,000,000.00   | 5,104,452.60   |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 92,367.18      |  |
| US TREASURY N/B | 800,000.00     | 729,874.96     |  |
| US TREASURY N/B | 18,500,000.00  | 18,875,781.25  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 107,486.32     |  |
| US TREASURY N/B | 6,850,000.00   | 7,718,156.67   |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 106,992.18     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 95,107.42      |  |
| US TREASURY N/B | 1,100,000.00   | 1,143,312.50   |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 107,015.62     |  |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00   | 2,214,351.51   |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 108,644.53     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 105,164.06     |  |
| US TREASURY N/B | 6,400,000.00   | 4,084,499.84   |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 98,851.56      |  |
| US TREASURY N/B | 4,100,000.00   | 2,600,296.67   |  |
| US TREASURY N/B | 1,400,000.00   | 1,450,585.92   |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 66,128.90      |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 110,257.81     |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00     | 143,984.36     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 105,230.46     |  |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00   | 1,605,105.39   |  |
| US TREASURY N/B | 7,500,000.00   | 7,245,409.50   |  |
| US TREASURY N/B | 13,300,000.00  | 9,267,138.09   |  |
| US TREASURY N/B | 2,400,000.00   | 2,110,031.04   |  |
| US TREASURY N/B | 9,300,000.00   | 6,757,031.25   |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00     | 87,589.84      |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 600,000.00    | 464,484.36    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 85,617.18     |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 444,882.80    |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 163,960.92    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 90,625.00     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 81,738.28     |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 991,562.50    |  |
| US TREASURY N/B | 2,390,000.00  | 2,075,098.61  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,652.34     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,367.18     |  |
| US TREASURY N/B | 8,000,000.00  | 7,175,000.00  |  |
| US TREASURY N/B | 39,950,000.00 | 34,366,360.28 |  |
| US TREASURY N/B | 44,800,000.00 | 37,694,124.16 |  |
| US TREASURY N/B | 44,700,000.00 | 34,343,917.41 |  |
| US TREASURY N/B | 22,900,000.00 | 19,227,052.97 |  |
| US TREASURY N/B | 17,500,000.00 | 14,358,202.25 |  |
| US TREASURY N/B | 3,200,000.00  | 2,683,624.96  |  |
| US TREASURY N/B | 49,700,000.00 | 37,970,019.71 |  |
| US TREASURY N/B | 28,200,000.00 | 21,522,327.42 |  |
| US TREASURY N/B | 36,500,000.00 | 26,446,815.95 |  |
| US TREASURY N/B | 14,200,000.00 | 11,620,148.26 |  |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00  | 1,672,187.40  |  |
| US TREASURY N/B | 1,700,000.00  | 1,421,027.28  |  |
| US TREASURY N/B | 11,400,000.00 | 9,089,272.44  |  |
| US TREASURY N/B | 6,300,000.00  | 5,024,250.00  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 83,601.56     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 85,601.56     |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 418,359.35    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 89,761.71     |  |
| US TREASURY N/B | 470,000.00    | 394,469.49    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 81,968.75     |  |
| US TREASURY N/B | 11,250,000.00 | 8,080,223.62  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 221,367.18    |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 676,445.30    |  |
| US TREASURY N/B | 45,900,000.00 | 25,408,156.14 |  |

|       |                     |                  |                                       |  |
|-------|---------------------|------------------|---------------------------------------|--|
| 小計    | US TREASURY N/B     | 44,200,000.00    | 25,288,959.28                         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 32,600,000.00    | 19,936,937.50                         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 25,800,000.00    | 16,810,312.50                         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 75,850,000.00    | 55,580,862.39                         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 1,400,000.00     | 937,890.52                            |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 64,794.92                             |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 71,082.03                             |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 81,707.03                             |  |
|       | 銘柄数：245             | 2,698,310,000.00 | 2,495,611,347.08<br>(335,410,165,047) |  |
|       | 組入時価比率：49.4%        |                  | 50.1%                                 |  |
| カナダドル | CANADIAN GOVERNMENT | 500,000.00       | 488,794.50                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 7,000,000.00     | 6,836,480.00                          |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 900,000.00       | 881,825.40                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 1,600,000.00     | 1,588,518.40                          |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 34,500,000.00    | 32,644,176.00                         |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00       | 94,911.80                             |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 4,500,000.00     | 4,342,531.50                          |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 2,100,000.00     | 1,930,506.90                          |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 1,600,000.00     | 1,566,113.60                          |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 350,000.00       | 315,577.15                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 300,000.00       | 280,814.40                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 14,200,000.00    | 12,987,021.80                         |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00       | 91,598.60                             |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 200,000.00       | 181,252.00                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 300,000.00       | 291,340.20                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 800,000.00       | 804,225.60                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 250,000.00       | 234,511.25                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 17,180,000.00    | 19,561,182.36                         |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00       | 94,313.30                             |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 300,000.00       | 281,742.30                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 500,000.00       | 434,713.50                            |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 5,950,000.00     | 5,184,110.05                          |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00       | 86,470.10                             |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00       | 89,791.10                             |  |
|       |                     |                  |                                       |  |

|        |                         |                |                  |  |
|--------|-------------------------|----------------|------------------|--|
| 小計     | CANADIAN GOVERNMENT     | 900,000.00     | 841,239.00       |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 16,900,000.00  | 20,435,665.90    |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 5,040,000.00   | 5,972,914.08     |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 500,000.00     | 543,475.00       |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 9,400,000.00   | 9,629,266.00     |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 600,000.00     | 542,002.80       |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 12,100,000.00  | 9,193,979.30     |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 1,100,000.00   | 776,298.60       |  |
|        | CANADIAN GOVERNMENT     | 1,600,000.00   | 1,408,614.40     |  |
|        | 銘柄数：33                  | 141,670,000.00 | 140,635,976.89   |  |
|        |                         |                | (14,029,845,054) |  |
|        | 組入時価比率：2.1%             |                | 2.1%             |  |
| メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT | 78,500,000.00  | 75,069,471.50    |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 51,500,000.00  | 51,054,216.00    |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 73,000,000.00  | 65,435,740.00    |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 118,000,000.00 | 104,970,062.40   |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 1,000,000.00   | 862,720.00       |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 110,800,000.00 | 103,327,648.00   |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 77,300,000.00  | 75,202,851.00    |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 106,600,000.00 | 99,045,258.00    |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 400,000.00     | 364,072.00       |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 53,300,000.00  | 57,511,233.00    |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 48,600,000.00  | 46,247,760.00    |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 68,200,000.00  | 59,876,872.00    |  |
|        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 54,000,000.00  | 48,507,660.00    |  |
|        | 銘柄数：13                  | 841,200,000.00 | 787,475,563.90   |  |
|        |                         |                | (5,703,449,266)  |  |
|        | 組入時価比率：0.8%             |                | 0.9%             |  |
| ユーロ    | BELGIUM KINGDOM         | 5,550,000.00   | 5,515,590.00     |  |
|        | BELGIUM KINGDOM         | 5,700,000.00   | 5,481,120.00     |  |
|        | BELGIUM KINGDOM         | 1,700,000.00   | 1,620,801.42     |  |
|        | BELGIUM KINGDOM         | 9,600,000.00   | 10,075,137.60    |  |
|        | BELGIUM KINGDOM         | 100,000.00     | 94,282.60        |  |
|        | BELGIUM KINGDOM         | 100,000.00     | 91,886.50        |  |
|        | BELGIUM KINGDOM         | 1,000,000.00   | 902,269.00       |  |
|        | BELGIUM KINGDOM         | 6,500,000.00   | 5,779,397.00     |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BELGIUM KINGDOM          | 11,400,000.00 | 9,775,123.80  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 7,500,000.00  | 8,065,200.00  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00    | 84,210.00     |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 2,800,000.00  | 2,224,975.20  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00    | 83,401.95     |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 4,100,000.00  | 4,600,987.20  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 4,000,000.00  | 4,236,178.40  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 4,950,000.00  | 3,513,772.35  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 2,700,000.00  | 1,906,966.80  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 3,600,000.00  | 2,813,798.88  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 2,200,000.00  | 1,654,023.80  |  |
| BELGIUM KINGDOM GOVT     | 11,500,000.00 | 12,953,807.00 |  |
| BELGIUM KINGDOM GOVT     | 10,500,000.00 | 12,364,117.50 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,550,000.00  | 4,625,470.85  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 13,600,000.00 | 13,724,440.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 10,300,000.00 | 10,251,476.70 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2,100,000.00  | 2,034,333.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 12,200,000.00 | 11,366,593.60 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 19,650,000.00 | 20,361,624.75 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 97,704.50     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,200,000.00  | 1,097,280.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,000,000.00  | 2,896,784.70  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 50,000.00     | 54,540.05     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 800,000.00    | 751,512.80    |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 93,795.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 90,355.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 11,300,000.00 | 10,511,599.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 900,000.00    | 772,605.00    |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 22,800,000.00 | 20,901,968.40 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 6,250,000.00  | 5,709,062.50  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 16,350,000.00 | 17,985,000.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 90,293.60     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 500,000.00    | 429,200.00    |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,200,000.00  | 3,838,720.62  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 29,700,000.00 | 27,523,563.21 |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,400,000.00  | 4,854,600.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,000,000.00  | 824,279.00    |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 800,000.00    | 542,876.00    |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,900,000.00  | 2,173,991.40  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,200,000.00  | 4,710,090.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 500,000.00    | 470,080.95    |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 13,000,000.00 | 15,612,090.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 86,560.58     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,500,000.00  | 1,231,967.55  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,600,000.00  | 5,071,082.80  |  |
| BUNDES Obligation        | 2,600,000.00  | 2,478,970.00  |  |
| BUNDES Obligation        | 1,300,000.00  | 1,197,456.00  |  |
| BUNDES Obligation        | 2,950,000.00  | 2,683,851.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 600,000.00    | 589,440.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,500,000.00  | 1,458,735.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,700,000.00  | 2,580,930.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,700,000.00  | 7,374,136.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 19,600,000.00 | 18,388,720.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,000,000.00  | 914,020.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 700,000.00    | 639,450.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 21,300,000.00 | 24,687,978.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 200,000.00    | 182,996.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 19,300,000.00 | 21,996,403.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 600,000.00    | 544,260.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 10,700,000.00 | 11,875,288.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 88,652.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 87,763.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 97,517.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 19,550,000.00 | 24,161,649.50 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 32,100,000.00 | 38,953,992.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 17,800,000.00 | 21,740,225.80 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 16,700,000.00 | 19,502,607.36 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 17,900,000.00 | 14,357,769.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,700,000.00  | 9,451,018.50  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,800,000.00  | 3,655,198.40  |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,130,000.00  | 1,252,581.27  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,700,000.00  | 3,707,705.25  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 11,700,000.00 | 11,795,940.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 11,200,000.00 | 8,742,944.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,000,000.00  | 499,740.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,700,000.00  | 3,189,289.00  |  |
| BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 4,600,000.00  | 4,544,846.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,100,000.00 | 10,219,786.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 300,000.00    | 294,723.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,200,000.00  | 1,175,016.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,200,000.00  | 2,151,952.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,300,000.00  | 7,340,807.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,600,000.00  | 7,362,804.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,000,000.00  | 991,430.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,100,000.00  | 1,990,779.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 31,200,000.00 | 32,167,200.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 95,620.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,500,000.00  | 5,276,208.30  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 400,000.00    | 386,360.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,800,000.00  | 5,491,730.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 11,750,000.00 | 11,471,525.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,000,000.00  | 2,886,900.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,550,000.00 | 12,546,235.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 91,682.72     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 18,600,000.00 | 19,133,820.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 800,000.00    | 753,280.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,000,000.00  | 1,911,200.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 26,600,000.00 | 30,071,300.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 92,000.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 90,580.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 189,160.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 187,240.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 35,450,000.00 | 39,881,250.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,600,000.00  | 2,486,380.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 185,300.00    |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 850,000.00    | 836,825.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 15,000,000.00 | 15,765,000.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 95,280.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 800,000.00    | 763,520.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 40,550,000.00 | 44,130,565.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,000,000.00  | 1,988,400.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 97,860.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,000,000.00  | 845,500.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 20,000,000.00 | 22,872,000.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,050,000.00  | 859,635.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 75,880.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 86,590.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 18,350,000.00 | 20,564,845.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,000,000.00  | 6,058,200.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,400,000.00  | 1,185,100.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 22,300,000.00 | 23,595,630.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 15,700,000.00 | 14,170,820.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 800,000.00    | 773,440.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 79,110.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,300,000.00  | 7,072,970.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00    | 435,550.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 83,960.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,000,000.00  | 5,336,000.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 169,000.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,100,000.00 | 12,954,260.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,800,000.00  | 9,164,320.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,900,000.00  | 4,092,480.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,800,000.00  | 2,399,600.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,800,000.00  | 8,007,120.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 7,900,000.00  | 5,518,940.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,100,000.00  | 2,836,228.30  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 700,000.00    | 692,314.00    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 600,000.00    | 617,310.00    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 100,000.00    | 95,310.08     |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 2,000,000.00  | 1,868,188.00  |  |

|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| FINNISH GOVERNMENT      | 3,300,000.00  | 3,285,819.90  |  |
| FINNISH GOVERNMENT      | 2,400,000.00  | 2,060,757.60  |  |
| FINNISH GOVERNMENT      | 1,300,000.00  | 1,094,575.69  |  |
| FINNISH GOVERNMENT      | 2,000,000.00  | 1,632,290.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT      | 4,500,000.00  | 3,057,196.50  |  |
| FINNISH GOVERNMENT      | 400,000.00    | 374,132.80    |  |
| FINNISH GOVERNMENT      | 1,000,000.00  | 729,226.80    |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 96,798.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 99,062.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 12,000,000.00 | 11,310,681.60 |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 5,700,000.00  | 5,360,293.11  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 9,950,000.00  | 9,442,550.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 3,100,000.00  | 2,875,541.40  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 13,300,000.00 | 12,089,407.40 |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 8,000,000.00  | 7,424,532.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 500,000.00    | 451,821.50    |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 6,900,000.00  | 6,210,503.70  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 15,100,000.00 | 13,459,566.20 |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 3,300,000.00  | 2,875,950.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 300,000.00    | 296,460.00    |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 14,500,000.00 | 12,036,102.00 |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 79,680.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 82,280.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 10,600,000.00 | 8,356,223.80  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 2,000,000.00  | 1,380,800.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 54,025.50     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 1,500,000.00  | 790,740.00    |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 2,400,000.00  | 1,653,840.00  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,400,000.00  | 5,287,150.80  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 10,650,000.00 | 11,543,535.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 100,000.00    | 95,050.00     |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 300,000.00    | 275,386.50    |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 36,400,000.00 | 37,126,180.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8,700,000.00  | 8,674,335.00  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 40,150,000.00 | 45,875,390.00 |  |

|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 100,000.00    | 90,442.30     |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 28,050,000.00 | 34,665,873.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 40,050,000.00 | 46,588,362.75 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 10,300,000.00 | 11,286,732.79 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5,350,000.00  | 6,254,497.75  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 24,450,000.00 | 24,467,115.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 7,650,000.00  | 8,740,168.60  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 14,840,000.00 | 17,235,992.20 |  |
| IRISH GOVERNMENT        | 130,000.00    | 136,570.85    |  |
| IRISH GOVERNMENT        | 10,600,000.00 | 9,640,203.92  |  |
| IRISH TSY 1.10% 2029    | 600,000.00    | 541,222.20    |  |
| IRISH TSY 1.3% 2033     | 5,100,000.00  | 4,326,753.30  |  |
| IRISH TSY 1.35% 2031    | 1,100,000.00  | 981,167.00    |  |
| IRISH TSY 1.5% 2050     | 2,900,000.00  | 2,001,142.10  |  |
| IRISH TSY 1.7% 2037     | 3,100,000.00  | 2,575,092.50  |  |
| IRISH TSY 1% 2026       | 100,000.00    | 94,667.80     |  |
| IRISH TSY 2.4% 2030     | 7,500,000.00  | 7,293,135.00  |  |
| IRISH TSY 2% 2045       | 1,600,000.00  | 1,282,057.60  |  |
| IRISH TSY 3.4% 2024     | 100,000.00    | 100,605.90    |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 100,000.00    | 98,730.00     |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 8,500,000.00  | 7,996,708.20  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 100,000.00    | 92,825.00     |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 100,000.00    | 92,100.00     |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 12,300,000.00 | 13,899,000.00 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 1,000,000.00  | 903,150.00    |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 2,000,000.00  | 1,707,940.00  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 100,000.00    | 85,887.96     |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 11,750,000.00 | 11,474,603.50 |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 6,850,000.00  | 7,766,662.89  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 500,000.00    | 347,819.50    |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 5,300,000.00  | 6,037,320.10  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 9,800,000.00  | 9,905,842.94  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 400,000.00    | 345,824.00    |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA     | 800,000.00    | 576,688.80    |  |
| REPUBLIC OF AUSTRIA     | 1,300,000.00  | 1,246,765.00  |  |

|     |                     |                  |                   |  |
|-----|---------------------|------------------|-------------------|--|
| 小計  | REPUBLIC OF AUSTRIA | 700,000.00       | 685,463.80        |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,600,000.00     | 4,412,862.80      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 7,900,000.00     | 8,366,100.00      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,000,000.00     | 1,856,824.00      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 7,600,000.00     | 8,659,690.80      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 11,600,000.00    | 10,061,840.00     |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 9,550,000.00     | 8,920,120.20      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,200,000.00     | 1,332,337.20      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,400,000.00     | 2,405,827.20      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 7,000,000.00     | 5,100,900.00      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,000,000.00     | 1,144,032.00      |  |
|     | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,650,000.00     | 3,048,459.30      |  |
|     | SPANISH GOVERNMENT  | 34,000,000.00    | 39,148,960.00     |  |
|     | SPANISH GOVERNMENT  | 27,950,000.00    | 33,308,015.00     |  |
|     | SPANISH GOVERNMENT  | 9,250,000.00     | 9,756,437.50      |  |
|     | 銘柄数：233             | 1,516,600,000.00 | 1,557,780,103.09  |  |
|     |                     |                  | (223,074,110,762) |  |
|     | 組入時価比率：32.9%        |                  | 33.3%             |  |
| 英債券 | UK TREASURY         | 700,000.00       | 676,270.00        |  |
|     | UK TREASURY         | 300,000.00       | 290,597.16        |  |
|     | UK TREASURY         | 4,350,000.00     | 4,285,961.04      |  |
|     | UK TREASURY         | 15,720,000.00    | 16,183,670.83     |  |
|     | UK TREASURY         | 200,000.00       | 187,889.36        |  |
|     | UK TREASURY         | 500,000.00       | 483,001.00        |  |
|     | UK TREASURY         | 1,910,000.00     | 1,793,373.49      |  |
|     | UK TREASURY         | 1,680,000.00     | 1,502,172.00      |  |
|     | UK TREASURY         | 400,000.00       | 364,760.00        |  |
|     | UK TREASURY         | 8,600,000.00     | 8,916,579.76      |  |
|     | UK TREASURY         | 200,000.00       | 181,749.20        |  |
|     | UK TREASURY         | 7,330,000.00     | 8,293,103.36      |  |
|     | UK TREASURY         | 700,000.00       | 587,141.94        |  |
|     | UK TREASURY         | 200,000.00       | 169,794.00        |  |
|     | UK TREASURY         | 7,200,000.00     | 7,839,360.00      |  |
|     | UK TREASURY         | 5,260,000.00     | 5,569,519.44      |  |
|     | UK TREASURY         | 17,350,000.00    | 18,696,880.50     |  |
|     |                     |                  |                   |  |
|     |                     |                  |                   |  |
|     |                     |                  |                   |  |

|                |                            |                |                  |  |
|----------------|----------------------------|----------------|------------------|--|
| 小計             | UK TREASURY                | 750,000.00     | 519,207.00       |  |
|                | UK TREASURY                | 10,830,000.00  | 11,358,287.40    |  |
|                | UK TREASURY                | 1,500,000.00   | 1,149,855.00     |  |
|                | UK TREASURY                | 27,750,000.00  | 27,290,737.50    |  |
|                | UK TREASURY                | 4,250,000.00   | 4,681,715.00     |  |
|                | UK TREASURY                | 18,600,000.00  | 19,334,365.20    |  |
|                | UK TREASURY                | 500,000.00     | 519,630.00       |  |
|                | UK TREASURY                | 320,000.00     | 344,195.20       |  |
|                | UK TREASURY                | 10,440,000.00  | 9,718,531.27     |  |
|                | UK TREASURY                | 1,900,000.00   | 1,977,615.00     |  |
|                | UK TREASURY                | 3,000,000.00   | 1,851,350.40     |  |
|                | UK TREASURY                | 10,400,000.00  | 6,727,552.00     |  |
|                | UK TREASURY                | 350,000.00     | 366,891.00       |  |
|                | UK TREASURY                | 100,000.00     | 54,659.20        |  |
|                | UK TREASURY                | 6,250,000.00   | 6,070,437.50     |  |
|                | UK TREASURY                | 1,800,000.00   | 1,067,760.00     |  |
|                | UK TREASURY                | 700,000.00     | 426,967.80       |  |
|                | UK TREASURY                | 8,600,000.00   | 8,979,346.00     |  |
|                | UK TREASURY                | 100,000.00     | 74,043.00        |  |
|                | UK TREASURY                | 200,000.00     | 190,332.00       |  |
|                | UK TSY 0 1/2% 2061         | 6,600,000.00   | 2,323,530.00     |  |
|                | UK TSY 0 5/8% 2050         | 6,100,000.00   | 2,747,623.00     |  |
|                | UK TSY 3 1/4% 2044         | 7,000,000.00   | 6,289,542.00     |  |
|                | UNITED KINGDOM GILT        | 700,000.00     | 695,972.90       |  |
|                | UNITED KINGDOM GILT        | 8,000,000.00   | 8,145,760.00     |  |
|                | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 3,470,000.00   | 3,711,060.90     |  |
|                | 銘柄数：43                     | 212,810,000.00 | 202,638,789.35   |  |
|                |                            |                | (32,580,264,551) |  |
|                | 組入時価比率：4.8%                |                | 4.9%             |  |
| スウェーデンク<br>ローナ | SWEDISH GOVERNMENT         | 34,350,000.00  | 34,082,070.00    |  |
|                | SWEDISH GOVERNMENT         | 16,000,000.00  | 15,121,654.40    |  |
|                | SWEDISH GOVERNMENT         | 17,300,000.00  | 15,890,330.26    |  |
|                | SWEDISH GOVERNMENT         | 4,100,000.00   | 3,691,120.12     |  |
|                | SWEDISH GOVERNMENT         | 13,100,000.00  | 10,908,566.50    |  |
|                | SWEDISH GOVERNMENT         | 21,300,000.00  | 24,403,556.97    |  |

|           |                        |                |                                   |      |
|-----------|------------------------|----------------|-----------------------------------|------|
| 小計        | 銘柄数：6                  | 106,150,000.00 | 104,097,298.25<br>(1,336,609,309) | 0.2% |
|           | 組入時価比率：0.2%            |                |                                   |      |
| ノルウェークローネ | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 22,800,000.00  | 22,693,840.92                     |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 13,300,000.00  | 12,882,140.60                     |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 7,100,000.00   | 6,751,390.00                      |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 1,700,000.00   | 1,607,435.00                      |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 9,400,000.00   | 8,879,334.00                      |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 28,000,000.00  | 25,657,548.00                     |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 7,400,000.00   | 6,522,768.48                      |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 13,000,000.00  | 11,879,777.00                     |      |
| 小計        | 銘柄数：8                  | 102,700,000.00 | 96,874,234.00<br>(1,266,146,238)  | 0.2% |
|           | 組入時価比率：0.2%            |                |                                   |      |
| デンマーククローネ | KINGDOM OF DENMARK     | 25,200,000.00  | 24,457,860.00                     |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 6,500,000.00   | 5,879,021.85                      |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 37,250,000.00  | 32,306,925.00                     |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 38,100,000.00  | 47,352,615.48                     |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 7,500,000.00   | 4,019,595.00                      |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 7,500,000.00   | 4,019,595.00                      |      |
| 小計        | 銘柄数：5                  | 114,550,000.00 | 114,016,017.33<br>(2,191,387,853) | 0.3% |
|           | 組入時価比率：0.3%            |                |                                   |      |
| ズロチ       | POLAND GOVERNMENT BOND | 38,800,000.00  | 36,376,210.56                     |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 8,300,000.00   | 7,386,170.00                      |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 56,800,000.00  | 48,098,808.00                     |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 3,300,000.00   | 2,659,800.00                      |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 7,400,000.00   | 5,204,494.00                      |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 7,400,000.00   | 5,204,494.00                      |      |
| 小計        | 銘柄数：5                  | 114,600,000.00 | 99,725,482.56<br>(2,993,559,535)  | 0.4% |
|           | 組入時価比率：0.4%            |                |                                   |      |
| 豪ドル       | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2,500,000.00   | 2,474,625.00                      |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 7,850,000.00   | 7,819,544.35                      |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 17,680,000.00  | 18,105,119.13                     |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 6,350,000.00   | 6,657,271.42                      |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,200,000.00   | 1,159,888.20                      |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 300,000.00     | 287,430.27                        |      |

|                |                        |                |                  |  |
|----------------|------------------------|----------------|------------------|--|
| 小計             | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,700,000.00   | 1,668,675.29     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 9,300,000.00   | 8,798,730.00     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 22,200,000.00  | 20,581,890.84    |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 5,700,000.00   | 4,662,684.93     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3,300,000.00   | 2,779,146.15     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 300,000.00     | 238,560.00       |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 600,000.00     | 483,771.48       |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,300,000.00   | 1,088,269.65     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 17,000,000.00  | 18,058,367.30    |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 300,000.00     | 279,224.19       |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3,050,000.00   | 2,711,972.46     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 9,350,000.00   | 9,123,817.89     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,550,000.00   | 1,395,155.00     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2,250,000.00   | 1,861,431.52     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 6,600,000.00   | 5,431,800.00     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3,000,000.00   | 1,814,400.00     |  |
|                | 銘柄数：22                 | 123,380,000.00 | 117,481,775.07   |  |
|                |                        |                | (10,831,819,661) |  |
|                | 組入時価比率：1.6%            |                | 1.6%             |  |
| ニュージーランド<br>ドル | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4,000,000.00   | 3,839,200.00     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4,000,000.00   | 4,017,600.00     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 3,000,000.00   | 2,788,902.00     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4,000,000.00   | 3,727,762.00     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2,000,000.00   | 1,636,641.20     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1,000,000.00   | 653,021.00       |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1,000,000.00   | 725,500.00       |  |
|                | 銘柄数：7                  | 19,000,000.00  | 17,388,626.20    |  |
|                |                        |                | (1,458,557,965)  |  |
|                | 組入時価比率：0.2%            |                | 0.2%             |  |
| シンガポールドル       | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1,450,000.00   | 1,430,425.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2,300,000.00   | 2,292,295.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1,100,000.00   | 1,079,980.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2,700,000.00   | 2,615,220.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 500,000.00     | 468,200.00       |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 5,850,000.00   | 5,934,825.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 500,000.00     | 489,250.00       |  |

|  |     |                       |                |                 |  |
|--|-----|-----------------------|----------------|-----------------|--|
|  | 小計  | SINGAPORE GOVERNMENT  | 300,000.00     | 295,650.00      |  |
|  |     | SINGAPORE GOVERNMENT  | 5,260,000.00   | 5,157,430.00    |  |
|  |     | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2,980,000.00   | 3,035,130.00    |  |
|  |     | SINGAPORE GOVERNMENT  | 3,220,000.00   | 2,892,574.30    |  |
|  |     | SINGAPORE GOVERNMENT  | 1,950,000.00   | 1,878,737.25    |  |
|  |     | SINGAPORE GOVERNMENT  | 1,900,000.00   | 1,844,900.00    |  |
|  |     | SINGAPORE GOVERNMENT  | 2,100,000.00   | 1,738,800.00    |  |
|  |     | 銘柄数：14                | 32,110,000.00  | 31,153,416.55   |  |
|  |     |                       |                | (3,130,918,363) |  |
|  |     | 組入時価比率：0.5%           |                | 0.5%            |  |
|  | リンギ | MALAYSIA GOVERNMENT   | 400,000.00     | 404,172.68      |  |
|  |     | MALAYSIA GOVERNMENT   | 1,000,000.00   | 1,008,938.40    |  |
|  |     | MALAYSIA GOVERNMENT   | 2,600,000.00   | 2,749,702.80    |  |
|  |     | MALAYSIA GOVERNMENT   | 3,300,000.00   | 3,222,623.25    |  |
|  |     | MALAYSIA GOVERNMENT   | 3,300,000.00   | 3,517,943.88    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 2,500,000.00   | 2,507,580.75    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 7,800,000.00   | 7,884,973.20    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 2,900,000.00   | 2,931,705.99    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 16,600,000.00  | 17,005,861.70   |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4,600,000.00   | 4,647,282.94    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 9,200,000.00   | 9,154,091.08    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 2,200,000.00   | 2,205,306.18    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 280,000.00     | 281,675.82      |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 15,400,000.00  | 16,091,883.50   |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 5,400,000.00   | 5,530,494.78    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 9,800,000.00   | 9,641,117.50    |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 11,100,000.00  | 11,252,905.83   |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 10,600,000.00  | 11,495,694.70   |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 10,500,000.00  | 11,092,098.15   |  |
|  |     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 300,000.00     | 323,704.14      |  |
|  |     | 銘柄数：20                | 119,780,000.00 | 122,949,757.27  |  |
|  |     |                       |                | (3,730,652,189) |  |
|  |     | 組入時価比率：0.5%           |                | 0.6%            |  |
|  | 人民元 | CHINA GOVERNMENT BOND | 141,900,000.00 | 142,182,026.25  |  |
|  |     | CHINA GOVERNMENT BOND | 1,000,000.00   | 997,950.00      |  |
|  |     | CHINA GOVERNMENT BOND | 142,100,000.00 | 141,637,151.88  |  |

|       |                       |                  |                  |  |
|-------|-----------------------|------------------|------------------|--|
| 小計    | CHINA GOVERNMENT BOND | 49,900,000.00    | 49,685,430.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 73,500,000.00    | 72,952,425.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 102,500,000.00   | 101,853,440.25   |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 89,500,000.00    | 89,755,075.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 33,000,000.00    | 32,657,691.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 84,800,000.00    | 84,125,840.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 54,000,000.00    | 53,570,700.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 31,500,000.00    | 31,185,000.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 48,800,000.00    | 48,692,640.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 70,000,000.00    | 70,532,000.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 60,000,000.00    | 59,895,618.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 74,000,000.00    | 73,644,800.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 93,500,000.00    | 92,040,025.55    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 33,000,000.00    | 33,425,571.30    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 20,000,000.00    | 20,017,946.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 20,000,000.00    | 19,767,926.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 31,500,000.00    | 31,140,443.25    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 70,300,000.00    | 69,051,725.08    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 42,100,000.00    | 41,779,703.20    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 15,000,000.00    | 16,111,320.00    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 36,000,000.00    | 37,463,324.40    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 87,700,000.00    | 88,410,510.32    |  |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 15,000,000.00    | 14,552,149.50    |  |
|       | 銘柄数：26                | 1,520,600,000.00 | 1,517,128,431.98 |  |
|       |                       |                  | (29,723,731,952) |  |
|       | 組入時価比率：4.4%           |                  | 4.4%             |  |
| 新シェケル | ISRAEL FIXED BOND     | 6,200,000.00     | 6,173,433.62     |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 1,900,000.00     | 1,789,430.45     |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 12,200,000.00    | 11,567,421.46    |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 6,500,000.00     | 7,030,631.40     |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 5,000,000.00     | 4,662,507.00     |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 6,300,000.00     | 5,826,679.74     |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 4,500,000.00     | 3,758,628.15     |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 5,900,000.00     | 4,482,424.11     |  |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 7,200,000.00     | 8,913,156.48     |  |
|       |                       |                  |                  |  |

|    |    |                   |               |                   |  |
|----|----|-------------------|---------------|-------------------|--|
|    |    | ISRAEL FIXED BOND | 5,700,000.00  | 5,704,646.07      |  |
|    | 小計 | 銘柄数：10            | 61,400,000.00 | 59,908,958.48     |  |
|    |    |                   |               | (2,268,710,321)   |  |
|    |    | 組入時価比率：0.3%       |               | 0.3%              |  |
| 合計 |    |                   |               | 669,729,928,066   |  |
|    |    |                   |               | (669,729,928,066) |  |

(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(2023年 2月17日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄               | 券面総額       | 備考 |
|------|-----|------------------|------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY N/B  | 24,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 18,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 10,385,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 2,500,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 33,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 30,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 85,000     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 14,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 875,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 5,000,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 85,000     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 85,000     |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 50,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 13,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 15,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 21,570,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 23,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 170,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 170,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,870,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 14,450,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 170,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 200,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 19,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 425,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 85,000     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 10,877,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 15,600,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,000,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 5,000,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 30,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 24,500,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 6,000,000  |    |
|      |     | 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          | 24,000,000 |  |
|           | US TREASURY N/B          | 29,000,000 |  |
|           | US TREASURY N/B          | 8,000,000  |  |
|           | US TREASURY N/B          | 23,000,000 |  |
|           | US TREASURY N/B          | 14,000,000 |  |
|           | US TREASURY N/B          | 38,000,000 |  |
|           | US TREASURY N/B          | 850,000    |  |
| 豪ドル       | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 3,900,000  |  |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 10,000,000 |  |
| 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  | 570,000    |  |
| 新シェケル     | ISRAEL FIXED BOND        | 1,800,000  |  |
|           | ISRAEL FIXED BOND        | 5,015,000  |  |
| ユーロ       | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,295,000  |  |
|           | BUNDESOBLIGATION         | 2,507,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 850,000    |  |
|           | BUNDESOBLIGATION         | 1,700,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 595,000    |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 14,640,000 |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,664,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 356,000    |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,000,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,550,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,200,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 10,400,000 |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,500,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,200,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,400,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,000,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,000,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,100,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 18,000,000 |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5,800,000  |  |
|           | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 16,000,000 |  |
|           | FRANCE (GOVT OF)         | 11,600,000 |  |
|           | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1,000,000  |  |
|           | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1,000,000  |  |
|           | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,570,000  |  |
|           | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,500,000  |  |
|           | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,570,000  |  |
|           | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,600,000  |  |
|           | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 9,061,000  |  |
|           | SPANISH GOVERNMENT       | 10,000,000 |  |
|           | SPANISH GOVERNMENT       | 24,030,000 |  |
|           | SPANISH GOVERNMENT       | 4,870,000  |  |
|           |                          |            |  |

|  |                          |            |  |
|--|--------------------------|------------|--|
|  | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 1,200,000  |  |
|  | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 8,300,000  |  |
|  | REPUBLIC OF AUSTRIA      | 3,900,000  |  |
|  | BUONI POLIENNALI DEL TES | 850,000    |  |
|  | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,300,000  |  |
|  | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,100,000  |  |
|  | BUONI POLIENNALI DEL TES | 15,810,000 |  |
|  | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,800,000  |  |

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類        | 2023年 2月17日現在 |       |             |           |
|-----------|---------------|-------|-------------|-----------|
|           | 契約額等（円）       |       | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|           |               | うち1年超 |             |           |
| 市場取引以外の取引 |               |       |             |           |
| 為替予約取引    |               |       |             |           |
| 買建        | 315,929,017   | -     | 317,780,930 | 1,851,913 |
| 米ドル       | 173,131,777   | -     | 174,625,230 | 1,493,453 |
| ユーロ       | 142,797,240   | -     | 143,155,700 | 358,460   |
| 合計        | 315,929,017   | -     | 317,780,930 | 1,851,913 |

## （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。

## 新興国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

(2023年 2月17日現在)

|      |               |
|------|---------------|
| 資産の部 |               |
| 流動資産 |               |
| 預金   | 2,595,259,155 |

(2023年 2月17日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| コール・ローン         | 963,865,181    |
| 株式              | 82,089,363,980 |
| 投資信託受益証券        | 3,755,688,585  |
| 投資証券            | 106,295,375    |
| 派生商品評価勘定        | 1,652,980      |
| 未収配当金           | 132,100,981    |
| 差入委託証拠金         | 1,431,138,335  |
| 流動資産合計          | 91,075,364,572 |
| 資産合計            | 91,075,364,572 |
| 負債の部            |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 112,047,936    |
| 未払解約金           | 837,675,074    |
| 未払利息            | 230            |
| その他未払費用         | 1,731,000      |
| 流動負債合計          | 951,454,240    |
| 負債合計            | 951,454,240    |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 56,190,680,938 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 33,933,229,394 |
| 元本等合計           | 90,123,910,332 |
| 純資産合計           | 90,123,910,332 |
| 負債純資産合計         | 91,075,364,572 |

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法     | <p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
| 2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|                        |                                                                                                                                                                                                                              |
|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                        | <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>                                             |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.6039円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (16,039円) |

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針                 | <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>                                                                                                                                                                                                                                         |
| 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク        | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 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

| 2023年 2月17日現在                                        |  |
|------------------------------------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                   |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ |  |
| ん。                                                   |  |
| 2. 時価の算定方法                                           |  |
| 株式                                                   |  |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。                       |  |
| 投資信託受益証券                                             |  |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。                       |  |
| 投資証券                                                 |  |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。                       |  |
| 派生商品評価勘定                                             |  |
| デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。                        |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務                                  |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており |  |
| ます。                                                  |  |

### （その他の注記）

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年 2月17日現在                    |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| 期首                               | 2022年 2月18日     |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 44,775,261,155円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 16,697,202,502円 |
| 同期中における一部解約元本額                   | 5,281,782,719円  |
| 期末元本額                            | 56,190,680,938円 |
| 期末元本額の内訳＊                        |                 |
| 野村資産設計ファンド2015                   | 18,497,472円     |
| 野村資産設計ファンド2020                   | 19,991,799円     |
| 野村資産設計ファンド2025                   | 32,790,988円     |
| 野村資産設計ファンド2030                   | 51,741,862円     |
| 野村資産設計ファンド2035                   | 49,340,011円     |
| 野村資産設計ファンド2040                   | 87,137,592円     |
| 野村資産設計ファンド2045                   | 19,287,677円     |
| 野村インデックスファンド・新興国株式               | 3,790,643,180円  |

|                                                          |                 |
|----------------------------------------------------------|-----------------|
| ネクストコア                                                   | 17,687,729円     |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス                                   | 543,073,718円    |
| 野村資産設計ファンド2050                                           | 22,039,152円     |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型                       | 5,613,594円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型                       | 3,622,636円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型                       | 2,840,146円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型                       | 2,589,348円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                        | 2,095,624円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                        | 1,954,748円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                        | 16,617,629円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                        | 5,019,562円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                        | 20,961,035円     |
| 野村つみたて外国株投信                                              | 5,629,893,350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）                      | 1,170,264,087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）                      | 2,151,481,914円  |
| 世界6資産分散ファンド                                              | 112,611,520円    |
| 野村資産設計ファンド2060                                           | 17,527,163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 | 1,296,842,871円  |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式                                   | 3,195,516,012円  |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）                           | 3,704,036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）                      | 1,899,244,063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）           | 735,718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）                              | 35,167,252,607円 |
| 野村DC運用戦略ファンド                                             | 655,766,363円    |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）                                       | 45,027,417円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030                              | 22,166,441円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040                              | 20,933,470円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050                              | 15,860,360円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060                              | 11,855,735円     |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）                            | 60,452,309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(2023年2月17日現在)

| 種類 | 通貨  | 銘柄                               | 株式数     | 評価額  |            | 備考 |
|----|-----|----------------------------------|---------|------|------------|----|
|    |     |                                  |         | 単価   | 金額         |    |
| 株式 | 米ドル | INNER MONGOLIA YITAI COAL CO LTD | 85,000  | 1.37 | 117,130.00 |    |
|    |     | 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 | 13,420  | 95.69  | 1,284,159.80 |
| CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 21,600  | 7.36   | 158,976.00   |
| 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                  | 2,355   | 0.00   | 0.00         |
| SEVERSTAL-GDR REG S          | 15,800  | 0.00   | 0.00         |
| SOUTHERN COPPER CORP         | 7,990   | 76.10  | 608,039.00   |
| ZTO EXPRESS CAYMAN INC       | 40,700  | 25.75  | 1,048,025.00 |
| NIO INC ADR                  | 128,700 | 10.19  | 1,311,453.00 |
| H WORLD GROUP LTD-ADR        | 18,800  | 51.81  | 974,028.00   |
| TRIP.COM GROUP LTD-ADR       | 52,600  | 38.05  | 2,001,430.00 |
| YUM CHINA HOLDINGS INC       | 40,500  | 60.38  | 2,445,390.00 |
| OZON HOLDINGS PLC - ADR      | 5,300   | 0.00   | 0.00         |
| PDD HOLDINGS INC ADR         | 48,790  | 96.79  | 4,722,384.10 |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS   | 41,400  | 14.27  | 590,778.00   |
| 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   | 15.77  | 111,967.00   |
| LEGEND BIOTECH CORP-ADR      | 4,500   | 49.04  | 220,680.00   |
| ZAI LAB LTD - ADR            | 8,770   | 37.12  | 325,542.40   |
| BANCO DE CHILE-ADR           | 21,400  | 21.89  | 468,446.00   |
| BANCO SANTANDER CHILE-ADR    | 19,600  | 17.50  | 343,000.00   |
| BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR   | 10,030  | 27.10  | 271,813.00   |
| COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG | 260,036 | 1.64   | 426,459.04   |
| CREDICORP LTD                | 6,350   | 129.03 | 819,340.50   |
| PJSC SBERBANK OF RUSSIA      | 811,000 | 0.00   | 0.00         |
| STATE BANK OF INDIA-GDR      | 16,980  | 64.60  | 1,096,908.00 |

|        |                                   |             |        |                 |  |
|--------|-----------------------------------|-------------|--------|-----------------|--|
|        | 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      | 3.18   | 120,149.90      |  |
|        | DAQO NEW ENERGY CORP-ADR          | 6,020       | 43.37  | 261,087.40      |  |
|        | MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR         | 28,650      | 0.00   | 0.00            |  |
|        | ENEL CHILE SA-ADR                 | 42,900      | 2.24   | 96,096.00       |  |
|        | INTER RAO UES PJSC                | 3,660,000   | 0.00   | 0.00            |  |
|        | 360 DIGITECH INC-ADR              | 12,100      | 21.67  | 262,207.00      |  |
|        | LUFAX HOLDING LTD                 | 67,100      | 2.55   | 171,105.00      |  |
|        | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC    | 133,000     | 0.00   | 0.00            |  |
|        | TAL EDUCATION GROUP-ADR           | 39,000      | 7.73   | 301,470.00      |  |
|        | KE HOLDINGS INC ADR               | 65,800      | 19.49  | 1,282,442.00    |  |
|        | SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B      | 87,648      | 0.79   | 69,592.51       |  |
|        | IQIYI INC-ADR                     | 41,500      | 7.20   | 298,800.00      |  |
|        | TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR      | 71,500      | 8.27   | 591,305.00      |  |
|        | AUTOHOME INC-ADR                  | 7,500       | 35.83  | 268,725.00      |  |
|        | JOYY INC                          | 4,250       | 34.70  | 147,475.00      |  |
|        | KANZHUN LTD                       | 19,900      | 23.83  | 474,217.00      |  |
|        | VK CO LTD GDR                     | 7,000       | 0.00   | 0.00            |  |
|        | WEIBO CORP-SPON ADR               | 8,900       | 22.45  | 199,805.00      |  |
|        | YANDEX NV-A                       | 23,640      | 0.00   | 0.00            |  |
| 小計     | 銘柄数：59                            |             |        | 23,890,425.65   |  |
|        |                                   |             |        | (3,210,873,207) |  |
|        | 組入時価比率：3.6%                       |             |        | 3.9%            |  |
| メキシコペソ | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV      | 93,958      | 37.06  | 3,482,083.48    |  |
|        | CEMEX SAB - CPO                   | 1,455,985   | 9.61   | 13,992,015.85   |  |
|        | GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B     | 305,983     | 83.62  | 25,586,298.46   |  |
|        | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV      | 16,210      | 235.76 | 3,821,669.60    |  |
|        | ALFA S.A.B.-A                     | 218,000     | 12.52  | 2,729,360.00    |  |
|        | GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1      | 34,900      | 90.76  | 3,167,524.00    |  |
|        | GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B      | 18,900      | 513.82 | 9,711,198.00    |  |
|        | GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH      | 37,000      | 357.98 | 13,245,260.00   |  |
|        | PROMOTORA Y OPERADORA DE INF      | 28,300      | 175.26 | 4,959,858.00    |  |
|        | WALMART DE MEXICO-SER V           | 492,000     | 71.05  | 34,956,600.00   |  |
|        | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV        | 44,000      | 154.06 | 6,778,640.00    |  |

|     |                              |           |        |                 |  |
|-----|------------------------------|-----------|--------|-----------------|--|
|     | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV    | 52,000    | 129.76 | 6,747,520.00    |  |
|     | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 182,700   | 175.59 | 32,080,293.00   |  |
|     | GRUMA S.A.B.-B               | 23,900    | 252.94 | 6,045,266.00    |  |
|     | GRUPO BIMBO SAB-SERIES A     | 131,000   | 89.05  | 11,665,550.00   |  |
|     | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A   | 143,000   | 36.49  | 5,218,070.00    |  |
|     | BANCO DEL BAJIO SA           | 68,000    | 70.47  | 4,791,960.00    |  |
|     | GRUPO FINANCIERO BANORTE-O   | 243,800   | 164.06 | 39,997,828.00   |  |
|     | GRUPO FINANCIERO INBURSA-O   | 209,000   | 39.78  | 8,314,020.00    |  |
|     | AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 2,678,000 | 19.01  | 50,908,780.00   |  |
|     | GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO | 201,000   | 21.61  | 4,343,610.00    |  |
| 小計  | 銘柄数：21                       |           |        | 292,543,404.39  |  |
|     |                              |           |        | (2,118,804,114) |  |
|     | 組入時価比率：2.4%                  |           |        | 2.6%            |  |
| リアル | COSAN SA                     | 136,000   | 15.91  | 2,163,760.00    |  |
|     | PETRO RIO SA                 | 65,300    | 40.25  | 2,628,325.00    |  |
|     | PETROBRAS - PETROLEO BRAS    | 359,000   | 30.15  | 10,823,850.00   |  |
|     | PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR   | 460,000   | 26.85  | 12,351,000.00   |  |
|     | ULTRAPAR PARTICIPACOES       | 86,000    | 12.89  | 1,108,540.00    |  |
|     | BRASKEM SA-PREF A            | 13,200    | 20.30  | 267,960.00      |  |
|     | KLABIN SA-UNIT               | 61,000    | 19.70  | 1,201,700.00    |  |
|     | CIA SIDERURGICA NACIONAL SA  | 81,000    | 17.96  | 1,454,760.00    |  |
|     | GERDAU SA PFD NPV            | 112,000   | 28.86  | 3,232,320.00    |  |
|     | VALE SA                      | 369,052   | 89.19  | 32,915,747.88   |  |
|     | SUZANO SA                    | 67,560    | 47.76  | 3,226,665.60    |  |
|     | WEG SA                       | 155,748   | 38.78  | 6,039,907.44    |  |
|     | LOCALIZA RENT A CAR          | 71,560    | 58.09  | 4,156,920.40    |  |
|     | LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHT | 312       | 15.84  | 4,942.08        |  |
|     | RUMO SA                      | 123,000   | 17.95  | 2,207,850.00    |  |
|     | CCR SA                       | 121,000   | 11.08  | 1,340,680.00    |  |
|     | MAGAZINE LUIZA SA            | 230,000   | 3.81   | 876,300.00      |  |
|     | LOJAS RENNER S.A.            | 88,974    | 19.38  | 1,724,316.12    |  |
|     | VIBRA ENERGIA SA             | 113,500   | 15.58  | 1,768,330.00    |  |
|     | ATACADAO SA                  | 54,000    | 14.97  | 808,380.00      |  |
|     | RAIA DROGASIL SA             | 102,000   | 23.30  | 2,376,600.00    |  |
|     | SENDAS DISTRIBUIDORA SA      | 84,000    | 19.01  | 1,596,840.00    |  |

|                                        |                           |           |                 |                |
|----------------------------------------|---------------------------|-----------|-----------------|----------------|
| AMBEV SA                               | 464,956                   | 13.08     | 6,081,624.48    |                |
| BRF SA                                 | 63,000                    | 6.77      | 426,510.00      |                |
| JBS SA                                 | 74,600                    | 19.01     | 1,418,146.00    |                |
| NATURA &CO HOLDING SA                  | 92,500                    | 15.36     | 1,420,800.00    |                |
| HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS  | 420,987                   | 5.13      | 2,159,663.31    |                |
| REDE D'OR SAO LUIZ SA                  | 65,300                    | 29.07     | 1,898,271.00    |                |
| HYPERA SA                              | 33,000                    | 46.33     | 1,528,890.00    |                |
| BANCO BRADESCO S.A.                    | 156,953                   | 12.22     | 1,917,965.66    |                |
| BANCO BRADESCO SA - PREF               | 499,042                   | 14.02     | 6,996,568.84    |                |
| BANCO DO BRASIL SA                     | 91,000                    | 42.40     | 3,858,400.00    |                |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) SA            | 43,700                    | 29.55     | 1,291,335.00    |                |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF          | 467,991                   | 26.97     | 12,621,717.27   |                |
| ITAUSA SA                              | 492,018                   | 8.76      | 4,310,077.68    |                |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES            | 67,000                    | 35.37     | 2,369,790.00    |                |
| TOTVS SA                               | 61,000                    | 28.50     | 1,738,500.00    |                |
| TELEFONICA BRASIL S.A.                 | 41,605                    | 40.48     | 1,684,170.40    |                |
| TIM SA                                 | 82,952                    | 12.13     | 1,006,207.76    |                |
| CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B | 29,000                    | 37.33     | 1,082,570.00    |                |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER           | 121,100                   | 35.97     | 4,355,967.00    |                |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF       | 135,987                   | 10.94     | 1,487,697.78    |                |
| CPFL ENERGIA SA                        | 18,400                    | 30.93     | 569,112.00      |                |
| ENERGISA SA-UNITS                      | 20,800                    | 39.99     | 831,792.00      |                |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD            | 91,000                    | 26.48     | 2,409,680.00    |                |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP            | 33,600                    | 55.04     | 1,849,344.00    |                |
| B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO              | 596,999                   | 11.37     | 6,787,878.63    |                |
| BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT            | 109,000                   | 21.39     | 2,331,510.00    |                |
| ENGIE BRASIL SA                        | 16,600                    | 39.05     | 648,230.00      |                |
| 小計銘柄数：49                               |                           |           | 169,358,113.33  |                |
|                                        |                           |           | (4,354,688,232) |                |
| 組入時価比率：4.8%                            |                           |           | 5.3%            |                |
| チリペソ                                   | EMPRESAS COPEC SA         | 33,400    | 5,974.00        | 199,531,600.00 |
|                                        | EMPRESAS CMPC SA          | 119,000   | 1,397.00        | 166,243,000.00 |
|                                        | CIA SUD AMERICANA VAPORES | 1,226,200 | 80.60           | 98,831,720.00  |
|                                        | S.A.C.I. FALABELLA        | 94,000    | 1,908.80        | 179,427,200.00 |

|  |         |                                         |           |           |                  |  |
|--|---------|-----------------------------------------|-----------|-----------|------------------|--|
|  | 小計      | CENCOSUD SA                             | 126,000   | 1,504.00  | 189,504,000.00   |  |
|  |         | BANCO DE CREDITO E INVERSION            | 6,282     | 26,130.00 | 164,148,660.00   |  |
|  |         | ENEL AMERICAS SA                        | 2,325,000 | 104.00    | 241,800,000.00   |  |
|  |         | 銘柄数：7                                   |           |           | 1,239,486,180.00 |  |
|  |         |                                         |           |           | (210,140,007)    |  |
|  | コロンビアペソ | 組入時価比率：0.2%                             |           |           | 0.3%             |  |
|  |         | BANCOLOMBIA SA                          | 28,900    | 39,400.00 | 1,138,660,000.00 |  |
|  |         | INTERCONEXION ELECTRICA SA              | 33,800    | 18,800.00 | 635,440,000.00   |  |
|  |         | 銘柄数：2                                   |           |           | 1,774,100,000.00 |  |
|  | ユーロ     |                                         |           |           | (48,347,773)     |  |
|  |         | 組入時価比率：0.1%                             |           |           | 0.1%             |  |
|  |         | MYTILINEOS S.A.                         | 12,000    | 24.60     | 295,200.00       |  |
|  |         | FF GROUP                                | 2,030     | 0.00      | 0.00             |  |
|  | トルコリラ   | OPAP SA                                 | 20,200    | 15.06     | 304,212.00       |  |
|  |         | JUMBO SA                                | 10,732    | 18.77     | 201,439.64       |  |
|  |         | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS             | 206,500   | 1.35      | 279,497.75       |  |
|  |         | EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS | 282,800   | 1.30      | 369,761.00       |  |
|  |         | NATIONAL BANK OF GREECE                 | 43,700    | 4.67      | 204,297.50       |  |
|  |         | HELLENIC TELECOM                        | 18,000    | 15.42     | 277,560.00       |  |
|  |         | PUBLIC POWER CORP                       | 20,000    | 8.05      | 161,000.00       |  |
|  |         | TERNA ENERGY SA                         | 5,100     | 18.57     | 94,707.00        |  |
|  |         | 銘柄数：10                                  |           |           | 2,187,674.89     |  |
|  |         |                                         |           |           | (313,275,044)    |  |
|  |         | 組入時価比率：0.3%                             |           |           | 0.4%             |  |
|  | トルコリラ   | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE            | 12,700    | 630.40    | 8,006,080.00     |  |
|  |         | HEKTAS TICARET T.A.S                    | 100,000   | 33.66     | 3,366,000.00     |  |
|  |         | SASA POLYESTER SANAYI                   | 39,000    | 111.60    | 4,352,400.00     |  |
|  |         | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK            | 116,000   | 44.50     | 5,162,000.00     |  |
|  |         | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI               | 62,460    | 56.95     | 3,557,097.00     |  |
|  |         | KOC HLDGS                               | 85,000    | 74.95     | 6,370,750.00     |  |
|  |         | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS         | 150,000   | 45.26     | 6,789,000.00     |  |
|  |         | TURK HAVA YOLLARI AO                    | 44,000    | 140.00    | 6,160,000.00     |  |
|  |         | FORD OTOMOTIVE SANAYI AS                | 6,200     | 553.00    | 3,428,600.00     |  |
|  |         | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS               | 45,000    | 134.10    | 6,034,500.00     |  |
|  |         | AKBANK T.A.S                            | 325,000   | 16.10     | 5,232,500.00     |  |

|        |                               |         |           |                |  |
|--------|-------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
|        | HACI OMER SABANCI HOLDING     | 81,000  | 40.04     | 3,243,240.00   |  |
|        | TURKIYE IS BANKASI AS-C       | 383,995 | 11.05     | 4,243,144.75   |  |
|        | YAPI VE KREDI BANKASI A.S.    | 260,000 | 9.12      | 2,371,200.00   |  |
|        | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS   | 117,000 | 35.30     | 4,130,100.00   |  |
| 小計     | 銘柄数：15                        |         |           | 72,446,611.75  |  |
|        |                               |         |           | (516,131,396)  |  |
|        | 組入時価比率：0.6%                   |         |           | 0.6%           |  |
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS             | 5,050   | 734.00    | 3,706,700.00   |  |
|        | MONETA MONEY BANK AS          | 42,000  | 87.70     | 3,683,400.00   |  |
|        | CEZ AS                        | 15,500  | 1,017.00  | 15,763,500.00  |  |
| 小計     | 銘柄数：3                         |         |           | 23,153,600.00  |  |
|        |                               |         |           | (140,118,641)  |  |
|        | 組入時価比率：0.2%                   |         |           | 0.2%           |  |
| フォリント  | MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC | 37,500  | 2,792.00  | 104,700,000.00 |  |
|        | RICHTER GEDEON NYRT           | 11,700  | 7,880.00  | 92,196,000.00  |  |
|        | OTP BANK NYRT                 | 22,300  | 11,175.00 | 249,202,500.00 |  |
| 小計     | 銘柄数：3                         |         |           | 446,098,500.00 |  |
|        |                               |         |           | (166,453,179)  |  |
|        | 組入時価比率：0.2%                   |         |           | 0.2%           |  |
| ズロチ    | POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.   | 59,587  | 63.30     | 3,771,857.10   |  |
|        | KGHM POLSKA MIEDZ S.A.        | 13,800  | 134.00    | 1,849,200.00   |  |
|        | LPP SA                        | 94      | 9,850.00  | 925,900.00     |  |
|        | ALLEGRO.EU SA                 | 44,400  | 29.15     | 1,294,260.00   |  |
|        | PEPCO GROUP NV                | 21,700  | 43.58     | 945,686.00     |  |
|        | DINO POLSKA SA                | 4,910   | 368.00    | 1,806,880.00   |  |
|        | BANK PEKAO SA                 | 15,700  | 95.16     | 1,494,012.00   |  |
|        | MBANK                         | 1,100   | 327.20    | 359,920.00     |  |
|        | PKO BANK POLSKI SA            | 87,100  | 32.36     | 2,818,556.00   |  |
|        | SANTANDER BANK POLSKA SA      | 3,100   | 289.20    | 896,520.00     |  |
|        | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE  | 63,600  | 36.20     | 2,302,320.00   |  |
|        | POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA  | 73,000  | 6.76      | 493,918.00     |  |
|        | CYFROWY POLSAT SA             | 18,900  | 17.72     | 334,908.00     |  |
|        | CD PROJEKT RED SA             | 8,000   | 139.52    | 1,116,160.00   |  |
| 小計     | 銘柄数：14                        |         |           | 20,410,097.10  |  |
|        |                               |         |           | (612,670,294)  |  |
|        | 組入時価比率：0.7%                   |         |           | 0.7%           |  |

|      |                                          |           |       |               |  |
|------|------------------------------------------|-----------|-------|---------------|--|
| 香港ドル | CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY       | 367,000   | 0.00  | 0.00          |  |
|      | CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H            | 204,000   | 9.14  | 1,864,560.00  |  |
|      | CHINA COAL ENERGY CO-H                   | 150,000   | 5.95  | 892,500.00    |  |
|      | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H             | 2,510,900 | 4.16  | 10,445,344.00 |  |
|      | CHINA SHENHUA ENERGY CO - H              | 337,000   | 23.10 | 7,784,700.00  |  |
|      | PETROCHINA CO LTD-H                      | 2,030,000 | 4.12  | 8,363,600.00  |  |
|      | YANKUANG ENERGY GROUP CO-H               | 138,000   | 22.10 | 3,049,800.00  |  |
|      | DONGYUE GROUP LTD                        | 108,000   | 8.91  | 962,280.00    |  |
|      | ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H              | 107,000   | 29.05 | 3,108,350.00  |  |
|      | CHINA NATIONAL BUILDING MA-H             | 393,000   | 7.07  | 2,778,510.00  |  |
|      | CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD      | 176,000   | 4.35  | 765,600.00    |  |
|      | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H             | 490,000   | 4.00  | 1,960,000.00  |  |
|      | CHINA HONGQIAO GROUP LTD                 | 250,000   | 7.99  | 1,997,500.00  |  |
|      | CMOC GROUP LTD-H                         | 405,000   | 4.52  | 1,830,600.00  |  |
|      | GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD             | 31,640    | 64.50 | 2,040,780.00  |  |
|      | JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H             | 98,000    | 13.12 | 1,285,760.00  |  |
|      | SHANDONG GOLD MINING CO LTD              | 60,000    | 13.82 | 829,200.00    |  |
|      | ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H                | 94,000    | 8.23  | 773,620.00    |  |
|      | ZIJIN MINING GROUP CO-H                  | 559,000   | 12.08 | 6,752,720.00  |  |
|      | NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS              | 118,000   | 6.65  | 784,700.00    |  |
|      | AVICHINA INDUSTRY&TECH-H                 | 202,000   | 3.89  | 785,780.00    |  |
|      | CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD           | 92,000    | 8.67  | 797,640.00    |  |
|      | CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H | 174,400   | 2.87  | 500,528.00    |  |
|      | CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS             | 184,000   | 16.00 | 2,944,000.00  |  |
|      | CHINA RAILWAY GROUP LTD-H                | 420,000   | 4.18  | 1,755,600.00  |  |
|      | CHINA STATE CONSTRUCTION INT             | 227,250   | 9.38  | 2,131,605.00  |  |
|      | XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H              | 55,984    | 7.35  | 411,482.40    |  |
|      | CITIC LTD                                | 559,000   | 8.94  | 4,997,460.00  |  |
|      | FOSUN INTERNATIONAL LIMITED              | 225,940   | 7.33  | 1,656,140.20  |  |
|      | CRRC CORP LTD-H                          | 550,000   | 3.54  | 1,947,000.00  |  |
|      | HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS              | 57,000    | 21.30 | 1,214,100.00  |  |
|      | SANY HEAVY EQUIPMENT INTL                | 77,000    | 7.84  | 603,680.00    |  |
|      | WEICHAI POWER CO LTD-H                   | 214,800   | 11.78 | 2,530,344.00  |  |

|                                            |         |        |               |  |
|--------------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H              | 55,200  | 39.45  | 2,177,640.00  |  |
| BOC AVIATION LTD                           | 15,000  | 60.20  | 903,000.00    |  |
| CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT               | 281,000 | 3.31   | 930,110.00    |  |
| AIR CHINA LIMITED-H                        | 148,000 | 7.02   | 1,038,960.00  |  |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES H                  | 216,000 | 5.40   | 1,166,400.00  |  |
| COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD -<br>H      | 273,000 | 8.40   | 2,293,200.00  |  |
| ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL<br>LTD       | 10,500  | 125.10 | 1,313,550.00  |  |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL<br>AIRPORT-H | 204,000 | 5.91   | 1,205,640.00  |  |
| CHINA MERCHANTS PORT HOLDING               | 106,000 | 11.18  | 1,185,080.00  |  |
| COSCO SHIPPING PORTS LTD                   | 182,000 | 5.54   | 1,008,280.00  |  |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H                   | 148,000 | 7.49   | 1,108,520.00  |  |
| SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS<br>LIMITED | 129,000 | 7.05   | 909,450.00    |  |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY-H                      | 114,000 | 6.54   | 745,560.00    |  |
| FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO<br>LTD       | 62,000  | 36.70  | 2,275,400.00  |  |
| MINTH GROUP LTD                            | 66,000  | 20.80  | 1,372,800.00  |  |
| BYD CO LTD-H                               | 78,500  | 235.20 | 18,463,200.00 |  |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H                | 232,000 | 4.31   | 999,920.00    |  |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT               | 580,000 | 11.70  | 6,786,000.00  |  |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H                 | 307,000 | 11.48  | 3,524,360.00  |  |
| GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H               | 285,890 | 5.36   | 1,532,370.40  |  |
| LI AUTO INC                                | 108,400 | 98.90  | 10,720,760.00 |  |
| XPENG INC                                  | 91,500  | 37.25  | 3,408,375.00  |  |
| YADEA GROUP HOLDINGS LTD                   | 134,000 | 17.70  | 2,371,800.00  |  |
| HAIER SMART HOME CO LTD-H                  | 217,000 | 28.95  | 6,282,150.00  |  |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD                   | 118,800 | 105.10 | 12,485,880.00 |  |
| BOSIDENG INTL HLDGS LTD                    | 350,000 | 4.36   | 1,526,000.00  |  |
| LI NING CO LTD                             | 227,000 | 71.55  | 16,241,850.00 |  |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP               | 82,300  | 91.75  | 7,551,025.00  |  |
| XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS                | 105,000 | 9.28   | 974,400.00    |  |
| HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS LTD           | 286,000 | 1.86   | 531,960.00    |  |
| HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING<br>LTD.     | 111,000 | 19.70  | 2,186,700.00  |  |

|                                             |           |        |                |  |
|---------------------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS            | 57,000    | 20.25  | 1,154,250.00   |  |
| TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD               | 125,600   | 17.52  | 2,200,512.00   |  |
| ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED               | 1,430,380 | 102.10 | 146,041,798.00 |  |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION<br>TECHNOLOGY LT | 486,000   | 5.90   | 2,867,400.00   |  |
| JD HEALTH INTERNATIONAL INC                 | 106,900   | 57.05  | 6,098,645.00   |  |
| JD.COM, INC.                                | 208,067   | 212.60 | 44,235,044.20  |  |
| MEITUAN-CLASS B                             | 485,540   | 148.30 | 72,005,582.00  |  |
| PING AN HEALTHCARE AND<br>TECHNOLOGY CO LTD | 36,600    | 19.42  | 710,772.00     |  |
| CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS<br>LIMITED      | 84,000    | 20.90  | 1,755,600.00   |  |
| CHINA TOURISM GROUP DUTY F CO<br>LTD        | 6,100     | 218.00 | 1,329,800.00   |  |
| CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP<br>LTD        | 175,800   | 15.84  | 2,784,672.00   |  |
| POP MART INTERNATIONAL GROUP                | 44,600    | 22.55  | 1,005,730.00   |  |
| TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD                | 202,000   | 7.16   | 1,446,320.00   |  |
| ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS                   | 55,000    | 43.70  | 2,403,500.00   |  |
| ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD              | 12,300    | 141.00 | 1,734,300.00   |  |
| CHINA RESOURCES BEER HOLDIN                 | 151,333   | 59.55  | 9,011,880.15   |  |
| NONGFU SPRING LTD                           | 175,400   | 43.80  | 7,682,520.00   |  |
| TSING TAO BREWERY CO-H                      | 60,000    | 78.80  | 4,728,000.00   |  |
| CHINA FEIHE LTD                             | 405,000   | 6.79   | 2,749,950.00   |  |
| CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO<br>LTD      | 144,000   | 0.00   | 0.00           |  |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO                      | 309,000   | 37.05  | 11,448,450.00  |  |
| DALI FOODS GROUP CO LTD                     | 240,000   | 3.43   | 823,200.00     |  |
| TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO                  | 168,000   | 13.04  | 2,190,720.00   |  |
| UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD            | 125,000   | 7.27   | 908,750.00     |  |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD                | 388,000   | 5.06   | 1,963,280.00   |  |
| YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD             | 55,000    | 24.55  | 1,350,250.00   |  |
| SMOORE INTERNATIONAL HOLDING                | 147,000   | 10.42  | 1,531,740.00   |  |
| VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS                | 23,000    | 22.40  | 515,200.00     |  |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD                    | 60,000    | 37.15  | 2,229,000.00   |  |
| MICROPORT SCIENTIFIC CORP                   | 47,000    | 23.30  | 1,095,100.00   |  |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H                | 248,000   | 13.32  | 3,303,360.00   |  |

|                                          |           |        |               |  |
|------------------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO            | 39,400    | 59.25  | 2,334,450.00  |  |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H               | 50,900    | 13.70  | 697,330.00    |  |
| SINOPHARM GROUP CO-H                     | 132,400   | 21.50  | 2,846,600.00  |  |
| 3SBIO, INC                               | 119,000   | 8.30   | 987,700.00    |  |
| BEIGENE LTD                              | 60,620    | 143.60 | 8,705,032.00  |  |
| INNOVENT BIOLOGICS INC                   | 104,000   | 40.40  | 4,201,600.00  |  |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING             | 158,000   | 12.96  | 2,047,680.00  |  |
| CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD | 179,500   | 6.24   | 1,120,080.00  |  |
| CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE       | 248,000   | 4.30   | 1,066,400.00  |  |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED        | 891,520   | 8.75   | 7,800,800.00  |  |
| HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP              | 130,000   | 14.60  | 1,898,000.00  |  |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H             | 58,000    | 24.00  | 1,392,000.00  |  |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL                   | 1,021,500 | 4.24   | 4,331,160.00  |  |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H             | 2,980,000 | 2.77   | 8,254,600.00  |  |
| BANK OF CHINA LTD-H                      | 7,660,000 | 2.93   | 22,443,800.00 |  |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H              | 940,790   | 4.80   | 4,515,792.00  |  |
| CHINA CITIC BANK-H                       | 810,000   | 3.71   | 3,005,100.00  |  |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H                | 9,278,000 | 4.93   | 45,740,540.00 |  |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H             | 257,000   | 2.34   | 601,380.00    |  |
| CHINA MERCHANTS BANK-H                   | 376,692   | 44.70  | 16,838,132.40 |  |
| CHINA MINSHENG BANKING-H                 | 589,800   | 2.83   | 1,669,134.00  |  |
| IND & COMM BK OF CHINA-H                 | 5,440,000 | 3.98   | 21,651,200.00 |  |
| POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H           | 853,000   | 4.93   | 4,205,290.00  |  |
| FAR EAST HORIZON LTD                     | 154,000   | 7.00   | 1,078,000.00  |  |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H                | 718,000   | 13.66  | 9,807,880.00  |  |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H             | 261,000   | 22.30  | 5,820,300.00  |  |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING          | 103,472   | 9.65   | 998,504.80    |  |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H             | 72,000    | 19.86  | 1,429,920.00  |  |
| PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H             | 850,000   | 2.56   | 2,176,000.00  |  |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H              | 634,420   | 7.26   | 4,605,889.20  |  |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H             | 610,500   | 57.45  | 35,073,225.00 |  |
| ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H           | 58,000    | 21.90  | 1,270,200.00  |  |
| CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED          | 280,000   | 6.04   | 1,691,200.00  |  |

|                                          |           |        |               |  |
|------------------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| GDS HOLDINGS LIMITED                     | 84,200    | 22.30  | 1,877,660.00  |  |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H               | 109,000   | 16.28  | 1,774,520.00  |  |
| KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD       | 264,000   | 16.84  | 4,445,760.00  |  |
| BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD      | 51,500    | 26.55  | 1,367,325.00  |  |
| ZTE CORP-H                               | 76,052    | 20.95  | 1,593,289.40  |  |
| LENOVO GROUP LTD                         | 718,000   | 7.00   | 5,026,000.00  |  |
| XIAOMI CORPORATION                       | 1,474,000 | 13.14  | 19,368,360.00 |  |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC            | 52,000    | 19.00  | 988,000.00    |  |
| KINGBOARD HOLDINGS LTD                   | 60,000    | 30.80  | 1,848,000.00  |  |
| KINGBOARD LAMINATES HOLDING              | 65,000    | 10.60  | 689,000.00    |  |
| SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD    | 69,200    | 99.60  | 6,892,320.00  |  |
| FLAT GLASS GROUP CO LTD                  | 49,000    | 21.15  | 1,036,350.00  |  |
| GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD              | 1,956,000 | 2.17   | 4,244,520.00  |  |
| HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD               | 46,000    | 30.55  | 1,405,300.00  |  |
| SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO | 32,000    | 29.05  | 929,600.00    |  |
| XINYI SOLAR HOLDINGS LTD                 | 468,000   | 9.17   | 4,291,560.00  |  |
| CHINA TOWER CORP LTD                     | 4,300,000 | 0.87   | 3,741,000.00  |  |
| BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD         | 36,000    | 26.45  | 952,200.00    |  |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD                   | 318,000   | 12.10  | 3,847,800.00  |  |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT             | 86,000    | 33.75  | 2,902,500.00  |  |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD                  | 78,000    | 121.00 | 9,438,000.00  |  |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD                | 316,000   | 6.61   | 2,088,760.00  |  |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR             | 405,000   | 1.97   | 797,850.00    |  |
| GUANGDONG INVESTMENT                     | 338,000   | 8.43   | 2,849,340.00  |  |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H             | 620,000   | 1.08   | 669,600.00    |  |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H             | 266,000   | 3.94   | 1,048,040.00  |  |
| CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H     | 172,400   | 17.06  | 2,941,144.00  |  |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H                | 190,050   | 17.02  | 3,234,651.00  |  |
| GF SECURITIES CO LTD-H                   | 82,600    | 11.50  | 949,900.00    |  |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H              | 268,000   | 5.22   | 1,398,960.00  |  |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H               | 126,000   | 9.15   | 1,152,900.00  |  |
| KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING              | 35,500    | 50.25  | 1,783,875.00  |  |

|                                        |           |        |                |  |
|----------------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY    | 149,000   | 32.05  | 4,775,450.00   |  |
| CGN POWER CO LTD-H                     | 980,000   | 1.81   | 1,773,800.00   |  |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H           | 366,000   | 11.12  | 4,069,920.00   |  |
| CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT  | 490,000   | 3.41   | 1,670,900.00   |  |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDING          | 192,000   | 17.24  | 3,310,080.00   |  |
| HUANENG POWER INTL INC-H               | 410,000   | 4.12   | 1,689,200.00   |  |
| GENSCRIPT BIOTECH CORP                 | 112,000   | 22.00  | 2,464,000.00   |  |
| HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD    | 15,500    | 94.85  | 1,470,175.00   |  |
| PHARMARON BEIJING CO LTD               | 14,400    | 47.00  | 676,800.00     |  |
| WUXI APPTTEC CO LTD                    | 30,500    | 90.00  | 2,745,000.00   |  |
| WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC              | 349,500   | 57.85  | 20,218,575.00  |  |
| C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD | 73,000    | 26.00  | 1,898,000.00   |  |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD        | 410,000   | 1.66   | 680,600.00     |  |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT       | 380,000   | 19.72  | 7,493,600.00   |  |
| CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD           | 155,000   | 9.78   | 1,515,900.00   |  |
| CHINA RESOURCES LAND LTD               | 310,444   | 36.20  | 11,238,072.80  |  |
| CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY           | 71,000    | 44.45  | 3,155,950.00   |  |
| CHINA VANKE CO LTD-H                   | 170,000   | 14.50  | 2,465,000.00   |  |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO             | 1,134,380 | 2.58   | 2,926,700.40   |  |
| COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD           | 173,000   | 16.56  | 2,864,880.00   |  |
| GREENTOWN CHINA HOLDINGS               | 98,000    | 10.88  | 1,066,240.00   |  |
| GREENTOWN SERVICE GROUP CO.LTD.        | 128,000   | 5.29   | 677,120.00     |  |
| LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD             | 187,000   | 25.40  | 4,749,800.00   |  |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD                 | 175,000   | 11.44  | 2,002,000.00   |  |
| CHINA LITERATURE LTD                   | 49,800    | 38.90  | 1,937,220.00   |  |
| BILIBILI INC                           | 19,120    | 182.20 | 3,483,664.00   |  |
| CHINA RUYI HOLDINGS LTD                | 368,000   | 1.87   | 688,160.00     |  |
| KINGSOFT CORP LTD                      | 91,000    | 29.25  | 2,661,750.00   |  |
| NETEASE, INC.                          | 190,150   | 138.20 | 26,278,730.00  |  |
| BAIDU INC-CLASS A                      | 212,760   | 148.10 | 31,509,756.00  |  |
| KUAISHOU TECHNOLOGY                    | 166,900   | 61.90  | 10,331,110.00  |  |
| TENCENT HOLDINGS LTD                   | 603,100   | 382.60 | 230,746,060.00 |  |

|     |                                |           |        |                  |       |
|-----|--------------------------------|-----------|--------|------------------|-------|
| 小計  | 銘柄数：192                        |           |        | 1,260,184,366.35 |       |
|     | 組入時価比率：23.9%                   |           |        | (21,574,356,351) | 26.2% |
| リンギ | DIALOG GROUP BHD               | 313,044   | 2.58   | 807,653.52       |       |
|     | PETRONAS DAGANGAN BHD          | 30,000    | 22.16  | 664,800.00       |       |
|     | PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD   | 244,000   | 8.20   | 2,000,800.00     |       |
|     | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS | 399,000   | 5.25   | 2,094,750.00     |       |
|     | HAP SENG CONSOLIDATED          | 93,800    | 7.11   | 666,918.00       |       |
|     | SIME DARBY BERHAD              | 220,000   | 2.32   | 510,400.00       |       |
|     | MISC BHD                       | 125,960   | 7.48   | 942,180.80       |       |
|     | MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD    | 121,460   | 7.00   | 850,220.00       |       |
|     | GENTING BHD                    | 187,000   | 5.03   | 940,610.00       |       |
|     | GENTING MALAYSIA BHD           | 229,000   | 2.85   | 652,650.00       |       |
|     | MR DIY GROUP M BHD             | 187,500   | 1.81   | 339,375.00       |       |
|     | IOI CORP                       | 247,000   | 3.85   | 950,950.00       |       |
|     | KUALA LUMPUR KEPONG            | 42,400    | 22.10  | 937,040.00       |       |
|     | NESTLE (MALAYSIA) BERHAD       | 7,300     | 135.50 | 989,150.00       |       |
|     | PPB GROUP BERHAD               | 51,740    | 17.82  | 922,006.80       |       |
|     | QL RESOURCES BHD               | 119,000   | 5.90   | 702,100.00       |       |
|     | SIME DARBY PLANTATION BHD      | 238,000   | 4.35   | 1,035,300.00     |       |
|     | HARTALEGA HOLDINGS BHD         | 117,000   | 1.65   | 193,050.00       |       |
|     | TOP GLOVE CORP BHD             | 428,000   | 0.84   | 359,520.00       |       |
|     | IHH HEALTHCARE BHD             | 156,000   | 5.91   | 921,960.00       |       |
|     | AMMB HOLDING                   | 125,000   | 3.89   | 486,250.00       |       |
|     | CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD     | 683,000   | 5.43   | 3,708,690.00     |       |
|     | HONG LEONG BANK                | 60,960    | 20.40  | 1,243,584.00     |       |
|     | HONG LEONG FINANCIAL GROUP     | 13,422    | 18.14  | 243,475.08       |       |
|     | MALAYAN BANKING                | 435,000   | 8.77   | 3,814,950.00     |       |
|     | PUBLIC BANK BHD                | 1,368,000 | 4.17   | 5,704,560.00     |       |
|     | RHB BANK BHD                   | 125,023   | 5.52   | 690,126.96       |       |
|     | INARI AMERTRON BHD             | 271,000   | 2.59   | 701,890.00       |       |
|     | TELEKOM MALAYSIA               | 129,000   | 5.23   | 674,670.00       |       |
|     | AXIATA GROUP BERHAD            | 195,000   | 3.10   | 604,500.00       |       |
|     | DIGI.COM BERHAD                | 286,000   | 4.26   | 1,218,360.00     |       |
|     | MAXIS BHD                      | 265,000   | 4.08   | 1,081,200.00     |       |

|             |                                |           |        |                 |  |
|-------------|--------------------------------|-----------|--------|-----------------|--|
| 小計          | TENAGA NASIONAL                | 258,000   | 9.90   | 2,554,200.00    |  |
|             | PETRONAS GAS BERHAD            | 91,000    | 17.50  | 1,592,500.00    |  |
| 銘柄数：34      |                                |           |        | 41,800,390.16   |  |
|             |                                |           |        | (1,268,345,058) |  |
| 組入時価比率：1.4% |                                |           |        | 1.5%            |  |
|             |                                |           |        |                 |  |
| パーツ         | PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR     | 135,000   | 160.00 | 21,600,000.00   |  |
|             | PTT PCL-NVDR                   | 996,000   | 32.75  | 32,619,000.00   |  |
|             | THAI OIL PCL-NVDR              | 83,000    | 56.50  | 4,689,500.00    |  |
|             | INDORAMA VENTURES PCL-NVDR     | 187,967   | 39.50  | 7,424,696.50    |  |
|             | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR   | 227,994   | 49.50  | 11,285,703.00   |  |
|             | SIAM CEMENT PCL-NVDR           | 81,200    | 340.00 | 27,608,000.00   |  |
|             | SCG PACKAGING PLC-NVDR         | 150,000   | 52.00  | 7,800,000.00    |  |
|             | BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR    | 880,000   | 8.15   | 7,172,000.00    |  |
|             | AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR  | 411,000   | 72.75  | 29,900,250.00   |  |
|             | BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR | 810,000   | 9.45   | 7,654,500.00    |  |
|             | ASSET WORLD CORP PCL-NVDR      | 700,000   | 5.75   | 4,025,000.00    |  |
|             | MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR   | 270,978   | 33.75  | 9,145,507.50    |  |
|             | CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR   | 155,025   | 45.25  | 7,014,881.25    |  |
|             | HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR   | 579,997   | 14.80  | 8,583,955.60    |  |
|             | PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR   | 258,000   | 22.70  | 5,856,600.00    |  |
|             | BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR    | 73,700    | 37.75  | 2,782,175.00    |  |
|             | CP ALL PCL-NVDR                | 543,000   | 66.50  | 36,109,500.00   |  |
|             | CARABAO GROUP PCL-NVDR         | 20,900    | 105.50 | 2,204,950.00    |  |
|             | OSOTSPA PCL-NVDR               | 112,000   | 30.50  | 3,416,000.00    |  |
|             | CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR    | 426,000   | 22.80  | 9,712,800.00    |  |
|             | THAI UNION GROUP PCL-NVDR      | 199,800   | 15.80  | 3,156,840.00    |  |
|             | BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR   | 1,033,000 | 29.75  | 30,731,750.00   |  |
|             | BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR    | 59,000    | 215.00 | 12,685,000.00   |  |
|             | KASIKORNBANK PCL-NVDR          | 49,000    | 139.50 | 6,835,500.00    |  |
|             | KRUNG THAI BANK-NVDR           | 267,050   | 16.90  | 4,513,145.00    |  |
|             | SCB X PCL-NVDR                 | 81,000    | 99.50  | 8,059,500.00    |  |
|             | DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR    | 31,500    | 976.00 | 30,744,000.00   |  |
|             | TRUE CORP PCL-NVDR             | 920,000   | 5.10   | 4,692,000.00    |  |
|             | ADVANCED INFO SERVICE-NVDR     | 114,000   | 211.00 | 24,054,000.00   |  |
|             | INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR    | 140,000   | 75.00  | 10,500,000.00   |  |

|       |                                       |           |          |                 |  |
|-------|---------------------------------------|-----------|----------|-----------------|--|
|       | JMT NETWORK SERVICES-NVDR             | 51,000    | 45.50    | 2,320,500.00    |  |
|       | KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR               | 68,000    | 58.25    | 3,961,000.00    |  |
|       | MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR            | 49,000    | 35.00    | 1,715,000.00    |  |
|       | SRISAWAD CORP PCL-NVDR                | 63,000    | 54.50    | 3,433,500.00    |  |
|       | B GRIMM POWER PCL-NVDR                | 104,000   | 40.75    | 4,238,000.00    |  |
|       | ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR       | 33,300    | 172.00   | 5,727,600.00    |  |
|       | ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR              | 179,000   | 83.25    | 14,901,750.00   |  |
|       | GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR             | 59,000    | 71.25    | 4,203,750.00    |  |
|       | GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR          | 261,000   | 54.00    | 14,094,000.00   |  |
|       | RATCH GROUP PCL-NVDR                  | 115,000   | 42.50    | 4,887,500.00    |  |
|       | CENTRAL PATTANA PCL-NVDR              | 185,000   | 73.00    | 13,505,000.00   |  |
|       | LAND & HOUSES PUB - NVDR              | 1,010,000 | 9.75     | 9,847,500.00    |  |
| 小計    | 銘柄数：42                                |           |          | 465,411,853.85  |  |
|       |                                       |           |          | (1,810,452,111) |  |
|       | 組入時価比率：2.0%                           |           |          | 2.2%            |  |
| フィリピン | ABOITIZ EQUITY VENTURES INC           | 146,000   | 55.20    | 8,059,200.00    |  |
|       | AYALA CORPORATION                     | 28,302    | 670.00   | 18,962,340.00   |  |
|       | JG SUMMIT HOLDINGS INC                | 255,005   | 54.00    | 13,770,270.00   |  |
|       | SM INVESTMENTS CORP                   | 22,100    | 888.00   | 19,624,800.00   |  |
|       | INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS | 93,000    | 209.00   | 19,437,000.00   |  |
|       | JOLLIBEE FOODS CORPORATION            | 43,000    | 238.60   | 10,259,800.00   |  |
|       | MONDE NISSIN CORP                     | 680,000   | 12.16    | 8,268,800.00    |  |
|       | UNIVERSAL ROBINA CORP                 | 107,000   | 147.40   | 15,771,800.00   |  |
|       | BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS        | 193,999   | 105.10   | 20,389,294.90   |  |
|       | BDO UNIBANK INC                       | 249,997   | 124.20   | 31,049,627.40   |  |
|       | METROPOLITAN BANK & TRUST             | 205,095   | 61.00    | 12,510,795.00   |  |
|       | GLOBE TELECOM INC                     | 2,226     | 1,970.00 | 4,385,220.00    |  |
|       | PLDT INC                              | 7,000     | 1,330.00 | 9,310,000.00    |  |
|       | MANILA ELECTRIC COMPANY               | 16,900    | 309.00   | 5,222,100.00    |  |
|       | ACEN CORP                             | 617,479   | 7.00     | 4,322,353.00    |  |
|       | AYALA LAND INC                        | 768,000   | 29.60    | 22,732,800.00   |  |
|       | SM PRIME HOLDINGS INC                 | 1,065,975 | 37.85    | 40,347,153.75   |  |
| 小計    | 銘柄数：17                                |           |          | 264,423,354.05  |  |
|       |                                       |           |          | (644,796,348)   |  |
|       | 組入時価比率：0.7%                           |           |          | 0.8%            |  |

|     |                                |           |            |                    |  |
|-----|--------------------------------|-----------|------------|--------------------|--|
| ルピア | ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT  | 1,170,000 | 2,920.00   | 3,416,400,000.00   |  |
|     | UNITED TRACTORS TBK PT         | 147,050   | 24,650.00  | 3,624,782,500.00   |  |
|     | BARITO PACIFIC TBK PT          | 2,889,701 | 890.00     | 2,571,833,890.00   |  |
|     | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 377,079   | 7,525.00   | 2,837,519,475.00   |  |
|     | ANEKA TAMBANG TBK              | 760,000   | 2,110.00   | 1,603,600,000.00   |  |
|     | MERDEKA COPPER GOLD TBK PT     | 1,115,813 | 4,750.00   | 5,300,111,750.00   |  |
|     | VALE INDONESIA TBK             | 198,000   | 6,825.00   | 1,351,350,000.00   |  |
|     | INDAH KIAT PULP&PAPER          | 240,000   | 8,125.00   | 1,950,000,000.00   |  |
|     | PT ASTRA INTERNATIONAL TBK     | 1,890,000 | 5,700.00   | 10,773,000,000.00  |  |
|     | SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P   | 1,930,000 | 2,980.00   | 5,751,400,000.00   |  |
|     | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T   | 178,000   | 10,200.00  | 1,815,600,000.00   |  |
|     | INDOFOOD SUKSES MAK TBK        | 420,000   | 6,600.00   | 2,772,000,000.00   |  |
|     | PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA  | 700,000   | 5,800.00   | 4,060,000,000.00   |  |
|     | UNILEVER INDONESIA TBK PT      | 820,000   | 4,520.00   | 3,706,400,000.00   |  |
|     | KALBE FARMA PT                 | 2,300,000 | 2,290.00   | 5,267,000,000.00   |  |
|     | BANK CENTRAL ASIA              | 5,320,000 | 8,700.00   | 46,284,000,000.00  |  |
|     | BANK JAGO TBK PT               | 368,000   | 3,030.00   | 1,115,040,000.00   |  |
|     | BANK MANDIRI                   | 1,760,000 | 10,175.00  | 17,908,000,000.00  |  |
|     | BANK NEGARA INDONESIA PT       | 810,000   | 9,350.00   | 7,573,500,000.00   |  |
|     | BANK RAKYAT INDONESIA          | 6,780,028 | 4,870.00   | 33,018,736,360.00  |  |
|     | SARANA MENARA NUSANTARA PT     | 1,479,000 | 1,090.00   | 1,612,110,000.00   |  |
|     | TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK  | 4,880,000 | 3,770.00   | 18,397,600,000.00  |  |
| 小計  | 銘柄数：22                         |           |            | 182,709,983,975.00 |  |
|     |                                |           |            | (1,626,118,857)    |  |
|     | 組入時価比率：1.8%                    |           |            | 2.0%               |  |
| ウォン | HD HYUNDAI CO LTD              | 5,100     | 61,900.00  | 315,690,000.00     |  |
|     | S-OIL CORPORATION              | 3,930     | 84,300.00  | 331,299,000.00     |  |
|     | SK INNOVATION CO LTD           | 5,417     | 160,000.00 | 866,720,000.00     |  |
|     | HANWHA SOLUTIONS CORP          | 10,300    | 45,500.00  | 468,650,000.00     |  |
|     | KUMHO PETRO CHEMICAL CO        | 1,490     | 142,000.00 | 211,580,000.00     |  |
|     | LG CHEM LTD - PREFERRED        | 630       | 321,000.00 | 202,230,000.00     |  |
|     | LG CHEMICALS LTD               | 4,767     | 717,000.00 | 3,417,939,000.00   |  |
|     | LOTTE CHEMICAL CORPORATION     | 1,932     | 174,400.00 | 336,940,800.00     |  |
|     | SK IE TECHNOLOGY CO LTD        | 2,490     | 66,100.00  | 164,589,000.00     |  |
|     | SKC CO LTD                     | 2,610     | 92,000.00  | 240,120,000.00     |  |

|                                             |        |            |                  |  |
|---------------------------------------------|--------|------------|------------------|--|
| POSCO CHEMICAL CO LTD                       | 2,920  | 233,000.00 | 680,360,000.00   |  |
| HYUNDAI STEEL CO                            | 7,399  | 34,850.00  | 257,855,150.00   |  |
| KOREA ZINC CO LTD                           | 850    | 553,000.00 | 470,050,000.00   |  |
| POSCO HOLDINGS INC                          | 7,610  | 329,000.00 | 2,503,690,000.00 |  |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES                  | 7,000  | 47,100.00  | 329,700,000.00   |  |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR                | 6,900  | 36,700.00  | 253,230,000.00   |  |
| SAMSUNG ENGINEERING CO LTD                  | 14,400 | 27,600.00  | 397,440,000.00   |  |
| DOOSAN ENERBILITY CO LTD                    | 38,700 | 15,470.00  | 598,689,000.00   |  |
| ECOPRO BM CO LTD                            | 5,320  | 147,500.00 | 784,700,000.00   |  |
| LG ENERGY SOLUTION                          | 3,540  | 549,000.00 | 1,943,460,000.00 |  |
| CJ CORP                                     | 1,100  | 80,600.00  | 88,660,000.00    |  |
| GS HOLDINGS CORP                            | 3,600  | 42,400.00  | 152,640,000.00   |  |
| LG CORP                                     | 9,340  | 82,100.00  | 766,814,000.00   |  |
| SAMSUNG C&T CORP                            | 7,790  | 115,500.00 | 899,745,000.00   |  |
| SK INC                                      | 3,370  | 187,800.00 | 632,886,000.00   |  |
| DOOSAN BOBCAT INC                           | 3,350  | 37,300.00  | 124,955,000.00   |  |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD             | 1,410  | 106,600.00 | 150,306,000.00   |  |
| HYUNDAI MIPO DOCKYARD CO., LTD.             | 2,100  | 73,700.00  | 154,770,000.00   |  |
| KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE<br>ENGINEERIN | 4,910  | 85,400.00  | 419,314,000.00   |  |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES                    | 63,000 | 5,740.00   | 361,620,000.00   |  |
| S-1 CORPORATION                             | 1,450  | 57,800.00  | 83,810,000.00    |  |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD                       | 1,810  | 160,600.00 | 290,686,000.00   |  |
| KOREAN AIR LINES CO LTD                     | 17,500 | 23,400.00  | 409,500,000.00   |  |
| HMM COMPANY LIMITED                         | 27,100 | 22,200.00  | 601,620,000.00   |  |
| PAN OCEAN CO LTD                            | 32,000 | 5,930.00   | 189,760,000.00   |  |
| HANKOOK TIRE & TECHNONGY CO                 | 9,300  | 37,700.00  | 350,610,000.00   |  |
| HANON SYSTEMS                               | 23,400 | 9,180.00   | 214,812,000.00   |  |
| HYUNDAI MOBIS                               | 6,100  | 215,000.00 | 1,311,500,000.00 |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD                        | 13,480 | 179,300.00 | 2,416,964,000.00 |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD                | 4,130  | 94,500.00  | 390,285,000.00   |  |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD                    | 2,900  | 93,500.00  | 271,150,000.00   |  |
| KIA CORP                                    | 25,850 | 76,500.00  | 1,977,525,000.00 |  |
| COWAY CO LTD                                | 4,970  | 56,900.00  | 282,793,000.00   |  |
| LG ELECTRONICS INC                          | 10,300 | 114,000.00 | 1,174,200,000.00 |  |
| F&F CO LTD / NEW                            | 1,600  | 149,700.00 | 239,520,000.00   |  |

|                                 |         |            |                   |  |
|---------------------------------|---------|------------|-------------------|--|
| KANGWON LAND INC                | 7,900   | 21,150.00  | 167,085,000.00    |  |
| LOTTE SHOPPING CO               | 800     | 88,900.00  | 71,120,000.00     |  |
| HOTEL SHILLA CO LTD             | 3,680   | 80,800.00  | 297,344,000.00    |  |
| BGF RETAIL CO LTD /NEW          | 485     | 183,800.00 | 89,143,000.00     |  |
| E-MART CO                       | 1,710   | 116,900.00 | 199,899,000.00    |  |
| CJ CHEILJEDANG CORP             | 820     | 329,000.00 | 269,780,000.00    |  |
| ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA    | 1,800   | 124,400.00 | 223,920,000.00    |  |
| KT & G CORP                     | 11,390  | 87,500.00  | 996,625,000.00    |  |
| AMOREPACIFIC CORP               | 2,460   | 149,500.00 | 367,770,000.00    |  |
| LG H&H                          | 1,002   | 686,000.00 | 687,372,000.00    |  |
| HLB INC                         | 12,500  | 29,600.00  | 370,000,000.00    |  |
| SD BIOSENSOR INC                | 3,500   | 28,650.00  | 100,275,000.00    |  |
| CELLTRION HEALTHCARE CO LTD     | 7,872   | 57,700.00  | 454,214,400.00    |  |
| CELLTRION INC                   | 9,890   | 157,300.00 | 1,555,697,000.00  |  |
| SK BIOSCIENCE CO LTD            | 1,950   | 72,700.00  | 141,765,000.00    |  |
| CELLTRION PHARM INC             | 1,135   | 59,900.00  | 67,986,500.00     |  |
| HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD   | 508     | 272,500.00 | 138,430,000.00    |  |
| SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD    | 3,320   | 68,000.00  | 225,760,000.00    |  |
| YUHAN CORPORATION               | 4,190   | 51,800.00  | 217,042,000.00    |  |
| HANA FINANCIAL HOLDINGS         | 30,000  | 44,400.00  | 1,332,000,000.00  |  |
| INDUSTRIAL BK OF KOREA          | 26,100  | 10,110.00  | 263,871,000.00    |  |
| KAKAOBANK CORP                  | 12,900  | 25,500.00  | 328,950,000.00    |  |
| KB FINANCIAL GROUP INC          | 37,700  | 49,800.00  | 1,877,460,000.00  |  |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP         | 44,500  | 37,900.00  | 1,686,550,000.00  |  |
| WOORI FINANCIAL GROUP INC       | 49,300  | 12,130.00  | 598,009,000.00    |  |
| DB INSURANCE CO LTD             | 3,800   | 67,600.00  | 256,880,000.00    |  |
| MERITZ FIRE & MARINE INSURAN    | 4,230   | 51,600.00  | 218,268,000.00    |  |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE | 3,110   | 205,000.00 | 637,550,000.00    |  |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO       | 8,200   | 67,200.00  | 551,040,000.00    |  |
| SAMSUNG SDS CO LTD              | 3,620   | 131,000.00 | 474,220,000.00    |  |
| SAMSUNG ELECTRONICS             | 460,750 | 63,700.00  | 29,349,775,000.00 |  |
| SAMSUNG ELECTRONICS PFD         | 79,400  | 56,500.00  | 4,486,100,000.00  |  |
| ILJIN MATERIALS CO LTD          | 2,150   | 65,100.00  | 139,965,000.00    |  |
| L&F CO LTD                      | 2,180   | 244,000.00 | 531,920,000.00    |  |
| LG INNOTEK CO LTD               | 1,260   | 290,000.00 | 365,400,000.00    |  |

|       |                                   |           |            |                   |  |
|-------|-----------------------------------|-----------|------------|-------------------|--|
|       | LG.DISPLAY CO LTD                 | 23,500    | 15,260.00  | 358,610,000.00    |  |
|       | SAMSUNG ELECTRO MECHANICS         | 5,740     | 151,400.00 | 869,036,000.00    |  |
|       | SAMSUNG SDI CO,LTD                | 5,307     | 734,000.00 | 3,895,338,000.00  |  |
|       | SK HYNIX INC                      | 52,680    | 92,900.00  | 4,893,972,000.00  |  |
|       | SK SQUARE CO LTD                  | 8,699     | 37,200.00  | 323,602,800.00    |  |
|       | LG UPLUS CORP                     | 17,400    | 10,860.00  | 188,964,000.00    |  |
|       | KOREA ELECTRIC POWER              | 26,600    | 18,320.00  | 487,312,000.00    |  |
|       | KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO      | 3,140     | 61,800.00  | 194,052,000.00    |  |
|       | MERITZ SECURITIES                 | 24,500    | 6,560.00   | 160,720,000.00    |  |
|       | MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD     | 24,737    | 7,380.00   | 182,559,060.00    |  |
|       | NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 18,700    | 9,560.00   | 178,772,000.00    |  |
|       | SAMSUNG SECURITIES                | 6,800     | 33,550.00  | 228,140,000.00    |  |
|       | SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD          | 1,703     | 809,000.00 | 1,377,727,000.00  |  |
|       | CHEIL WORLDWIDE INC               | 5,900     | 20,600.00  | 121,540,000.00    |  |
|       | HYBE CO LTD                       | 2,010     | 190,500.00 | 382,905,000.00    |  |
|       | KAKAO GAMES CORP                  | 2,810     | 47,400.00  | 133,194,000.00    |  |
|       | KRAFTON INC                       | 2,990     | 178,200.00 | 532,818,000.00    |  |
|       | NCSOFT CORPORATION                | 1,631     | 413,500.00 | 674,418,500.00    |  |
|       | NETMARBLE CORP                    | 1,470     | 61,400.00  | 90,258,000.00     |  |
|       | PEARL ABYSS CORP                  | 2,860     | 45,100.00  | 128,986,000.00    |  |
|       | KAKAO CORP                        | 30,420    | 64,200.00  | 1,952,964,000.00  |  |
|       | NAVER CORP                        | 12,660    | 220,500.00 | 2,791,530,000.00  |  |
|       | 小計銘柄数：102                         |           |            | 98,617,981,210.00 |  |
|       |                                   |           |            | (10,256,270,045)  |  |
|       | 組入時価比率：11.4%                      |           |            | 12.5%             |  |
| 新台湾ドル | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP        | 122,360   | 84.00      | 10,278,240.00     |  |
|       | FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO         | 331,998   | 71.20      | 23,638,257.60     |  |
|       | FORMOSA PLASTIC                   | 420,424   | 89.70      | 37,712,032.80     |  |
|       | NAN YA PLASTICS CORP              | 440,726   | 75.40      | 33,230,740.40     |  |
|       | ASIA CEMENT                       | 208,980   | 42.55      | 8,892,099.00      |  |
|       | TAIWAN CEMENT                     | 637,888   | 37.50      | 23,920,800.00     |  |
|       | CHINA STEEL                       | 1,119,544 | 31.60      | 35,377,590.40     |  |
|       | VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY        | 6,000     | 1,570.00   | 9,420,000.00      |  |
|       | WALSIN LIHWA CORP                 | 268,429   | 56.30      | 15,112,552.70     |  |
|       | FAR EASTERN NEW CENTURY           | 313,454   | 32.25      | 10,108,891.50     |  |

| CORPORATION                               |           |          |               |  |
|-------------------------------------------|-----------|----------|---------------|--|
| AIRTAC INTERNATIONAL GROUP                | 12,464    | 1,065.00 | 13,274,160.00 |  |
| CHINA AIRLINES LTD                        | 219,000   | 21.00    | 4,599,000.00  |  |
| EVA AIRWAYS CORP                          | 202,000   | 29.70    | 5,999,400.00  |  |
| EVERGREEN MARINE                          | 101,950   | 148.00   | 15,088,600.00 |  |
| WAN HAI LINES LIMITED                     | 86,335    | 73.70    | 6,362,889.50  |  |
| YANG MING MARINE TRANSPORT                | 191,000   | 60.30    | 11,517,300.00 |  |
| TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP               | 247,000   | 29.00    | 7,163,000.00  |  |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD              | 142,036   | 34.30    | 4,871,834.80  |  |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD               | 14,000    | 336.00   | 4,704,000.00  |  |
| GIANT MANUFACTURING                       | 24,613    | 207.50   | 5,107,197.50  |  |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD                 | 17,443    | 493.00   | 8,599,399.00  |  |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD                | 39,815    | 196.00   | 7,803,740.00  |  |
| POU CHEN CORP                             | 267,468   | 34.65    | 9,267,766.20  |  |
| MOMO.COM INC                              | 5,600     | 769.00   | 4,306,400.00  |  |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD                   | 29,000    | 623.00   | 18,067,000.00 |  |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP                | 53,816    | 269.50   | 14,503,412.00 |  |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO              | 492,836   | 66.30    | 32,675,026.80 |  |
| PHARMAESSENTIA CORPORATION                | 17,000    | 503.00   | 8,551,000.00  |  |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK                 | 546,603   | 17.30    | 9,456,231.90  |  |
| CTBC FINANCIAL HOLDING                    | 1,672,212 | 22.70    | 37,959,212.40 |  |
| E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO               | 1,316,044 | 25.10    | 33,032,704.40 |  |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO                | 1,016,501 | 26.55    | 26,988,101.55 |  |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C              | 824,710   | 22.80    | 18,803,388.00 |  |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT              | 1,102,139 | 33.40    | 36,811,442.60 |  |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS                | 918,644   | 17.30    | 15,892,541.20 |  |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS-<br>RIGHTS     | 48,376    | 2.30     | 111,264.80    |  |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS                | 1,123,168 | 16.25    | 18,251,480.00 |  |
| TAIWAN BUSINESS BANK                      | 649,000   | 13.70    | 8,891,300.00  |  |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL              | 1,013,520 | 26.55    | 26,908,956.00 |  |
| THE SHANGHAI COMMERCIAL &<br>SAVINGS BANK | 370,906   | 47.10    | 17,469,672.60 |  |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD                  | 137,699   | 231.50   | 31,877,318.50 |  |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO               | 911,706   | 22.75    | 20,741,311.50 |  |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD           | 819,293   | 43.05    | 35,270,563.65 |  |

|                                          |           |          |                |  |
|------------------------------------------|-----------|----------|----------------|--|
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING      | 1,477,789 | 13.05    | 19,285,146.45  |  |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD           | 728,463   | 59.40    | 43,270,702.20  |  |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS             | 1,330,113 | 8.70     | 11,571,983.10  |  |
| ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION            | 50,000    | 283.50   | 14,175,000.00  |  |
| ACER INC                                 | 256,767   | 25.65    | 6,586,073.55   |  |
| ADVANTECH CO.,LTD.                       | 38,750    | 362.00   | 14,027,500.00  |  |
| ASUSTEK COMPUTER INC                     | 66,805    | 278.00   | 18,571,790.00  |  |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD                | 54,840    | 189.00   | 10,364,760.00  |  |
| COMPAL ELECTRONICS                       | 354,590   | 23.50    | 8,332,865.00   |  |
| INVENTEC CO.,LTD                         | 251,911   | 26.25    | 6,612,663.75   |  |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP                  | 189,897   | 70.00    | 13,292,790.00  |  |
| MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD          | 74,000    | 135.50   | 10,027,000.00  |  |
| PEGATRON CORP                            | 199,692   | 67.00    | 13,379,364.00  |  |
| QUANTA COMPUTER INC                      | 256,684   | 78.90    | 20,252,367.60  |  |
| WIWYNN CORP                              | 7,000     | 838.00   | 5,866,000.00   |  |
| AUO CORP                                 | 573,606   | 17.95    | 10,296,227.70  |  |
| DELTA ELECTRONICS INC                    | 187,681   | 299.00   | 56,116,619.00  |  |
| E INK HOLDINGS INC                       | 77,000    | 206.00   | 15,862,000.00  |  |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY               | 1,204,649 | 103.50   | 124,681,171.50 |  |
| INNOLUX CORP                             | 1,036,776 | 13.60    | 14,100,153.60  |  |
| LARGAN PRECISION CO LTD                  | 9,040     | 2,215.00 | 20,023,600.00  |  |
| NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORPORATION | 20,000    | 247.50   | 4,950,000.00   |  |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP              | 122,566   | 63.20    | 7,746,171.20   |  |
| UNIMICRON TECHNOLOGY CORP                | 118,000   | 138.50   | 16,343,000.00  |  |
| WPG HOLDINGS CO LTD                      | 170,387   | 49.20    | 8,383,040.40   |  |
| YAGEO CORPORATION                        | 32,137    | 575.00   | 18,478,775.00  |  |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING             | 64,410    | 114.00   | 7,342,740.00   |  |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD            | 323,658   | 104.00   | 33,660,432.00  |  |
| EMEMORY TECHNOLOGY INC                   | 6,000     | 1,625.00 | 9,750,000.00   |  |
| GLOBALWAFERS CO LTD                      | 20,000    | 519.00   | 10,380,000.00  |  |
| MEDIATEK INC                             | 146,538   | 711.00   | 104,188,518.00 |  |
| NANYA TECHNOLOGY CO                      | 100,000   | 59.70    | 5,970,000.00   |  |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD             | 52,058    | 402.00   | 20,927,316.00  |  |
| PARADE TECHNOLOGIES LTD                  | 6,000     | 880.00   | 5,280,000.00   |  |

|        |                                 |           |           |                  |  |
|--------|---------------------------------|-----------|-----------|------------------|--|
| 小計     | POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU    | 302,000   | 33.50     | 10,117,000.00    |  |
|        | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP      | 43,417    | 359.50    | 15,608,411.50    |  |
|        | SILERGY CORP                    | 28,000    | 587.00    | 16,436,000.00    |  |
|        | TAIWAN SEMICONDUCTOR            | 2,378,000 | 528.00    | 1,255,584,000.00 |  |
|        | UNITED MICROELECTRONICS CORP    | 1,185,500 | 50.10     | 59,393,550.00    |  |
|        | VANGUARD INTERNATIONAL SEMI     | 102,000   | 92.70     | 9,455,400.00     |  |
|        | WIN SEMICONDUCTORS CORP         | 41,000    | 171.00    | 7,011,000.00     |  |
|        | WINBOND ELECTRONICS CORPORATION | 242,000   | 23.40     | 5,662,800.00     |  |
|        | CHUNGHWA TELECOM CO LTD         | 372,065   | 114.00    | 42,415,410.00    |  |
|        | FAR EASTONE TELECOMM CO LTD     | 144,000   | 68.50     | 9,864,000.00     |  |
|        | TAIWAN MOBILE CO LTD            | 154,200   | 96.20     | 14,834,040.00    |  |
|        | RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD      | 169,668   | 44.10     | 7,482,358.80     |  |
|        | 銘柄数：89                          |           |           | 2,892,577,559.65 |  |
|        |                                 |           |           | (12,821,928,548) |  |
|        | 組入時価比率：14.2%                    |           |           | 15.6%            |  |
| インドルピー | BHARAT PETROLEUM CORP LTD       | 82,000    | 325.70    | 26,707,400.00    |  |
|        | COAL INDIA LTD                  | 142,000   | 215.45    | 30,593,900.00    |  |
|        | HINDUSTAN PETROLEUM CORP        | 64,380    | 231.40    | 14,897,532.00    |  |
|        | INDIAN OIL CORPORATION LTD      | 268,500   | 79.80     | 21,426,300.00    |  |
|        | OIL&NATURAL GAS CORP LTD        | 219,000   | 155.90    | 34,142,100.00    |  |
|        | PETRONET LNG LTD                | 77,000    | 219.75    | 16,920,750.00    |  |
|        | RELIANCE INDUSTRIES LIMITED     | 293,700   | 2,430.05  | 713,705,685.00   |  |
|        | ASIAN PAINTS LTD                | 38,800    | 2,805.95  | 108,870,860.00   |  |
|        | BERGER PAINTS INDIA LTD         | 19,000    | 562.30    | 10,683,700.00    |  |
|        | PI INDUSTRIES LTD               | 7,000     | 3,377.05  | 23,639,350.00    |  |
|        | PIDILITE INDUSTRIES LTD         | 15,500    | 2,316.75  | 35,909,625.00    |  |
|        | SRF LTD                         | 14,200    | 2,326.20  | 33,032,040.00    |  |
|        | UPL LTD                         | 43,200    | 770.35    | 33,279,120.00    |  |
|        | ACC LIMITED                     | 6,000     | 1,841.65  | 11,049,900.00    |  |
|        | AMBUJA CEMENTS LTD              | 57,000    | 347.80    | 19,824,600.00    |  |
|        | GRASIM INDUSTRIES LIMITED       | 25,400    | 1,629.65  | 41,393,110.00    |  |
|        | SHREE CEMENT LIMITED            | 880       | 25,117.60 | 22,103,488.00    |  |
|        | ULTRATECH CEMENT LTD            | 9,260     | 7,171.75  | 66,410,405.00    |  |
|        | HINDALCO INDUSTRIES LIMITED     | 136,500   | 434.70    | 59,336,550.00    |  |
|        | JINDAL STEEL&POWER LTD          | 46,000    | 601.65    | 27,675,900.00    |  |

|                                            |         |           |                |  |
|--------------------------------------------|---------|-----------|----------------|--|
| JSW STEEL LTD                              | 66,000  | 727.95    | 48,044,700.00  |  |
| TATA STEEL LIMITED                         | 699,400 | 112.00    | 78,332,800.00  |  |
| VEDANTA LTD                                | 85,000  | 314.85    | 26,762,250.00  |  |
| BHARAT ELECTRONICS LTD                     | 348,000 | 97.75     | 34,017,000.00  |  |
| LARSEN&TOUBRO LIMITED                      | 66,900  | 2,178.30  | 145,728,270.00 |  |
| ABB INDIA LTD                              | 4,700   | 3,188.40  | 14,985,480.00  |  |
| HAVELLS INDIA LTD                          | 24,300  | 1,227.35  | 29,824,605.00  |  |
| SIEMENS LIMITED                            | 7,000   | 3,222.70  | 22,558,900.00  |  |
| ADANI ENTERPRISES LTD                      | 26,200  | 1,796.60  | 47,070,920.00  |  |
| INDIAN RAILWAY CATERING & TO               | 22,200  | 649.25    | 14,413,350.00  |  |
| INTERGLOBE AVIATION LTD                    | 9,400   | 1,897.25  | 17,834,150.00  |  |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD                | 22,400  | 613.30    | 13,737,920.00  |  |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC<br>ZONE   | 52,400  | 577.20    | 30,245,280.00  |  |
| BALKRISHNA INDUSTRIES LTD                  | 7,000   | 2,000.60  | 14,004,200.00  |  |
| BHARAT FORGE LIMITED                       | 30,400  | 855.95    | 26,020,880.00  |  |
| MRF LTD                                    | 200     | 89,215.80 | 17,843,160.00  |  |
| SAMVARDHANA MOTHERSON<br>INTERNATIONAL LTD | 159,000 | 80.15     | 12,743,850.00  |  |
| TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD              | 9,300   | 2,419.45  | 22,500,885.00  |  |
| BAJAJ AUTO LIMITED                         | 6,500   | 3,906.60  | 25,392,900.00  |  |
| EICHER MOTORS LTD                          | 14,300  | 3,289.10  | 47,034,130.00  |  |
| HERO MOTOCORP LTD                          | 12,400  | 2,556.70  | 31,703,080.00  |  |
| MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED                  | 81,900  | 1,368.15  | 112,051,485.00 |  |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD                    | 11,900  | 8,805.10  | 104,780,690.00 |  |
| TATA MOTORS LTD                            | 154,700 | 441.60    | 68,315,520.00  |  |
| TVS MOTOR CO LTD                           | 18,800  | 1,123.90  | 21,129,320.00  |  |
| PAGE INDUSTRIES LTD                        | 530     | 38,728.05 | 20,525,866.50  |  |
| TITAN CO LTD                               | 36,500  | 2,522.40  | 92,067,600.00  |  |
| INDIAN HOTELS CO LIMITED                   | 75,000  | 321.95    | 24,146,250.00  |  |
| JUBILANT FOODWORKS LIMITED                 | 36,000  | 466.40    | 16,790,400.00  |  |
| ZOMATO LTD                                 | 270,000 | 51.40     | 13,878,000.00  |  |
| TRENT LTD                                  | 21,600  | 1,363.10  | 29,442,960.00  |  |
| AVENUE SUPERMARTS LTD                      | 15,800  | 3,541.70  | 55,958,860.00  |  |
| UNITED SPIRITS LTD                         | 32,700  | 786.65    | 25,723,455.00  |  |
| VARUN BEVERAGES LTD                        | 20,000  | 1,274.60  | 25,492,000.00  |  |

|                                            |           |           |                |  |
|--------------------------------------------|-----------|-----------|----------------|--|
| BRITANNIA INDUSTRIES LTD                   | 10,700    | 4,572.00  | 48,920,400.00  |  |
| MARICO LIMITED                             | 46,000    | 494.55    | 22,749,300.00  |  |
| NESTLE INDIA LIMITED                       | 3,400     | 19,628.85 | 66,738,090.00  |  |
| TATA CONSUMER PRODUCTS LTD                 | 55,700    | 732.60    | 40,805,820.00  |  |
| ITC LTD                                    | 281,000   | 382.55    | 107,496,550.00 |  |
| COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)                   | 10,200    | 1,449.30  | 14,782,860.00  |  |
| DABUR INDIA LTD                            | 59,800    | 535.60    | 32,028,880.00  |  |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD               | 43,500    | 932.40    | 40,559,400.00  |  |
| HINDUSTAN UNILEVER LIMITED                 | 79,300    | 2,527.10  | 200,399,030.00 |  |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE                | 10,870    | 4,643.15  | 50,471,040.50  |  |
| BIOCON LTD                                 | 31,000    | 242.85    | 7,528,350.00   |  |
| AUROBINDO PHARMA LTD                       | 18,700    | 479.90    | 8,974,130.00   |  |
| CIPLA LIMITED                              | 46,300    | 1,035.50  | 47,943,650.00  |  |
| DR.REDDYS LABORATORIES                     | 11,160    | 4,519.30  | 50,435,388.00  |  |
| LUPIN LTD                                  | 25,700    | 681.75    | 17,520,975.00  |  |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD               | 90,700    | 995.15    | 90,260,105.00  |  |
| TORRENT PHARMACEUTICALS LTD                | 11,540    | 1,510.05  | 17,425,977.00  |  |
| AU SMALL FINANCE BANK LTD                  | 12,600    | 626.45    | 7,893,270.00   |  |
| AXIS BANK LIMITED                          | 219,300   | 864.75    | 189,639,675.00 |  |
| BANDHAN BANK LTD                           | 56,000    | 242.10    | 13,557,600.00  |  |
| ICICI BANK LTD                             | 497,000   | 869.45    | 432,116,650.00 |  |
| KOTAK MAHINDRA BANK LTD                    | 56,500    | 1,787.95  | 101,019,175.00 |  |
| YES BANK LTD                               | 1,230,000 | 16.25     | 19,987,500.00  |  |
| BAJAJ FINSERV LTD                          | 37,060    | 1,428.20  | 52,929,092.00  |  |
| BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMEN               | 2,350     | 5,997.00  | 14,092,950.00  |  |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE                | 166,400   | 2,700.50  | 449,363,200.00 |  |
| HDFC LIFE INSURANCE CO LTD                 | 90,400    | 514.60    | 46,519,840.00  |  |
| ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE<br>COMPANY | 23,100    | 1,118.40  | 25,835,040.00  |  |
| ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE<br>CO LTD  | 33,200    | 428.50    | 14,226,200.00  |  |
| SBI LIFE INSURANCE CO LTD                  | 42,600    | 1,174.10  | 50,016,660.00  |  |
| HCL TECHNOLOGIES LTD                       | 106,300   | 1,128.15  | 119,922,345.00 |  |
| INFOSYS LTD                                | 324,800   | 1,601.80  | 520,264,640.00 |  |
| LTIMINDTREE LTD                            | 9,680     | 4,948.00  | 47,896,640.00  |  |
| MPHASIS LTD                                | 10,500    | 2,262.55  | 23,756,775.00  |  |

|         |                                |         |          |                  |  |
|---------|--------------------------------|---------|----------|------------------|--|
|         | TATA CONSULTANCY SVS LTD       | 88,300  | 3,558.05 | 314,175,815.00   |  |
|         | TECH MAHINDRA LTD              | 57,400  | 1,130.25 | 64,876,350.00    |  |
|         | WIPRO LTD                      | 126,700 | 409.90   | 51,934,330.00    |  |
|         | TATA ELXSI LTD                 | 4,000   | 6,688.75 | 26,755,000.00    |  |
|         | INDUS TOWERS LTD               | 61,000  | 169.80   | 10,357,800.00    |  |
|         | BHARTI AIRTEL LIMITED          | 214,800 | 784.45   | 168,499,860.00   |  |
|         | ADANI TRANSMISSION LTD         | 25,500  | 968.55   | 24,698,025.00    |  |
|         | POWER GRID CORP OF INDIA LTD   | 303,000 | 214.60   | 65,023,800.00    |  |
|         | TATA POWER COMPANY LIMITED     | 139,000 | 205.15   | 28,515,850.00    |  |
|         | ADANI TOTAL GAS LTD            | 26,000  | 1,022.60 | 26,587,600.00    |  |
|         | GAIL INDIA LTD                 | 190,500 | 95.95    | 18,278,475.00    |  |
|         | INDRAPRASTHA GAS LTD           | 34,200  | 435.80   | 14,904,360.00    |  |
|         | BAJAJ FINANCE LTD              | 26,280  | 6,437.30 | 169,172,244.00   |  |
|         | CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND   | 40,000  | 782.25   | 31,290,000.00    |  |
|         | MUTHOOT FINANCE LTD            | 10,000  | 990.85   | 9,908,500.00     |  |
|         | SBI CARDS & PAYMENT SERVICES   | 24,000  | 760.05   | 18,241,200.00    |  |
|         | SHRIRAM FINANCE LTD            | 25,200  | 1,258.70 | 31,719,240.00    |  |
|         | ADANI GREEN ENERGY LTD         | 28,800  | 616.30   | 17,749,440.00    |  |
|         | ADANI POWER LIMITED            | 61,000  | 147.80   | 9,015,800.00     |  |
|         | NTPC LIMITED                   | 355,000 | 167.40   | 59,427,000.00    |  |
|         | DIVIS LABORATORIES LTD         | 13,810  | 2,876.60 | 39,725,846.00    |  |
|         | DLF LIMITED                    | 58,000  | 371.70   | 21,558,600.00    |  |
|         | GODREJ PROPERTIES LTD          | 9,300   | 1,186.15 | 11,031,195.00    |  |
|         | INFO EDGE INDIA LTD            | 6,670   | 3,589.00 | 23,938,630.00    |  |
| 小計      | 銘柄数：112                        |         |          | 6,934,165,589.00 |  |
|         |                                |         |          | (11,372,031,565) |  |
|         | 組入時価比率：12.6%                   |         |          | 13.9%            |  |
| カタールリヤル | QATAR FUEL CO                  | 64,000  | 16.89    | 1,080,960.00     |  |
|         | QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT | 220,000 | 3.58     | 787,600.00       |  |
|         | MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING | 462,000 | 2.07     | 956,340.00       |  |
|         | INDUSTRIES QATAR               | 143,000 | 14.00    | 2,002,000.00     |  |
|         | COMMERCIAL BANK OF QATAR       | 294,000 | 6.19     | 1,821,330.00     |  |
|         | MASRAF AL RAYAN                | 585,000 | 2.78     | 1,626,885.00     |  |
|         | QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC    | 86,000  | 10.40    | 894,400.00       |  |
|         | QATAR ISLAMIC BANK             | 171,000 | 19.51    | 3,336,210.00     |  |

|     |                              |         |          |               |  |
|-----|------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| ランド | QATAR NATIONAL BANK          | 444,000 | 16.20    | 7,192,800.00  |  |
|     | OOREDOO QSC                  | 65,000  | 9.51     | 618,150.00    |  |
|     | QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 34,400  | 17.45    | 600,280.00    |  |
|     | BARWA REAL ESTATE CO         | 195,000 | 2.82     | 550,095.00    |  |
|     | 小計 銘柄数：12                    |         |          | 21,467,050.00 |  |
|     |                              |         |          | (790,846,122) |  |
|     | 組入時価比率：0.9%                  |         |          | 1.0%          |  |
|     | エジプトポンド                      |         |          |               |  |
|     | EASTERN CO SAE               | 51,525  | 18.14    | 934,663.50    |  |
|     | EFG-HERMES HOLDING SAE       | 60,000  | 20.91    | 1,254,600.00  |  |
|     | 小計 銘柄数：2                     |         |          | 2,189,263.50  |  |
|     |                              |         |          | (9,623,564)   |  |
|     | 組入時価比率：0.0%                  |         |          | 0.0%          |  |
|     | EXXARO RESOURCES LTD         | 28,200  | 206.08   | 5,811,456.00  |  |
|     | SASOL LTD                    | 57,900  | 305.61   | 17,694,819.00 |  |
|     | AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD | 10,100  | 274.08   | 2,768,208.00  |  |
|     | ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD  | 5,330   | 1,136.23 | 6,056,105.90  |  |
|     | ANGLOGOLD ASHANTI LTD        | 40,800  | 331.43   | 13,522,344.00 |  |
|     | GOLD FIELDS LTD              | 84,400  | 182.32   | 15,387,808.00 |  |
|     | HARMONY GOLD MINING CO LTD   | 40,800  | 58.77    | 2,397,816.00  |  |
|     | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 81,200  | 184.87   | 15,011,444.00 |  |
|     | KUMBA IRON ORE LTD           | 7,600   | 531.42   | 4,038,792.00  |  |
|     | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT | 26,700  | 156.00   | 4,165,200.00  |  |
|     | SIBANYE STILLWATER LTD       | 273,000 | 41.82    | 11,416,860.00 |  |
|     | BIDVEST GROUP LTD            | 25,500  | 247.08   | 6,300,540.00  |  |
|     | NASPERS LTD-N SHS            | 21,020  | 3,476.13 | 73,068,252.60 |  |
|     | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD      | 94,000  | 78.93    | 7,419,420.00  |  |
|     | MR PRICE GROUP LTD           | 25,000  | 164.76   | 4,119,000.00  |  |
|     | PEPKOR HOLDINGS LTD          | 173,000 | 19.51    | 3,375,230.00  |  |
|     | THE FOSCHINI GROUP LTD       | 32,000  | 106.08   | 3,394,560.00  |  |
|     | BID CORP LTD                 | 33,000  | 382.28   | 12,615,240.00 |  |
|     | CLICKS GROUP LTD             | 23,700  | 271.96   | 6,445,452.00  |  |
|     | SHOPRITE HOLDINGS LTD        | 48,100  | 226.50   | 10,894,650.00 |  |
|     | SPAR GROUP LIMITED/THE       | 15,300  | 152.91   | 2,339,523.00  |  |
|     | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 31,500  | 149.39   | 4,705,785.00  |  |
|     | ABSA GROUP LTD               | 77,300  | 190.26   | 14,707,098.00 |  |
|     | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD    | 7,940   | 1,775.35 | 14,096,279.00 |  |

|                |    |                              |         |        |                 |  |
|----------------|----|------------------------------|---------|--------|-----------------|--|
|                |    | NEDBANK GROUP LTD            | 44,579  | 229.16 | 10,215,723.64   |  |
|                |    | STANDARD BANK GROUP LTD      | 131,700 | 173.87 | 22,898,679.00   |  |
|                |    | FIRSTRAND LTD                | 489,000 | 64.81  | 31,692,090.00   |  |
|                |    | REMGRO LTD                   | 47,300  | 138.49 | 6,550,577.00    |  |
|                |    | DISCOVERY LTD                | 46,907  | 143.14 | 6,714,267.98    |  |
|                |    | OLD MUTUAL LTD               | 434,000 | 11.80  | 5,121,200.00    |  |
|                |    | SANLAM LIMITED               | 190,000 | 58.50  | 11,115,000.00   |  |
|                |    | MTN GROUP LTD                | 171,000 | 144.93 | 24,783,030.00   |  |
|                |    | VODACOM GROUP                | 68,100  | 130.02 | 8,854,362.00    |  |
|                |    | REINET INVESTMENTS SCA       | 14,200  | 339.01 | 4,813,942.00    |  |
|                |    | NEPI ROCKCASTLE N.V.         | 41,900  | 108.06 | 4,527,714.00    |  |
|                |    | MULTICHOICE GROUP LTD        | 43,200  | 130.81 | 5,650,992.00    |  |
|                | 小計 | 銘柄数：36                       |         |        | 404,689,460.12  |  |
|                |    |                              |         |        | (2,990,655,110) |  |
|                |    | 組入時価比率：3.3%                  |         |        | 3.6%            |  |
| U A E ディルハム    |    | MULTIPLY GROUP               | 295,000 | 4.07   | 1,200,650.00    |  |
|                |    | Q HOLDING PJSC               | 181,000 | 3.15   | 570,150.00      |  |
|                |    | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO | 298,000 | 4.38   | 1,305,240.00    |  |
|                |    | ABU DHABI COMMERCIAL BANK    | 285,000 | 8.96   | 2,553,600.00    |  |
|                |    | ABU DHABI ISLAMIC BANK       | 128,000 | 10.20  | 1,305,600.00    |  |
|                |    | DUBAI ISLAMIC BANK           | 286,029 | 5.72   | 1,636,085.88    |  |
|                |    | EMIRATES NBD PJSC            | 194,000 | 13.40  | 2,599,600.00    |  |
|                |    | FIRST ABU DHABI BANK PJSC    | 442,925 | 14.00  | 6,200,950.00    |  |
|                |    | EMIRATES TELECOM GROUP CO    | 344,900 | 26.96  | 9,298,504.00    |  |
|                |    | ALDAR PROPERTIES PJSC        | 330,000 | 4.68   | 1,544,400.00    |  |
|                |    | EMAAR PROPERTIES PJSC        | 349,000 | 5.68   | 1,982,320.00    |  |
|                | 小計 | 銘柄数：11                       |         |        | 30,197,099.88   |  |
|                |    |                              |         |        | (1,106,723,710) |  |
|                |    | 組入時価比率：1.2%                  |         |        | 1.3%            |  |
| クウェートディ<br>ナール |    | AGILITY                      | 134,400 | 0.60   | 81,715.20       |  |
|                |    | BOUBAYAN BANK K.S.C          | 127,951 | 0.77   | 99,545.87       |  |
|                |    | GULF BANK                    | 128,000 | 0.31   | 40,064.00       |  |
|                |    | KUWAIT FINANCE HOUSE         | 693,000 | 0.87   | 608,454.00      |  |
|                |    | NATIONAL BANK OF KUWAIT      | 709,000 | 1.10   | 785,572.00      |  |

|                |                              |         |        |               |      |
|----------------|------------------------------|---------|--------|---------------|------|
| 小計             | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO | 189,000 | 0.54   | 103,572.00    |      |
|                | MABANEE CO SAKC              | 75,949  | 0.82   | 62,961.72     |      |
|                | 銘柄数：7                        |         |        | 1,781,884.79  |      |
|                | 組入時価比率：0.9%                  |         |        | (782,888,901) | 1.0% |
| サウジアラビア<br>リヤル | RABIGH REFINING AND PETROCHE | 47,751  | 11.24  | 536,721.24    |      |
|                | SAUDI ARABIAN OIL CO         | 240,400 | 33.05  | 7,945,220.00  |      |
|                | ADVANCED PETROCHEMICALS CO   | 10,833  | 47.65  | 516,192.45    |      |
|                | NATIONAL INDUSTRIALIZATION C | 28,000  | 12.24  | 342,720.00    |      |
|                | SABIC AGRI-NUTRIENTS CO      | 19,300  | 126.40 | 2,439,520.00  |      |
|                | SAHARA INTERNATIONAL PETROCH | 40,600  | 36.25  | 1,471,750.00  |      |
|                | SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP  | 86,800  | 95.60  | 8,298,080.00  |      |
|                | SAUDI IND INVESTMENT GROUP   | 29,368  | 23.98  | 704,244.64    |      |
|                | SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO | 67,000  | 13.10  | 877,700.00    |      |
|                | YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL | 28,900  | 44.40  | 1,283,160.00  |      |
|                | SAUDI ARABIAN MINING CO      | 83,800  | 68.00  | 5,698,400.00  |      |
|                | JARIR MARKETING CO           | 6,100   | 144.00 | 878,400.00    |      |
|                | NAHDI MEDICAL CO             | 3,400   | 188.00 | 639,200.00    |      |
|                | ALMARAI CO                   | 26,300  | 55.20  | 1,451,760.00  |      |
|                | SAVOLA                       | 27,400  | 28.50  | 780,900.00    |      |
|                | DALLAH HEALTHCARE CO         | 3,200   | 144.00 | 460,800.00    |      |
|                | DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL | 7,800   | 242.80 | 1,893,840.00  |      |
|                | MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO | 5,000   | 194.00 | 970,000.00    |      |
|                | AL RAJHI BANK                | 192,000 | 76.20  | 14,630,400.00 |      |
|                | ALINMA BANK                  | 94,300  | 29.80  | 2,810,140.00  |      |
|                | ARAB NATIONAL BANK           | 60,800  | 26.50  | 1,611,200.00  |      |
|                | BANK AL - JAZIRA             | 34,100  | 18.40  | 627,440.00    |      |
|                | BANK ALBILAD                 | 42,666  | 40.85  | 1,742,906.10  |      |
|                | BANQUE SAUDI FRANSI          | 62,600  | 36.35  | 2,275,510.00  |      |
|                | RIYAD BANK                   | 124,000 | 28.70  | 3,558,800.00  |      |
|                | SAUDI BRITISH BANK           | 83,800  | 34.85  | 2,920,430.00  |      |
|                | SAUDI INVESTMENT BANK/THE    | 39,000  | 17.06  | 665,340.00    |      |
|                | THE SAUDI NATIONAL BANK      | 216,500 | 48.95  | 10,597,675.00 |      |
|                | BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE  | 7,750   | 159.80 | 1,238,450.00  |      |
|                | ARABIAN INTERNET & COMMUNICA | 2,100   | 240.00 | 504,000.00    |      |

|    |                                   |         |        |                  |  |
|----|-----------------------------------|---------|--------|------------------|--|
|    | ELM CO                            | 1,900   | 391.00 | 742,900.00       |  |
|    | SAUDI TELECOM CO                  | 140,700 | 36.45  | 5,128,515.00     |  |
|    | ETIHAD ETISALAT CO                | 34,300  | 33.95  | 1,164,485.00     |  |
|    | MOBILE TELECOMMUNICATIONS COMPANY | 29,000  | 10.28  | 298,120.00       |  |
|    | SAUDI ELECTRICITY CO              | 77,000  | 22.32  | 1,718,640.00     |  |
|    | SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING       | 5,500   | 161.40 | 887,700.00       |  |
|    | ACWA POWER CO                     | 8,700   | 147.20 | 1,280,640.00     |  |
|    | DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV      | 53,000  | 13.74  | 728,220.00       |  |
|    | EMAAR ECONOMIC CITY               | 35,000  | 7.93   | 277,550.00       |  |
|    | SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP      | 2,800   | 194.00 | 543,200.00       |  |
|    | 小計 銘柄数：40                         |         |        | 93,140,869.43    |  |
|    |                                   |         |        | (3,342,825,803)  |  |
|    | 組入時価比率：3.7%                       |         |        | 4.1%             |  |
| 合計 |                                   |         |        | 82,089,363,980   |  |
|    |                                   |         |        | (82,089,363,980) |  |

(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(2023年2月17日現在)

| 種類       | 通貨     | 銘柄                             | 券面総額      | 評価額             | 備考 |
|----------|--------|--------------------------------|-----------|-----------------|----|
| 投資信託受益証券 | 米ドル    | ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF | 5,517,100 | 27,944,111.50   |    |
|          | 小計     | 銘柄数：1                          | 5,517,100 | 27,944,111.50   |    |
|          |        | 組入時価比率：4.2%                    |           | (3,755,688,585) |    |
|          |        |                                |           | 97.3%           |    |
|          | 合計     |                                |           | 3,755,688,585   |    |
|          |        |                                |           | (3,755,688,585) |    |
| 投資証券     | メキシコペソ | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA    | 319,000   | 8,156,830.00    |    |
|          |        | OPERADORA DE SITES MEX- A-1    | 111,000   | 2,203,350.00    |    |
|          |        | 銘柄数：2                          | 430,000   | 10,360,180.00   |    |
|          | 小計     | 組入時価比率：0.1%                    |           | (75,035,675)    |    |
|          |        |                                |           | 1.9%            |    |
|          | ランド    | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD     | 300,000   | 4,230,000.00    |    |
|          | 小計     | 銘柄数：1                          | 300,000   | 4,230,000.00    |    |

|  |    |             |                 |  |
|--|----|-------------|-----------------|--|
|  |    |             | (31,259,700)    |  |
|  |    | 組入時価比率：0.0% | 0.8%            |  |
|  | 合計 |             | 106,295,375     |  |
|  |    |             | (106,295,375)   |  |
|  | 合計 |             | 3,861,983,960   |  |
|  |    |             | (3,861,983,960) |  |

(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        | 2023年 2月17日現在 |       |               |             |
|-----------|---------------|-------|---------------|-------------|
|           | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）     |
|           |               | うち1年超 |               |             |
| 市場取引      |               |       |               |             |
| 株価指数先物取引  |               |       |               |             |
| 買建        | 4,208,121,792 | -     | 4,096,819,776 | 111,302,016 |
| 市場取引以外の取引 |               |       |               |             |
| 為替予約取引    |               |       |               |             |
| 買建        | 93,121,910    | -     | 94,028,970    | 907,060     |
| 米ドル       | 93,121,910    | -     | 94,028,970    | 907,060     |
| 合計        | -             | -     | -             | 110,394,956 |

### （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。

## 新興国債券マザーファンド

### 貸借対照表

| (単位：円)          |                |
|-----------------|----------------|
| (2023年 2月17日現在) |                |
| <b>資産の部</b>     |                |
| 流動資産            |                |
| 預金              | 154,412,885    |
| コール・ローン         | 638,337,351    |
| 国債証券            | 30,038,345,115 |
| 未収入金            | 129,947,327    |
| 未収利息            | 333,678,581    |
| 前払費用            | 47,833,577     |
| 流動資産合計          | 31,342,554,836 |
| 資産合計            | 31,342,554,836 |
| <b>負債の部</b>     |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 280,228        |
| 未払解約金           | 712,401,924    |
| 未払利息            | 152            |
| その他未払費用         | 44,500         |
| 流動負債合計          | 712,726,804    |
| 負債合計            | 712,726,804    |
| <b>純資産の部</b>    |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 16,026,316,509 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 14,603,511,523 |
| 元本等合計           | 30,629,828,032 |
| 純資産合計           | 30,629,828,032 |
| 負債純資産合計         | 31,342,554,836 |

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

|                       |                                                                                                                                                                        |
|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |
|-----------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.9112円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (19,112円) |

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 2023年 2月17日現在                                                                                             |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> |

## 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

| 2023年 2月17日現在                                                         |                 |
|-----------------------------------------------------------------------|-----------------|
| 期首                                                                    | 2022年 2月18日     |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額                                      | 12,405,234,030円 |
| 同期中における追加設定元本額                                                        | 11,724,901,949円 |
| 同期中における一部解約元本額                                                        | 8,103,819,470円  |
| 期末元本額                                                                 | 16,026,316,509円 |
| 期末元本額の内訳*                                                             |                 |
| 野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型                                             | 514,023,277円    |
| ネクストコア                                                                | 3,868,063円      |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型                                         | 1,058,281,327円  |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                     | 6,558,791円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                     | 4,620,600円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                     | 27,729,826円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                     | 8,376,913円      |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                     | 11,208,699円     |
| 野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）                                  | 1,727,805,389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）                                  | 3,066,955,918円  |
| NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（為替ヘッジなし）連動型上場投信 | 1,305,404,368円  |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券                                                | 352,210,770円    |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）                                        | 3,115,264円      |
| ノムラ新興国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）                                       | 2,167,570円      |
| 新興国債券・インデックスF（適格機関投資家専用）                                              | 1,161,814,908円  |
| オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）                                | 192,843,707円    |
| 野村新興国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）                                           | 6,297,156,587円  |
| 野村DC運用戦略ファンド                                                          | 103,635,836円    |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）                                                    | 11,130,886円     |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）                                         | 167,407,810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(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2023年2月17日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄                     | 券面総額         | 評価額          | 備考 |
|------|-----|------------------------|--------------|--------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | ABU DHABI GOVT INT'L   | 3,100,000.00 | 2,970,203.00 |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 1,200,000.00 | 1,150,015.20 |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 1,200,000.00 | 1,056,600.00 |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 2,000,000.00 | 1,794,690.00 |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 2,400,000.00 | 2,221,377.60 |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 400,000.00   | 330,215.60   |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 400,000.00   | 330,296.80   |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 1,800,000.00 | 1,326,006.00 |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 3,200,000.00 | 2,686,188.80 |    |
|      |     | ABU DHABI GOVT INT'L   | 1,000,000.00 | 611,250.00   |    |
|      |     | ARAB REPUBLIC OF EGYPT | 2,100,000.00 | 1,703,944.20 |    |
|      |     | ARAB REPUBLIC OF EGYPT | 2,100,000.00 | 1,563,093.00 |    |
|      |     | ARAB REPUBLIC OF EGYPT | 2,400,000.00 | 1,637,328.00 |    |
|      |     | ARAB REPUBLIC OF EGYPT | 3,200,000.00 | 2,202,240.00 |    |
|      |     | CHINA GOVT INTL BOND   | 2,500,000.00 | 2,386,012.50 |    |
|      |     | CHINA GOVT INTL BOND   | 2,400,000.00 | 2,152,447.44 |    |
|      |     | CHINA GOVT INTL BOND   | 2,400,000.00 | 2,145,169.44 |    |
|      |     | CHINA GOVT INTL BOND   | 1,400,000.00 | 1,245,021.82 |    |
|      |     | CHINA GOVT INTL BOND   | 1,500,000.00 | 1,244,241.30 |    |
|      |     | DOMINICAN REPUBLIC     | 1,800,000.00 | 1,685,522.70 |    |
|      |     | DOMINICAN REPUBLIC     | 1,700,000.00 | 1,480,558.73 |    |
|      |     | DOMINICAN REPUBLIC     | 1,500,000.00 | 1,275,127.95 |    |
|      |     | DOMINICAN REPUBLIC     | 2,500,000.00 | 2,302,215.75 |    |
|      |     | DOMINICAN REPUBLIC     | 1,300,000.00 | 1,038,106.03 |    |
|      |     | DOMINICAN REPUBLIC     | 2,100,000.00 | 1,784,105.40 |    |
|      |     | DOMINICAN REPUBLIC     | 2,000,000.00 | 1,526,736.40 |    |
|      |     | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 1,500,000.00 | 1,417,301.10 |    |
|      |     | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 1,500,000.00 | 1,392,358.05 |    |
|      |     | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 3,700,000.00 | 3,205,960.83 |    |
|      |     | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 600,000.00   | 507,537.54   |    |
|      |     | FED REPUBLIC OF BRAZIL | 3,800,000.00 | 2,738,193.36 |    |
|      |     | HUNGARY                | 1,000,000.00 | 1,017,550.00 |    |
|      |     | HUNGARY                | 1,700,000.00 | 1,661,020.70 |    |
|      |     | HUNGARY                | 1,700,000.00 | 1,307,181.00 |    |
|      |     | HUNGARY                | 1,500,000.00 | 1,537,500.00 |    |
|      |     | HUNGARY                | 1,800,000.00 | 1,104,159.60 |    |
|      |     | MEXICO GLOBAL          | 1,700,000.00 | 1,113,970.73 |    |
|      |     | OMAN GOV INTERNTL BOND | 3,300,000.00 | 3,358,281.30 |    |

|                        |               |              |  |
|------------------------|---------------|--------------|--|
| OMAN GOV INTERNTL BOND | 2,300,000.00  | 2,365,322.30 |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 3,975,113.00  | 1,191,778.23 |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 4,165,309.00  | 1,310,411.20 |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 10,237,686.00 | 2,803,409.10 |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 6,286,159.00  | 2,100,077.48 |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 3,800,000.00  | 1,149,325.96 |  |
| REPUBLIC OF ARGENTINA  | 1,000,000.00  | 281,486.20   |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 1,200,000.00  | 1,115,449.20 |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 1,000,000.00  | 937,364.70   |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 1,400,000.00  | 1,186,161.34 |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 2,000,000.00  | 1,668,064.20 |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 1,100,000.00  | 882,722.94   |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 1,500,000.00  | 1,308,038.70 |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 1,200,000.00  | 895,901.76   |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 2,400,000.00  | 2,105,070.72 |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 1,600,000.00  | 1,179,062.72 |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 1,700,000.00  | 1,243,358.58 |  |
| REPUBLIC OF CHILE      | 800,000.00    | 513,432.24   |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA   | 1,900,000.00  | 1,648,590.29 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA   | 900,000.00    | 686,870.28   |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA   | 2,100,000.00  | 1,546,053.39 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA   | 1,600,000.00  | 1,155,357.92 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA   | 1,700,000.00  | 1,702,379.49 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA   | 3,000,000.00  | 2,008,950.30 |  |
| REPUBLIC OF COLOMBIA   | 800,000.00    | 469,681.44   |  |
| REPUBLIC OF ECUADOR    | 3,400,000.00  | 1,751,000.00 |  |
| REPUBLIC OF ECUADOR    | 7,600,000.00  | 2,900,095.40 |  |
| REPUBLIC OF ECUADOR    | 2,600,000.00  | 897,000.00   |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA  | 5,600,000.00  | 5,262,468.40 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA  | 2,100,000.00  | 1,783,074.30 |  |
| REPUBLIC OF INDONESIA  | 800,000.00    | 588,774.40   |  |
| REPUBLIC OF NIGERIA    | 1,300,000.00  | 929,370.00   |  |
| REPUBLIC OF PANAMA     | 800,000.00    | 698,225.52   |  |
| REPUBLIC OF PANAMA     | 1,800,000.00  | 1,357,022.70 |  |
| REPUBLIC OF PANAMA     | 1,800,000.00  | 1,877,720.58 |  |
| REPUBLIC OF PANAMA     | 2,000,000.00  | 1,535,739.20 |  |
| REPUBLIC OF PANAMA     | 3,200,000.00  | 2,387,128.00 |  |
| REPUBLIC OF PANAMA     | 1,200,000.00  | 784,928.28   |  |
| REPUBLIC OF PANAMA     | 1,900,000.00  | 1,389,185.57 |  |
| REPUBLIC OF PERU       | 3,400,000.00  | 2,840,591.88 |  |
| REPUBLIC OF PERU       | 1,900,000.00  | 1,520,390.07 |  |
| REPUBLIC OF PERU       | 1,600,000.00  | 1,160,482.08 |  |
|                        |               |              |  |

|                          |              |              |
|--------------------------|--------------|--------------|
| REPUBLIC OF PERU         | 1,500,000.00 | 888,915.15   |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 1,600,000.00 | 1,517,393.76 |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 600,000.00   | 407,423.76   |
| REPUBLIC OF PHILIPPINES  | 2,300,000.00 | 1,671,061.78 |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 2,000,000.00 | 1,792,498.00 |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 2,000,000.00 | 1,486,830.00 |
| REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 1,800,000.00 | 1,575,450.00 |
| REPUBLIC OF SRI LANKA    | 600,000.00   | 213,365.34   |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 2,100,000.00 | 2,050,996.50 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,500,000.00 | 1,433,580.00 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,500,000.00 | 1,382,400.00 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 2,800,000.00 | 2,640,708.00 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 2,000,000.00 | 1,784,200.00 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,400,000.00 | 1,372,714.00 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 3,400,000.00 | 3,426,690.00 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,500,000.00 | 1,296,411.00 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,300,000.00 | 1,194,887.20 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,000,000.00 | 784,975.00   |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,100,000.00 | 887,683.50   |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 600,000.00   | 474,567.60   |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,800,000.00 | 1,722,420.00 |
| REPUBLIC OF TURKEY       | 1,000,000.00 | 801,170.00   |
| REPUBLICA ORIENT URUGUAY | 2,000,000.00 | 1,960,317.00 |
| REPUBLICA ORIENT URUGUAY | 2,100,000.00 | 2,047,387.44 |
| ROMANIA                  | 1,500,000.00 | 1,584,633.00 |
| ROMANIA                  | 1,500,000.00 | 1,037,134.50 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 1,000,000.00 | 988,200.00   |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 2,900,000.00 | 2,782,668.90 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 900,000.00   | 899,130.60   |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 4,400,000.00 | 4,342,905.60 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 2,100,000.00 | 2,078,046.60 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 600,000.00   | 548,093.40   |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 2,100,000.00 | 2,205,315.00 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 1,200,000.00 | 963,036.00   |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 500,000.00   | 498,323.00   |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 2,500,000.00 | 2,322,422.50 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 1,300,000.00 | 1,253,184.40 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 500,000.00   | 462,376.00   |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 1,200,000.00 | 918,306.00   |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 1,800,000.00 | 1,553,220.00 |
| SAUDI INTERNATIONAL BOND | 1,300,000.00 | 909,818.00   |
| STATE OF QATAR           | 1,400,000.00 | 1,373,680.00 |
| STATE OF QATAR           | 1,400,000.00 | 1,361,633.00 |

|    |                       |                  |                  |  |
|----|-----------------------|------------------|------------------|--|
| 小計 | STATE OF QATAR        | 1,700,000.00     | 1,711,051.70     |  |
|    | STATE OF QATAR        | 2,400,000.00     | 2,360,596.80     |  |
|    | STATE OF QATAR        | 1,800,000.00     | 1,730,880.00     |  |
|    | STATE OF QATAR        | 3,800,000.00     | 3,820,064.00     |  |
|    | STATE OF QATAR        | 3,800,000.00     | 3,676,500.00     |  |
|    | STATE OF QATAR        | 3,000,000.00     | 2,732,700.00     |  |
|    | UAE INT'L GOVT BOND   | 1,400,000.00     | 1,374,445.80     |  |
|    | UAE INT'L GOVT BOND   | 1,000,000.00     | 733,798.00       |  |
|    | UKRAINE GOVERNMENT    | 2,000,000.00     | 405,360.00       |  |
|    | UKRAINE GOVERNMENT    | 1,200,000.00     | 225,384.00       |  |
|    | UKRAINE GOVERNMENT    | 2,100,000.00     | 382,987.50       |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,800,000.00     | 1,728,312.30     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,100,000.00     | 970,696.98       |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,600,000.00     | 1,311,263.84     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,400,000.00     | 1,322,882.68     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 2,200,000.00     | 2,070,452.12     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 900,000.00       | 741,891.60       |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,500,000.00     | 1,558,896.90     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,700,000.00     | 1,368,379.81     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 900,000.00       | 714,577.41       |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 2,100,000.00     | 1,781,075.10     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 2,200,000.00     | 1,689,405.96     |  |
|    | UNITED MEXICAN STATES | 1,300,000.00     | 864,572.67       |  |
|    | 銘柄数：146               | 288,564,267.00   | 223,499,591.63   |  |
|    |                       |                  | (30,038,345,115) |  |
|    | 組入時価比率：98.1%          |                  | 100.0%           |  |
| 合計 |                       | 30,038,345,115   |                  |  |
|    |                       | (30,038,345,115) |                  |  |

(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        | 2023年 2月17日現在 |       |            |         |
|-----------|---------------|-------|------------|---------|
|           | 契約額等（円）       |       | 時価（円）      | 評価損益（円） |
|           |               | うち1年超 |            |         |
| 市場取引以外の取引 |               |       |            |         |
| 為替予約取引    |               |       |            |         |
| 売建        | 91,062,200    | -     | 91,342,428 | 280,228 |
| 米ドル       | 91,062,200    | -     | 91,342,428 | 280,228 |
| 合計        | 91,062,200    | -     | 91,342,428 | 280,228 |

(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)          |               |
|-----------------|---------------|
| (2023年 2月17日現在) |               |
| <b>資産の部</b>     |               |
| 流動資産            |               |
| 預金              | 52,880,445    |
| コール・ローン         | 21,917,632    |
| 国債証券            | 7,963,461,820 |
| 派生商品評価勘定        | 96,613        |
| 未収利息            | 98,913,908    |
| 前払費用            | 14,282,206    |
| 流動資産合計          | 8,151,552,624 |
| 資産合計            | 8,151,552,624 |
| <b>負債の部</b>     |               |
| 流動負債            |               |
| 前受収益            | 8,754         |
| 未払解約金           | 3,811,170     |
| 未払利息            | 5             |
| その他未払費用         | 276,000       |
| 流動負債合計          | 4,095,929     |
| 負債合計            | 4,095,929     |
| <b>純資産の部</b>    |               |
| 元本等             |               |
| 元本              | 5,553,554,839 |
| 剰余金             |               |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2,593,901,856 |
| 元本等合計           | 8,147,456,695 |
| 純資産合計           | 8,147,456,695 |
| 負債純資産合計         | 8,151,552,624 |

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                    |                                                                                                                                           |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
|--------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                        |                                                                                                                                                                        |
|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | 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<br>約定日基準で計上しております。<br>為替差損益<br>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。<br>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |

（重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

（貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.4671円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (14,671円) |

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>○市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>○信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>○流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

2023年 2月17日現在

## 1．貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2．時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2023年 2月17日現在

| 期首                                             | 2022年 2月18日    |
|------------------------------------------------|----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額               | 6,295,141,360円 |
| 同期中における追加設定元本額                                 | 1,375,506,969円 |
| 同期中における一部解約元本額                                 | 2,117,093,490円 |
| 期末元本額                                          | 5,553,554,839円 |
| 期末元本額の内訳＊                                      |                |
| 野村資産設計ファンド2015                                 | 11,130,266円    |
| 野村資産設計ファンド2020                                 | 12,022,464円    |
| 野村資産設計ファンド2025                                 | 20,003,995円    |
| 野村資産設計ファンド2030                                 | 26,520,344円    |
| 野村資産設計ファンド2035                                 | 21,312,732円    |
| 野村資産設計ファンド2040                                 | 33,499,255円    |
| 野村資産設計ファンド2045                                 | 6,392,160円     |
| 野村インデックスファンド・新興国債券                             | 709,809,083円   |
| ネクストコア                                         | 11,868,562円    |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス                         | 596,513,744円   |
| 野村資産設計ファンド2050                                 | 5,917,366円     |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型             | 2,287,380円     |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型             | 1,582,060円     |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型             | 983,328円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型             | 845,903円       |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 3,997,565円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 2,173,330円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 6,458,177円     |
| 世界6資産分散ファンド                                    | 123,664,178円   |
| 野村資産設計ファンド2060                                 | 3,034,125円     |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）            | 2,778,063,140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） | 808,401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）         | 207,770,457円   |

|                             |              |
|-----------------------------|--------------|
| 野村ＤＣ新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド | 493,398,908円 |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド                | 415,359,898円 |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）          | 32,421,077円  |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０ | 11,362,255円  |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０ | 8,047,691円   |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０ | 4,255,522円   |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０ | 2,051,473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(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2023年2月17日現在)

| 種類   | 通貨     | 銘柄                       | 券面総額           | 評価額                    | 備考 |
|------|--------|--------------------------|----------------|------------------------|----|
| 国債証券 | メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 6,600,000.00   | 6,311,573.40           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 14,100,000.00  | 13,977,950.40          |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 6,000,000.00   | 5,378,280.00           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 14,500,000.00  | 12,898,863.60          |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 6,700,000.00   | 5,780,224.00           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 3,450,000.00   | 3,217,332.00           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10,300,000.00  | 10,020,561.00          |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 20,000,000.00  | 18,582,600.00          |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 4,200,000.00   | 3,822,756.00           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 2,700,000.00   | 2,913,327.00           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 6,100,000.00   | 5,804,760.00           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 7,700,000.00   | 6,760,292.00           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 10,600,000.00  | 9,521,874.00           |    |
|      |        | MEX BONOS DESARR FIX RT  | 1,200,000.00   | 1,077,655.56           |    |
|      |        | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 6,600,000.00   | 6,427,710.96           |    |
|      | 小計     | 銘柄数：15                   | 120,750,000.00 | 112,495,759.92         |    |
|      |        | 組入時価比率：10.0%             |                | (814,773,040)<br>10.2% |    |
|      | レアル    | LETRA TESOURO NACIONAL   | 6,400,000.00   | 5,755,873.92           |    |
|      |        | LETRA TESOURO NACIONAL   | 6,400,000.00   | 5,437,388.80           |    |
|      |        | LETRA TESOURO NACIONAL   | 4,700,000.00   | 3,556,046.79           |    |
|      |        | LETRA TESOURO NACIONAL   | 10,600,000.00  | 7,506,161.04           |    |
|      |        | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 391,000.00     | 3,802,828.07           |    |
|      |        | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 230,000.00     | 2,138,621.88           |    |

|         |                          |                   |                   |               |
|---------|--------------------------|-------------------|-------------------|---------------|
| 小計      | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 250,000.00        | 2,229,049.75      |               |
|         | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 160,000.00        | 1,381,097.12      |               |
|         | 銘柄数：8                    | 29,131,000.00     | 31,807,067.37     | (817,851,942) |
|         | 組入時価比率：10.0%             |                   | 10.2%             |               |
| チリペソ    | BONOS TESORERIA PESOS    | 180,000,000.00    | 167,175,000.00    |               |
|         | BONOS TESORERIA PESOS    | 160,000,000.00    | 155,496,000.00    |               |
|         | BONOS TESORERIA PESOS    | 60,000,000.00     | 58,649,364.00     |               |
|         | BONOS TESORERIA PESOS    | 70,000,000.00     | 58,775,500.00     |               |
|         | BONOS TESORERIA PESOS    | 295,000,000.00    | 283,922,750.00    |               |
|         | BONOS TESORERIA PESOS    | 240,000,000.00    | 231,799,944.00    |               |
|         | BONOS TESORERIA PESOS    | 115,000,000.00    | 120,997,250.00    |               |
|         | 銘柄数：7                    | 1,120,000,000.00  | 1,076,815,808.00  | (182,561,198) |
|         | 組入時価比率：2.2%              |                   | 2.3%              |               |
| コロンビアペソ | REPUBLIC OF COLOMBIA     | 1,790,000,000.00  | 1,634,537,426.00  |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 950,000,000.00    | 932,611,485.00    |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 890,000,000.00    | 774,643,362.00    |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 900,000,000.00    | 700,310,880.00    |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 1,460,000,000.00  | 1,119,605,526.00  |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 1,330,000,000.00  | 1,025,978,492.00  |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 800,000,000.00    | 579,087,600.00    |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 990,000,000.00    | 691,540,245.00    |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 1,850,000,000.00  | 1,246,934,225.00  |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 900,000,000.00    | 537,216,300.00    |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 800,000,000.00    | 605,958,080.00    |               |
|         | TITULOS DE TESORERIA     | 560,000,000.00    | 324,664,648.00    |               |
|         | 銘柄数：12                   | 13,220,000,000.00 | 10,173,088,269.00 | (277,237,001) |
|         | 組入時価比率：3.4%              |                   | 3.5%              |               |
| ソル      | BONOS DE TESORERIA       | 200,000.00        | 196,979.18        |               |
|         | BONOS DE TESORERIA       | 780,000.00        | 719,219.51        |               |
|         | BONOS DE TESORERIA       | 600,000.00        | 530,299.38        |               |
|         | BONOS DE TESORERIA       | 900,000.00        | 724,908.78        |               |
|         | BONOS DE TESORERIA       | 700,000.00        | 524,570.41        |               |
|         | PERU BONO SOBERANO       | 700,000.00        | 729,445.29        |               |
|         | PERU BONO SOBERANO       | 500,000.00        | 473,241.70        |               |
|         | PERU BONO SOBERANO       | 320,000.00        | 288,732.44        |               |
|         | REPUBLIC OF PERU         | 1,100,000.00      | 1,047,537.15      |               |
|         | 銘柄数：9                    | 5,800,000.00      | 5,234,933.84      | (182,615,432) |
|         | 組入時価比率：2.2%              |                   | 2.3%              |               |
| ウルグアイペソ | REPUBLICA ORIENT URUGUAY | 4,000,000.00      | 3,815,302.00      |               |

|           |                         |                |                                |  |
|-----------|-------------------------|----------------|--------------------------------|--|
| 小計        | 銘柄数：1                   | 4,000,000.00   | 3,815,302.00<br>(12,972,789)   |  |
|           | 組入時価比率：0.2%             |                | 0.2%                           |  |
| セルビアディナール | SERBIA TREASURY BONDS   | 22,000,000.00  | 18,425,000.00                  |  |
|           | 銘柄数：1                   | 22,000,000.00  | 18,425,000.00<br>(22,474,888)  |  |
| 小計        | 組入時価比率：0.3%             |                | 0.3%                           |  |
| トルコリラ     | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 520,000.00     | 527,540.00                     |  |
|           | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 810,000.00     | 799,470.00                     |  |
|           | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 1,020,000.00   | 986,340.00                     |  |
|           | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 1,800,000.00   | 1,961,100.00                   |  |
|           | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 400,000.00     | 408,400.00                     |  |
|           | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 500,000.00     | 518,500.00                     |  |
|           | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 700,000.00     | 739,375.00                     |  |
|           | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 1,000,000.00   | 1,207,000.00                   |  |
|           | TURKEY GOVERNMENT BOND  | 3,500,000.00   | 4,333,875.00                   |  |
|           | 銘柄数：9                   | 10,250,000.00  | 11,481,600.00<br>(81,798,362)  |  |
| 小計        | 組入時価比率：1.0%             |                | 1.0%                           |  |
| チェココルナ    | CZECH REPUBLIC          | 14,000,000.00  | 13,439,650.00                  |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 4,800,000.00   | 4,922,400.00                   |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 6,400,000.00   | 5,620,595.20                   |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 11,500,000.00  | 9,577,683.00                   |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 4,300,000.00   | 4,441,900.00                   |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 3,400,000.00   | 3,022,600.00                   |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 13,200,000.00  | 10,185,780.00                  |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 5,400,000.00   | 5,486,400.00                   |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 5,800,000.00   | 4,454,226.00                   |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 11,300,000.00  | 8,804,282.00                   |  |
|           | CZECH REPUBLIC          | 5,200,000.00   | 4,945,304.00                   |  |
|           | 銘柄数：11                  | 85,300,000.00  | 74,900,820.20<br>(453,277,293) |  |
| 小計        | 組入時価比率：5.6%             |                | 5.7%                           |  |
| フォリント     | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 27,000,000.00  | 25,373,844.00                  |  |
|           | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 68,000,000.00  | 59,698,220.00                  |  |
|           | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 16,000,000.00  | 13,528,800.00                  |  |
|           | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 63,000,000.00  | 54,978,474.60                  |  |
|           | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 85,000,000.00  | 65,458,882.50                  |  |
|           | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 60,000,000.00  | 45,753,000.00                  |  |
|           | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 46,000,000.00  | 34,317,150.00                  |  |
|           | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 107,000,000.00 | 80,726,150.00                  |  |
|           | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 57,000,000.00  | 50,937,291.90                  |  |

|      |                         |                |                |      |
|------|-------------------------|----------------|----------------|------|
| 小計   | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 102,000,000.00 | 72,000,168.00  |      |
|      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 130,000,000.00 | 89,310,000.00  |      |
|      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 20,000,000.00  | 15,004,000.00  |      |
|      | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 88,000,000.00  | 47,467,200.00  |      |
|      | 銘柄数：13                  | 869,000,000.00 | 654,553,181.00 |      |
|      | 組入時価比率：3.0%             |                | (244,234,082)  | 3.1% |
| ズロチ  | POLAND GOVERNMENT BOND  | 3,200,000.00   | 3,161,760.00   |      |
|      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 3,100,000.00   | 2,906,346.72   |      |
|      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2,200,000.00   | 1,957,780.00   |      |
|      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 300,000.00     | 279,180.00     |      |
|      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 1,400,000.00   | 1,233,400.00   |      |
|      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 2,700,000.00   | 2,179,791.00   |      |
|      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 500,000.00     | 455,000.00     |      |
|      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 4,800,000.00   | 3,868,800.00   |      |
|      | POLAND GOVERNMENT BOND  | 3,400,000.00   | 2,348,380.00   |      |
|      | 銘柄数：9                   | 21,600,000.00  | 18,390,437.72  |      |
| 小計   | 組入時価比率：6.8%             |                | (552,044,159)  | 6.9% |
| ルーブル | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 12,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 21,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 12,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 21,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 28,300,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 32,500,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 27,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 38,700,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 29,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 12,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 18,700,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 16,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 24,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 20,200,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 26,500,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 27,500,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 10,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | RUSSIA GOVT BOND - OFZ  | 51,000,000.00  | 0.00           |      |
|      | 銘柄数：18                  | 427,400,000.00 | 0.00           |      |
| 小計   | 組入時価比率：0.0%             |                | (0)            | 0.0% |
| レイ   | ROMANIA                 | 500,000.00     | 492,025.00     |      |
|      | ROMANIA                 | 1,000,000.00   | 960,860.00     |      |
|      | ROMANIA                 | 800,000.00     | 759,381.12     |      |

|     |                          |               |                                |
|-----|--------------------------|---------------|--------------------------------|
| 小計  | ROMANIA                  | 920,000.00    | 881,360.00                     |
|     | ROMANIA                  | 500,000.00    | 460,375.00                     |
|     | ROMANIA                  | 500,000.00    | 466,977.50                     |
|     | ROMANIA                  | 700,000.00    | 620,410.77                     |
|     | ROMANIA                  | 760,000.00    | 718,317.80                     |
|     | ROMANIA                  | 1,330,000.00  | 1,085,067.59                   |
|     | ROMANIA                  | 1,150,000.00  | 1,014,432.25                   |
|     | ROMANIA                  | 1,900,000.00  | 1,458,744.00                   |
|     | ROMANIA GOVERNMENT BOND  | 200,000.00    | 190,047.14                     |
|     | ROMANIA GOVERNMENT BOND  | 1,000,000.00  | 720,570.00                     |
|     | 銘柄数：13                   | 11,260,000.00 | 9,828,568.17<br>(287,399,127)  |
|     | 組入時価比率：3.5%              |               | 3.6%                           |
|     |                          |               |                                |
| リング | MALAYSIA GOVERNMENT      | 800,000.00    | 808,345.36                     |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT      | 2,850,000.00  | 2,884,868.89                   |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT      | 1,200,000.00  | 1,171,863.00                   |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT      | 1,800,000.00  | 1,918,878.48                   |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT      | 400,000.00    | 425,520.28                     |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 1,400,000.00  | 1,404,245.22                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 600,000.00    | 606,536.40                     |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 2,200,000.00  | 2,224,052.82                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 1,300,000.00  | 1,316,317.21                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 2,400,000.00  | 2,431,516.32                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 2,500,000.00  | 2,506,029.75                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 2,200,000.00  | 2,213,167.22                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 1,200,000.00  | 1,094,621.88                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 2,000,000.00  | 1,948,716.60                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 500,000.00    | 542,637.00                     |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 1,200,000.00  | 1,129,722.12                   |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT     | 1,570,000.00  | 1,484,399.20                   |
|     | 銘柄数：17                   | 26,120,000.00 | 26,111,437.75<br>(792,296,744) |
|     | 組入時価比率：9.7%              |               | 9.9%                           |
|     |                          |               |                                |
| パーツ | THAILAND GOVERNMENT BOND | 10,100,000.00 | 10,161,702.92                  |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 15,000,000.00 | 14,805,127.50                  |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 7,000,000.00  | 6,887,030.50                   |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 12,900,000.00 | 12,808,198.44                  |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 12,500,000.00 | 12,237,340.00                  |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 12,300,000.00 | 12,949,502.73                  |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 13,300,000.00 | 13,337,600.43                  |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 9,400,000.00  | 9,729,438.04                   |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 10,200,000.00 | 11,740,333.62                  |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 13,800,000.00 | 13,150,087.62                  |
|     |                          |               |                                |

|     |                          |                   |                   |       |
|-----|--------------------------|-------------------|-------------------|-------|
| 小計  | THAILAND GOVERNMENT BOND | 12,800,000.00     | 13,935,654.40     |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 12,100,000.00     | 11,650,872.20     |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 4,000,000.00      | 4,406,718.40      |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2,500,000.00      | 2,668,736.00      |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3,600,000.00      | 3,151,711.44      |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 12,100,000.00     | 10,524,927.27     |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 9,100,000.00      | 9,651,694.78      |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 4,800,000.00      | 5,068,207.20      |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 8,400,000.00      | 8,666,644.56      |       |
|     | THAILAND GOVERNMENT BOND | 15,700,000.00     | 14,766,010.14     |       |
|     | 銘柄数：20                   | 201,600,000.00    | 202,297,538.19    |       |
|     | 組入時価比率：9.7%              |                   | (786,937,423)     | 9.9%  |
| ルピア | INDONESIA GOVERNMENT     | 5,530,000,000.00  | 5,659,553,522.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 3,800,000,000.00  | 3,890,336,640.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 4,300,000,000.00  | 4,316,226,910.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 1,580,000,000.00  | 1,762,505,800.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 3,400,000,000.00  | 3,332,290,020.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 4,000,000,000.00  | 3,840,160,000.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 4,450,000,000.00  | 4,559,761,920.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 5,000,000,000.00  | 4,928,518,500.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 3,230,000,000.00  | 3,621,936,921.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 3,500,000,000.00  | 3,809,306,200.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 1,110,000,000.00  | 1,362,163,473.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 4,600,000,000.00  | 4,686,813,960.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 4,500,000,000.00  | 4,440,919,500.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 2,400,000,000.00  | 2,812,440,960.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 4,700,000,000.00  | 4,606,846,000.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 1,600,000,000.00  | 1,761,012,320.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 1,800,000,000.00  | 1,892,413,800.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 4,900,000,000.00  | 4,852,583,680.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 1,180,000,000.00  | 1,315,205,934.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 5,000,000,000.00  | 5,246,580,500.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 4,030,000,000.00  | 4,461,104,414.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 3,000,000,000.00  | 2,909,006,400.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 1,800,000,000.00  | 1,745,451,000.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 2,600,000,000.00  | 2,703,147,460.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 3,400,000,000.00  | 3,521,894,760.00  |       |
|     | INDONESIA GOVERNMENT     | 2,800,000,000.00  | 2,835,000,000.00  |       |
|     | 銘柄数：26                   | 88,210,000,000.00 | 90,873,180,594.00 |       |
|     | 組入時価比率：9.9%              |                   | (808,771,307)     | 10.2% |
| 人民元 | CHINA GOVERNMENT BOND    | 8,000,000.00      | 8,015,900.00      |       |

|  |         |                          |                |                 |  |
|--|---------|--------------------------|----------------|-----------------|--|
|  | 小計      | CHINA GOVERNMENT BOND    | 900,000.00     | 893,295.00      |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 1,600,000.00   | 1,589,907.36    |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 7,800,000.00   | 7,822,230.00    |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 400,000.00     | 396,820.00      |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 7,200,000.00   | 7,254,720.00    |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 1,200,000.00   | 1,197,912.36    |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 2,400,000.00   | 2,362,524.72    |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 6,000,000.00   | 6,077,376.60    |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 500,000.00     | 494,292.75      |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 2,800,000.00   | 2,778,697.60    |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 2,000,000.00   | 2,148,176.00    |  |
|  |         | CHINA GOVERNMENT BOND    | 400,000.00     | 403,240.64      |  |
|  |         | 銘柄数：13                   | 41,200,000.00  | 41,435,093.03   |  |
|  |         |                          |                | (811,800,486)   |  |
|  |         | 組入時価比率：10.0%             |                | 10.2%           |  |
|  | エジプトポンド | EGYPT GOVERNMENT BOND    | 2,000,000.00   | 1,722,477.00    |  |
|  |         | EGYPT GOVERNMENT BOND    | 6,000,000.00   | 5,040,040.80    |  |
|  |         | EGYPT GOVERNMENT BOND    | 6,300,000.00   | 5,205,913.02    |  |
|  |         | EGYPT GOVERNMENT BOND    | 3,200,000.00   | 2,615,643.20    |  |
|  |         | 銘柄数：4                    | 17,500,000.00  | 14,584,074.02   |  |
|  |         |                          |                | (64,108,672)    |  |
|  | ランド     | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 15,300,000.00  | 16,260,075.00   |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 17,400,000.00  | 15,696,105.00   |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10,660,000.00  | 8,713,484.00    |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 13,300,000.00  | 11,498,515.00   |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10,900,000.00  | 9,319,500.00    |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 4,800,000.00   | 3,200,880.00    |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 9,900,000.00   | 7,927,920.00    |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 9,600,000.00   | 7,814,400.00    |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 5,050,000.00   | 3,178,470.00    |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8,800,000.00   | 6,847,720.00    |  |
|  |         | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 17,700,000.00  | 13,779,450.00   |  |
|  |         | 銘柄数：11                   | 123,410,000.00 | 104,236,519.00  |  |
|  |         |                          |                | (770,307,875)   |  |
|  |         | 組入時価比率：9.5%              |                | 9.7%            |  |
|  | 小計      |                          |                |                 |  |
|  |         |                          |                |                 |  |
|  | 合計      |                          |                | 7,963,461,820   |  |
|  |         |                          |                | (7,963,461,820) |  |

(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        | 2023年 2月17日現在 |       |            |         |
|-----------|---------------|-------|------------|---------|
|           | 契約額等（円）       |       | 時価（円）      | 評価損益（円） |
|           |               | うち1年超 |            |         |
| 市場取引以外の取引 |               |       |            |         |
| 為替予約取引    |               |       |            |         |
| 買建        | 14,679,368    | -     | 14,775,981 | 96,613  |
| 米ドル       | 14,679,368    | -     | 14,775,981 | 96,613  |
| 合計        | 14,679,368    | -     | 14,775,981 | 96,613  |

## （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。

## J - 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）

(2023年 2月17日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産の部            |                |
| 流動資産            |                |
| コール・ローン         | 987,630,670    |
| 投資証券            | 44,638,415,200 |
| 未収配当金           | 312,664,729    |
| 差入委託証拠金         | 148,418,820    |
| 流動資産合計          | 46,087,129,419 |
| 資産合計            | 46,087,129,419 |
| 負債の部            |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 68,345,340     |
| 未払金             | 29,767,817     |
| 未払解約金           | 18,819,393     |
| 未払利息            | 236            |
| 流動負債合計          | 116,932,786    |
| 負債合計            | 116,932,786    |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 18,069,199,879 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 27,900,996,754 |
| 元本等合計           | 45,970,196,633 |
| 純資産合計           | 45,970,196,633 |
| 負債純資産合計         | 46,087,129,419 |

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

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

## （貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 2,5441円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (25,441円) |

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日 |                                                                                                     |
|--------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針                | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク       |                                                                                                     |

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### ○市場リスクの管理

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

#### ○信用リスクの管理

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

#### ○流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 2023年 2月17日現在                                           |  |
|---------------------------------------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                      |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。  |  |
| 2. 時価の算定方法                                              |  |
| 投資証券                                                    |  |
| （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。                          |  |
| 派生商品評価勘定                                                |  |
| デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。                           |  |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務                                     |  |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |  |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年 2月17日現在                    |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| 期首                               | 2022年 2月18日     |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 17,123,088,767円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 5,610,054,737円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 4,663,943,625円  |
| 期末元本額                            | 18,069,199,879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）               | 1,752,129,437円  |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース）               | 2,270,498,841円  |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース）               | 1,094,690,267円  |
| 野村資産設計ファンド2015                   | 13,888,830円     |
| 野村資産設計ファンド2020                   | 15,015,295円     |
| 野村資産設計ファンド2025                   | 19,155,266円     |

|                                                |                |
|------------------------------------------------|----------------|
| 野村資産設計ファンド2030                                 | 21,765,698円    |
| 野村資産設計ファンド2035                                 | 22,738,886円    |
| 野村資産設計ファンド2040                                 | 41,239,493円    |
| 野村資産設計ファンド2045                                 | 6,295,343円     |
| 野村インデックスファンド・J-REIT                            | 3,178,835,037円 |
| ネクストコア                                         | 21,503,629円    |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型                  | 1,222,747,984円 |
| 野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）                     | 1,561,386,413円 |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース）                           | 693,356,711円   |
| 野村資産設計ファンド2050                                 | 5,308,638円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 329,666円       |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 205,028円       |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 2,322,624円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 631,374円       |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                              | 1,840,625円     |
| 野村6資産均等バランス                                    | 3,034,258,089円 |
| 野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）                | 108,300,535円   |
| 野村資産設計ファンド2060                                 | 3,787,736円     |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT                         | 166,646,585円   |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用）           | 98,549,932円    |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）               | 14,394,560円    |
| J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）                    | 1,676,026,257円 |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）             | 54,802,299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） | 464,026円       |
| オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）         | 11,379,921円    |
| 野村DC運用戦略ファンド                                   | 797,501,792円   |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）                             | 61,854,171円    |
| 野村世界6資産分散投信（DC）安定コース                           | 12,088,397円    |
| 野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース                         | 5,748,944円     |
| 野村世界6資産分散投信（DC）成長コース                           | 13,750,386円    |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030                    | 9,325,054円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040                    | 9,907,161円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050                    | 3,819,955円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060                    | 2,562,079円     |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）                  | 38,146,915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(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2023年2月17日現在)

(単位:円)

| 種類   | 通貨  | 銘柄                              | 券面総額   | 評価額           | 備考 |
|------|-----|---------------------------------|--------|---------------|----|
| 投資証券 | 日本円 | エスコンジャパンリート投資法人<br>投資証券         | 886    | 100,029,400   |    |
|      |     | サンケイリアルエステート投資法人<br>投資証券        | 1,397  | 121,818,400   |    |
|      |     | S O S i L A 物流リート投資法人<br>投資証券   | 2,168  | 274,252,000   |    |
|      |     | 東海道リート投資法人 投資証券                 | 725    | 83,737,500    |    |
|      |     | 日本アコモデーションファンド投資法人<br>投資証券      | 1,505  | 907,515,000   |    |
|      |     | 森ヒルズリート投資法人 投資証券                | 5,126  | 765,311,800   |    |
|      |     | 産業ファンド投資法人 投資証券                 | 6,515  | 915,357,500   |    |
|      |     | アドバンス・レジデンス投資法人<br>投資証券         | 4,359  | 1,423,213,500 |    |
|      |     | ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人<br>投資証券 | 3,197  | 648,351,600   |    |
|      |     | アクティブ・プロパティーズ投資法人<br>投資証券       | 2,302  | 881,666,000   |    |
|      |     | G L P 投資法人 投資証券                 | 14,070 | 2,030,301,000 |    |
|      |     | コンフォリア・レジデンシャル投資法人<br>投資証券      | 2,085  | 636,967,500   |    |
|      |     | 日本プロロジスリート投資法人 投資証券             | 7,348  | 2,100,058,400 |    |
|      |     | 星野リゾート・リート投資法人 投資証券             | 762    | 569,976,000   |    |
|      |     | O n e リート投資法人 投資証券              | 760    | 182,172,000   |    |
|      |     | イオンリート投資法人 投資証券                 | 5,004  | 725,079,600   |    |
|      |     | ヒューリックリート投資法人 投資証券              | 4,079  | 626,126,500   |    |
|      |     | 日本リート投資法人 投資証券                  | 1,416  | 461,616,000   |    |
|      |     | 積水ハウス・リート投資法人 投資証券              | 13,100 | 915,690,000   |    |
|      |     | トーセイ・リート投資法人 投資証券               | 967    | 125,033,100   |    |
|      |     | ケネディクス商業リート投資法人<br>投資証券         | 1,895  | 456,695,000   |    |

|                               |        |               |  |
|-------------------------------|--------|---------------|--|
| ヘルスケア＆メディカル投資法人<br>投資証券       | 1,075  | 178,450,000   |  |
| サムティ・レジデンシャル投資法人<br>投資証券      | 1,133  | 122,817,200   |  |
| 野村不動産マスターファンド投資法人<br>投資証券     | 14,097 | 2,154,021,600 |  |
| いちごホテルリート投資法人 投資<br>証券        | 722    | 84,040,800    |  |
| ラサールロジポート投資法人 投資<br>証券        | 5,337  | 826,167,600   |  |
| スターアジア不動産投資法人 投資<br>証券        | 5,443  | 291,200,500   |  |
| マリモ地方創生リート投資法人 投資<br>証券       | 666    | 82,450,800    |  |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人<br>投資証券   | 1,722  | 761,124,000   |  |
| 大江戸温泉リート投資法人 投資証券             | 704    | 45,478,400    |  |
| 投資法人みらい 投資証券                  | 5,296  | 233,024,000   |  |
| 森トラスト・ホテルリート投資法人<br>投資証券      | 1,023  | 129,307,200   |  |
| 三菱地所物流リート投資法人 投資<br>証券        | 1,498  | 599,949,000   |  |
| C R E ロジスティクスファンド投資法人<br>投資証券 | 1,688  | 288,648,000   |  |
| ザイマックス・リート投資法人 投資<br>証券       | 707    | 81,870,600    |  |
| タカラレーベン不動産投資法人 投資<br>証券       | 1,909  | 176,009,800   |  |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人             | 1,900  | 258,210,000   |  |
| 日本ビルファンド投資法人 投資証券             | 5,086  | 2,863,418,000 |  |
| ジャパンリアルエステイト投資法人<br>投資証券      | 4,359  | 2,445,399,000 |  |
| 日本都市ファンド投資法人 投資証券             | 21,996 | 2,252,390,400 |  |
| オリックス不動産投資法人 投資証券             | 8,686  | 1,595,618,200 |  |
| 日本プライムリアルティ投資法人<br>投資証券       | 2,981  | 1,056,764,500 |  |
| N T T 都市開発リート投資法人             | 4,191  | 551,954,700   |  |

有価証券報告書（内国投資信託）

|    |                         |                |                |  |
|----|-------------------------|----------------|----------------|--|
| 小計 | 東急リアル・エステート投資法人<br>投資証券 | 2,923          | 554,493,100    |  |
|    | グローバル・ワン不動産投資法人<br>投資証券 | 3,208          | 344,860,000    |  |
|    | ユナイテッド・アーバン投資法人<br>投資証券 | 9,752          | 1,462,800,000  |  |
|    | 森トラスト総合リート投資法人 投資証券     | 3,116          | 434,993,600    |  |
|    | インヴィンシブル投資法人 投資証券       | 19,188         | 1,068,771,600  |  |
|    | フロンティア不動産投資法人 投資証券      | 1,617          | 807,691,500    |  |
|    | 平和不動産リート投資法人 投資証券       | 2,979          | 458,766,000    |  |
|    | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券  | 2,939          | 850,546,600    |  |
|    | 福岡リート投資法人 投資証券          | 2,255          | 374,330,000    |  |
|    | ケネディクス・オフィス投資法人<br>投資証券 | 2,537          | 790,275,500    |  |
|    | いちごオフィスリート投資法人 投資証券     | 3,572          | 304,691,600    |  |
|    | 大和証券オフィス投資法人 投資証券       | 903            | 549,927,000    |  |
|    | 阪急阪神リート投資法人 投資証券        | 1,969          | 279,007,300    |  |
|    | スターツプロシード投資法人 投資証券      | 756            | 175,618,800    |  |
|    | 大和ハウスリート投資法人 投資証券       | 6,571          | 1,819,509,900  |  |
|    | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券   | 14,058         | 1,173,843,000  |  |
|    | 大和証券リビング投資法人 投資証券       | 6,041          | 667,530,500    |  |
|    | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券     | 3,999          | 491,477,100    |  |
|    | 銘柄数：61                  | 260,268        | 44,638,415,200 |  |
|    | 組入時価比率：97.1%            |                | 100.0%         |  |
| 合計 |                         | 44,638,415,200 |                |  |

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

(注2)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         | 2023年 2月17日現在 |       |               |            |
|------------|---------------|-------|---------------|------------|
|            | 契約額等（円）       |       | 時価（円）         | 評価損益（円）    |
|            |               | うち1年超 |               |            |
| 市場取引       |               |       |               |            |
| REIT指数先物取引 |               |       |               |            |
| 買建         | 1,395,014,820 | -     | 1,326,750,000 | 68,345,340 |
| 合計         | 1,395,014,820 | -     | 1,326,750,000 | 68,345,340 |

## （注）時価の算定方法

## 1 先物取引

## 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 海外REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

(2023年 2月17日現在)

|                 |                |
|-----------------|----------------|
| 資産の部            |                |
| 流動資産            |                |
| 預金              | 573,420,328    |
| コール・ローン         | 43,394,891     |
| 投資証券            | 58,298,948,054 |
| 派生商品評価勘定        | 2,898,860      |
| 未収入金            | 6,454,252      |
| 未収配当金           | 103,220,581    |
| 差入委託証拠金         | 139,754,455    |
| 流動資産合計          | 59,168,091,421 |
| 資産合計            | 59,168,091,421 |
| 負債の部            |                |
| 流動負債            |                |
| 派生商品評価勘定        | 8,065,344      |
| 未払解約金           | 3,979,885      |
| 未払利息            | 10             |
| その他未払費用         | 162,800        |
| 流動負債合計          | 12,208,039     |
| 負債合計            | 12,208,039     |
| 純資産の部           |                |
| 元本等             |                |
| 元本              | 18,272,411,167 |
| 剰余金             |                |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 40,883,472,215 |
| 元本等合計           | 59,155,883,382 |
| 純資産合計           | 59,155,883,382 |
| 負債純資産合計         | 59,168,091,421 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法     | <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
| 2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>                                                                                                                                                                   |
| 3.費用・収益の計上基準          | <p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>    |
| 4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>                                                            |

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

## （貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 3.2374円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (32,374円) |

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

|                                           |
|-------------------------------------------|
| <p>自 2022年 2月18日</p> <p>至 2023年 2月17日</p> |
|-------------------------------------------|

## 1.金融商品に対する取組方針

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

## 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、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

2023年 2月17日現在

## 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2.時価の算定方法

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2023年 2月17日現在

|                                  |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| 期首                               | 2022年 2月18日     |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 16,192,356,534円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 6,181,230,955円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 4,101,176,322円  |
| 期末元本額                            | 18,272,411,167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）               | 1,416,980,482円  |

|                                                                              |                |
|------------------------------------------------------------------------------|----------------|
| 野村世界 6 資産分散投信（分配コース）                                                         | 1,836,195,688円 |
| 野村世界 6 資産分散投信（成長コース）                                                         | 885,296,866円   |
| 野村資産設計ファンド 2 0 1 5                                                           | 11,231,333円    |
| 野村資産設計ファンド 2 0 2 0                                                           | 12,143,040円    |
| 野村資産設計ファンド 2 0 2 5                                                           | 15,491,074円    |
| 野村資産設計ファンド 2 0 3 0                                                           | 17,602,279円    |
| 野村資産設計ファンド 2 0 3 5                                                           | 18,389,370円    |
| 野村資産設計ファンド 2 0 4 0                                                           | 33,351,164円    |
| 野村資産設計ファンド 2 0 4 5                                                           | 5,091,153円     |
| 野村インデックスファンド・外国 R E I T                                                      | 1,650,718,085円 |
| ネクストコア                                                                       | 3,956,126円     |
| 野村インデックスファンド・海外 5 資産バランス                                                     | 554,284,845円   |
| 野村世界 6 資産分散投信（配分変更コース）                                                       | 255,644,642円   |
| 野村資産設計ファンド 2 0 5 0                                                           | 4,293,106円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                            | 1,032,857円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                            | 1,124,610円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                            | 7,285,632円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                            | 1,980,694円     |
| インデックス・ブレンド（タイプ ）                                                            | 6,767,445円     |
| 野村 6 資産均等バランス                                                                | 2,453,862,189円 |
| 野村資産設計ファンド 2 0 6 0                                                           | 3,063,208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<br>ヘッジなし）連動型上場投信 | 5,079,341,954円 |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア） R E I T                                                   | 2,816,105,563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）                                     | 890,119,134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）                                | 66,611,122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<br>機関投資家専用）                    | 375,239円       |
| 野村 D C 運用戦略ファンド                                                              | 147,536,052円   |
| 野村 D C 運用戦略ファンド（マイルド）                                                        | 9,709,226円     |
| 野村世界 6 資産分散投信（ D C ）安定コース                                                    | 9,776,121円     |
| 野村世界 6 資産分散投信（ D C ）インカムコース                                                  | 4,649,181円     |
| 野村世界 6 資産分散投信（ D C ）成長コース                                                    | 11,120,198円    |
| 野村資産設計ファンド（ D C ・つみたて N I S A ） 2 0 3 0                                      | 7,541,349円     |
| 野村資産設計ファンド（ D C ・つみたて N I S A ） 2 0 4 0                                      | 8,012,110円     |
| 野村資産設計ファンド（ D C ・つみたて N I S A ） 2 0 5 0                                      | 3,089,270円     |
| 野村資産設計ファンド（ D C ・つみたて N I S A ） 2 0 6 0                                      | 2,072,002円     |
| 多資産分散投資ファンド（バランス 1 0 ）（確定拠出年金向け）                                             | 20,566,758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(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2023年2月17日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄                            | 券面総額   | 評価額          | 備考 |
|------|-----|-------------------------------|--------|--------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | ACADIA REALTY TRUST           | 30,300 | 463,893.00   |    |
|      |     | AGREE REALTY CORP             | 28,480 | 2,124,038.40 |    |
|      |     | ALEXANDER & BALDWIN INC       | 23,200 | 450,080.00   |    |
|      |     | ALEXANDERS INC                | 720    | 161,654.40   |    |
|      |     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT  | 48,150 | 7,800,781.50 |    |
|      |     | ALPINE INCOME PROPERTY TRUST  | 3,800  | 72,998.00    |    |
|      |     | AMERICAN ASSETS TRUST INC     | 16,600 | 437,576.00   |    |
|      |     | AMERICAN HOMES 4 RENT-A       | 98,800 | 3,309,800.00 |    |
|      |     | AMERICOLD REALTY TRUST INC    | 86,700 | 2,632,212.00 |    |
|      |     | APARTMENT INCOME REIT CO      | 48,100 | 1,890,330.00 |    |
|      |     | APARTMENT INVT&MGMT CO-A      | 49,200 | 374,904.00   |    |
|      |     | APPLE HOSPITALITY REIT INC    | 68,300 | 1,173,394.00 |    |
|      |     | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 22,000 | 293,040.00   |    |
|      |     | ASHFORD HOSPITALITY TRUST     | 12,000 | 73,080.00    |    |
|      |     | AVALONBAY COMMUNITIES INC     | 45,120 | 8,127,014.40 |    |
|      |     | BLUEROCK HOMES TRUST INC      | 1,100  | 22,495.00    |    |
|      |     | BOSTON PROPERTIES             | 45,930 | 3,278,024.10 |    |
|      |     | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC  | 20,000 | 97,800.00    |    |
|      |     | BRANDYWINE REALTY TRUST       | 56,700 | 373,086.00   |    |
|      |     | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC    | 96,400 | 2,228,768.00 |    |
|      |     | BROADSTONE NET LEASE INC-A    | 55,600 | 1,022,484.00 |    |
|      |     | BRT APARTMENTS CORP           | 3,500  | 73,710.00    |    |
|      |     | CAMDEN PROPERTY TRUST         | 34,320 | 4,120,116.00 |    |
|      |     | CARETRUST REIT INC            | 31,400 | 648,410.00   |    |
|      |     | CBL & ASSOCIATES PROPERTIES   | 8,200  | 215,004.00   |    |
|      |     | CENTERSPACE                   | 4,820  | 314,697.80   |    |
|      |     | CHATHAM LODGING TRUST         | 16,300 | 220,376.00   |    |
|      |     | CITY OFFICE REIT INC          | 12,800 | 119,296.00   |    |
|      |     | CLIPPER REALTY INC            | 4,000  | 27,200.00    |    |
|      |     | COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I  | 7,700  | 317,625.00   |    |
|      |     | CORPORATE OFFICE PROPERTIES   | 36,500 | 952,650.00   |    |

|                                       |         |               |  |
|---------------------------------------|---------|---------------|--|
| COUSINS PROPERTIES INC                | 48,700  | 1,273,992.00  |  |
| CTO REALTY GROWTH INC                 | 5,600   | 107,800.00    |  |
| CUBESMART                             | 72,310  | 3,282,874.00  |  |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO            | 68,200  | 612,436.00    |  |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT          | 100,000 | 60,500.00     |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC              | 92,580  | 10,450,430.40 |  |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST          | 82,000  | 65,796.80     |  |
| DOUGLAS EMMETT INC                    | 57,100  | 894,757.00    |  |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST               | 100,000 | 0.00          |  |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES<br>INC | 29,400  | 470,694.00    |  |
| EASTGROUP PROPERTIES                  | 14,020  | 2,333,208.40  |  |
| ELME COMMUNITIES                      | 28,200  | 530,442.00    |  |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN          | 41,900  | 339,390.00    |  |
| EPR PROPERTIES                        | 24,100  | 1,024,250.00  |  |
| EQUINIX INC                           | 29,810  | 21,528,483.90 |  |
| EQUITY COMMONWEALTH                   | 35,200  | 913,440.00    |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES           | 56,350  | 4,027,898.00  |  |
| EQUITY RESIDENTIAL                    | 109,670 | 7,237,123.30  |  |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY           | 45,800  | 1,163,778.00  |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC              | 20,870  | 4,947,859.60  |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC               | 43,180  | 6,858,711.20  |  |
| FARMLAND PARTNERS INC                 | 16,100  | 202,377.00    |  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST             | 23,520  | 2,582,966.40  |  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR            | 42,490  | 2,294,460.00  |  |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST           | 26,900  | 776,334.00    |  |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C          | 31,000  | 86,490.00     |  |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE          | 82,980  | 4,385,493.00  |  |
| GETTY REALTY CORP                     | 13,600  | 472,872.00    |  |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP             | 13,100  | 214,316.00    |  |
| GLADSTONE LAND CORP                   | 10,600  | 198,750.00    |  |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC               | 20,000  | 217,200.00    |  |
| GLOBAL NET LEASE INC                  | 33,500  | 487,425.00    |  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC           | 122,500 | 2,562,700.00  |  |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC             | 173,200 | 4,496,272.00  |  |

|                                             |         |              |  |
|---------------------------------------------|---------|--------------|--|
| HERSHA HOSPITALITY TRUST                    | 11,200  | 98,112.00    |  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC                    | 34,200  | 1,002,060.00 |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC                   | 230,400 | 3,997,440.00 |  |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN                | 41,700  | 434,931.00   |  |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN                | 72,000  | 1,365,840.00 |  |
| INDUS REALTY TRUST INC                      | 1,800   | 113,670.00   |  |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES             | 19,700  | 94,166.00    |  |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES<br>INC     | 9,080   | 794,590.80   |  |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP                  | 21,800  | 535,844.00   |  |
| INVITATION HOMES INC                        | 187,300 | 6,104,107.00 |  |
| IRON MOUNTAIN INC                           | 93,700  | 4,981,092.00 |  |
| ISTAR INC                                   | 28,300  | 243,946.00   |  |
| JBG SMITH PROPERTIES                        | 32,200  | 612,766.00   |  |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT                  | 250,000 | 123,750.00   |  |
| KILROY REALTY CORP                          | 33,900  | 1,324,473.00 |  |
| KIMCO REALTY CORP                           | 199,300 | 4,209,216.00 |  |
| KITE REALTY GROUP TRUST                     | 70,300  | 1,597,919.00 |  |
| LIFE STORAGE INC                            | 27,360  | 3,343,939.20 |  |
| LTC PROPERTIES INC                          | 13,100  | 493,346.00   |  |
| LXP INDUSTRIAL TRUST                        | 88,600  | 992,320.00   |  |
| MACERICH CO /THE                            | 68,900  | 884,676.00   |  |
| MANULIFE US REAL ESTATE<br>INVESTMENT TRUST | 590,515 | 165,344.20   |  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC                | 192,400 | 2,466,568.00 |  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM                  | 37,230  | 6,254,640.00 |  |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC              | 57,520  | 2,690,210.40 |  |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES                 | 27,200  | 1,128,800.00 |  |
| NATL HEALTH INVESTORS INC                   | 13,910  | 814,847.80   |  |
| NETSTREIT CORP                              | 17,700  | 343,026.00   |  |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE<br>TRUST   | 10,500  | 136,080.00   |  |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC              | 7,240   | 358,307.60   |  |
| OFFICE PROPERTIES INCOME                    | 15,500  | 272,335.00   |  |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS                  | 75,300  | 2,152,827.00 |  |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC                  | 5,500   | 129,525.00   |  |

|                                            |         |               |  |
|--------------------------------------------|---------|---------------|--|
| ORION OFFICE REIT INC                      | 18,000  | 164,880.00    |  |
| PARAMOUNT GROUP INC                        | 54,600  | 319,410.00    |  |
| PARK HOTELS & RESORTS INC                  | 72,300  | 1,002,078.00  |  |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST                    | 42,900  | 664,521.00    |  |
| PHILLIPS EDISON & CO INC                   | 37,700  | 1,299,519.00  |  |
| PHYSICIANS REALTY TRUST                    | 73,400  | 1,157,518.00  |  |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A               | 39,900  | 409,374.00    |  |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC               | 12,300  | 263,097.00    |  |
| POSTAL REALTY TRUST INC-A                  | 5,500   | 84,370.00     |  |
| PRIME US REIT                              | 212,000 | 94,340.00     |  |
| PROLOGIS INC                               | 297,400 | 37,409,946.00 |  |
| PUBLIC STORAGE                             | 50,910  | 15,250,599.60 |  |
| REALTY INCOME CORP                         | 201,970 | 13,392,630.70 |  |
| REGENCY CENTERS CORP                       | 49,590  | 3,203,514.00  |  |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN               | 40,300  | 593,619.00    |  |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC              | 59,100  | 3,655,335.00  |  |
| RLJ LODGING TRUST                          | 52,600  | 607,004.00    |  |
| RPT REALTY                                 | 27,100  | 293,764.00    |  |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES               | 17,710  | 1,602,223.70  |  |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC                 | 75,100  | 980,055.00    |  |
| SAFEHOLD INC                               | 8,000   | 258,400.00    |  |
| SAUL CENTERS INC                           | 4,300   | 177,719.00    |  |
| SERVICE PROPERTIES TRUST                   | 53,400  | 561,768.00    |  |
| SIMON PROPERTY GROUP INC                   | 105,290 | 13,092,811.50 |  |
| SITE CENTERS CORP                          | 60,300  | 833,346.00    |  |
| SL GREEN REALTY CORP                       | 20,920  | 807,930.40    |  |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC                  | 44,900  | 1,983,682.00  |  |
| STAG INDUSTRIAL INC                        | 57,600  | 2,022,336.00  |  |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC                | 34,000  | 272,000.00    |  |
| SUN COMMUNITIES INC                        | 39,940  | 6,305,727.20  |  |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC               | 67,400  | 694,220.00    |  |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER               | 33,400  | 618,568.00    |  |
| TERRENO REALTY CORP                        | 23,250  | 1,480,560.00  |  |
| THE NECESSITY RETAIL REIT WHERE<br>AMERICA | 44,200  | 293,930.00    |  |

|       |                                          |           |                  |  |
|-------|------------------------------------------|-----------|------------------|--|
| 小計    | UDR INC                                  | 98,600    | 4,434,042.00     |  |
|       | UMH PROPERTIES INC                       | 16,300    | 290,140.00       |  |
|       | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME             | 4,200     | 234,402.00       |  |
|       | URBAN EDGE PROPERTIES                    | 38,000    | 604,200.00       |  |
|       | URSTADT BIDDLE-CL A                      | 9,600     | 174,048.00       |  |
|       | VENTAS INC                               | 128,880   | 6,559,992.00     |  |
|       | VERIS RESIDENTIAL INC                    | 25,300    | 416,691.00       |  |
|       | VICI PROPERTIES INC                      | 310,100   | 10,571,309.00    |  |
|       | VORNADO REALTY TRUST                     | 51,800    | 1,166,536.00     |  |
|       | WELLTOWER INC                            | 152,210   | 11,879,990.50    |  |
|       | WHITESTONE REIT                          | 15,000    | 152,700.00       |  |
|       | WP CAREY INC                             | 67,060    | 5,640,416.60     |  |
|       | XENIA HOTELS & RESORTS INC               | 37,000    | 525,030.00       |  |
|       | 銘柄数：145                                  | 8,307,905 | 335,279,065.80   |  |
|       |                                          |           | (45,061,506,443) |  |
| カナダドル | 組入時価比率：76.2%                             |           | 77.3%            |  |
|       | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT             | 20,400    | 584,664.00       |  |
|       | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT             | 18,000    | 170,280.00       |  |
|       | AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST | 6,000     | 74,220.00        |  |
|       | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST             | 7,400     | 433,566.00       |  |
|       | BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST         | 5,700     | 112,290.00       |  |
|       | BTB REAL ESTATE INVESTMENT T             | 15,000    | 57,000.00        |  |
|       | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA             | 27,100    | 1,353,645.00     |  |
|       | CHOICE PROPERTIES REIT                   | 51,100    | 747,593.00       |  |
|       | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT           | 17,300    | 279,222.00       |  |
|       | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR             | 17,000    | 274,550.00       |  |
|       | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT  | 39,600    | 580,140.00       |  |
|       | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 8,000     | 132,000.00       |  |
|       | EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES             | 11,000    | 39,710.00        |  |
|       | FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT     | 33,200    | 594,280.00       |  |
|       | GRANITE REAL ESTATE INVESTME             | 10,000    | 840,000.00       |  |
|       | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS             | 41,100    | 538,821.00       |  |
|       | INOVALIS REAL ESTATE INVESTM             | 4,000     | 18,040.00        |  |

|     |                                  |         |                 |  |
|-----|----------------------------------|---------|-----------------|--|
| 小計  | INTERRENT REAL ESTATE INVEST     | 23,000  | 337,410.00      |  |
|     | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE     | 17,800  | 327,876.00      |  |
|     | MINTO APARTMENT REAL ESTATE      | 6,400   | 103,488.00      |  |
|     | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI     | 5,800   | 107,938.00      |  |
|     | NEXUS INDUSTRIAL REIT            | 8,000   | 88,080.00       |  |
|     | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT     | 39,000  | 377,910.00      |  |
|     | PRIMARIS REIT                    | 15,925  | 243,652.50      |  |
|     | PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 11,000  | 69,850.00       |  |
|     | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR      | 47,500  | 1,052,600.00    |  |
|     | SLATE GROCERY REIT               | 9,400   | 139,308.00      |  |
|     | SLATE OFFICE REIT                | 12,000  | 53,280.00       |  |
|     | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV     | 22,800  | 627,000.00      |  |
|     | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E     | 14,000  | 85,120.00       |  |
|     | 銘柄数：30                           | 564,525 | 10,443,533.50   |  |
|     |                                  |         | (1,041,846,901) |  |
|     | 組入時価比率：1.8%                      |         | 1.8%            |  |
| ユーロ | AEDIFICA                         | 12,720  | 1,022,052.00    |  |
|     | ALSTRIA OFFICE REIT-AG           | 4,000   | 31,280.00       |  |
|     | ALTAREA                          | 1,540   | 196,196.00      |  |
|     | CARE PROPERTY INVEST             | 12,533  | 177,968.60      |  |
|     | CARMILA                          | 18,400  | 259,072.00      |  |
|     | COFINIMMO                        | 9,810   | 840,226.50      |  |
|     | COVIVIO                          | 14,860  | 936,923.00      |  |
|     | CROMWELL REIT EUR                | 116,000 | 193,720.00      |  |
|     | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV     | 14,100  | 327,684.00      |  |
|     | GECINA SA                        | 17,480  | 1,938,532.00    |  |
|     | HAMBORNER REIT AG                | 22,000  | 166,980.00      |  |
|     | ICADE                            | 10,300  | 457,732.00      |  |
|     | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ     | 18,000  | 49,860.00       |  |
|     | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA  | 96,500  | 652,822.50      |  |
|     | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES   | 7,600   | 151,088.00      |  |
|     | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES     | 135,000 | 158,220.00      |  |
|     | KLEPIERRE                        | 62,600  | 1,484,246.00    |  |
|     | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM     | 20,000  | 93,900.00       |  |
|     | MERCIALYS                        | 26,000  | 262,860.00      |  |
|     | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA      | 106,800 | 968,676.00      |  |

|      |                                        |           |                 |  |
|------|----------------------------------------|-----------|-----------------|--|
| 小計   | MONTEA                                 | 4,100     | 317,750.00      |  |
|      | NSI NV                                 | 5,600     | 133,840.00      |  |
|      | RETAIL ESTATES                         | 3,600     | 237,960.00      |  |
|      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 34,360    | 2,060,912.80    |  |
|      | VASTNED RETAIL NV                      | 6,200     | 138,570.00      |  |
|      | WAREHOUSES DE PAUW SCA                 | 49,600    | 1,473,120.00    |  |
|      | WERELDHAVE NV                          | 12,600    | 186,480.00      |  |
|      | XIOR STUDENT HOUSING NV                | 7,500     | 228,750.00      |  |
|      | 銘柄数：28                                 | 849,803   | 15,147,421.40   |  |
|      |                                        |           | (2,169,110,744) |  |
| 英ボンド | 組入時価比率：3.7%                            |           | 3.7%            |  |
|      | ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED    | 140,000   | 91,140.00       |  |
|      | AEW UK REIT PLC                        | 48,000    | 48,000.00       |  |
|      | ASSURA PLC                             | 941,000   | 499,200.50      |  |
|      | BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 270,000   | 224,910.00      |  |
|      | BIG YELLOW GROUP PLC                   | 56,700    | 727,461.00      |  |
|      | BRITISH LAND                           | 300,400   | 1,346,092.40    |  |
|      | CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC      | 268,000   | 336,340.00      |  |
|      | CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC             | 214,000   | 133,322.00      |  |
|      | CLS HOLDINGS PLC                       | 59,000    | 92,040.00       |  |
|      | CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC     | 139,000   | 127,880.00      |  |
|      | DERWENT LONDON PLC                     | 36,500    | 955,570.00      |  |
|      | EDISTON PROPERTY INVESTMENT            | 70,000    | 45,920.00       |  |
|      | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC           | 203,000   | 177,828.00      |  |
|      | GREAT PORTLAND ESTATES PLC             | 80,100    | 455,368.50      |  |
|      | HAMMERSON PLC                          | 1,250,000 | 374,750.00      |  |
|      | HOME REIT PLC                          | 267,000   | 101,593.50      |  |
|      | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC             | 139,000   | 140,946.00      |  |
|      | INTU PROPERTIES PLC                    | 184,000   | 0.00            |  |
|      | LAND SECURITIES GROUP PLC              | 241,100   | 1,692,039.80    |  |
|      | LONDONMETRIC PROPERTY PLC              | 320,000   | 615,680.00      |  |
|      | LXI REIT PLC                           | 544,000   | 634,304.00      |  |
|      | NEWRIVER REIT PLC                      | 100,000   | 92,500.00       |  |
|      |                                        |           |                 |  |
|      |                                        |           |                 |  |
|      |                                        |           |                 |  |
|      |                                        |           |                 |  |
|      |                                        |           |                 |  |

|     |                                            |           |                 |  |
|-----|--------------------------------------------|-----------|-----------------|--|
| 小計  | PICTON PROPERTY INCOME LTD                 | 170,000   | 132,600.00      |  |
|     | PRIMARY HEALTH PROPERTIES                  | 440,000   | 484,440.00      |  |
|     | PRS REIT PLC/THE                           | 170,000   | 154,360.00      |  |
|     | REGIONAL REIT LTD                          | 151,000   | 91,355.00       |  |
|     | SAFESTORE HOLDINGS PLC                     | 68,700    | 729,594.00      |  |
|     | SCHRODER REAL ESTATE INVESTM<br>TRUST      | 200,000   | 94,600.00       |  |
|     | SEGRO PLC                                  | 389,200   | 3,254,490.40    |  |
|     | SHAFTESBURY PLC                            | 94,000    | 397,620.00      |  |
|     | SUPERMARKET INCOME REIT PLC                | 410,000   | 392,780.00      |  |
|     | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING                | 120,000   | 66,720.00       |  |
|     | TRITAX BIG BOX REIT PLC                    | 597,000   | 914,007.00      |  |
|     | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT                | 270,000   | 149,310.00      |  |
|     | UNITE GROUP PLC                            | 128,200   | 1,271,103.00    |  |
|     | URBAN LOGISTICS REIT PLC                   | 151,000   | 211,400.00      |  |
|     | WAREHOUSE REIT PLC                         | 138,000   | 150,144.00      |  |
|     | WORKSPACE GROUP PLC                        | 44,000    | 225,060.00      |  |
|     | 銘柄数：38                                     | 9,411,900 | 17,632,469.10   |  |
|     |                                            |           | (2,834,948,381) |  |
|     | 組入時価比率：4.8%                                |           | 4.9%            |  |
| 豪ドル | ABACUS PROPERTY GROUP                      | 130,000   | 397,800.00      |  |
|     | ARENA REIT                                 | 116,000   | 450,080.00      |  |
|     | BWP TRUST                                  | 153,000   | 607,410.00      |  |
|     | CENTURIA CAPITAL GROUP                     | 220,000   | 422,400.00      |  |
|     | CENTURIA INDUSTRIAL REIT                   | 181,000   | 628,070.00      |  |
|     | CENTURIA OFFICE REIT                       | 139,000   | 230,740.00      |  |
|     | CHARTER HALL GROUP                         | 151,400   | 2,280,084.00    |  |
|     | CHARTER HALL LONG WALE REIT                | 210,000   | 980,700.00      |  |
|     | CHARTER HALL RETAIL REIT                   | 172,000   | 710,360.00      |  |
|     | CHARTER HALL SOCIAL<br>INFRASTRUCTURE REIT | 104,000   | 347,360.00      |  |
|     | CROMWELL PROPERTY GROUP                    | 475,000   | 346,750.00      |  |
|     | DEXUS INDUSTRIA REIT                       | 70,000    | 221,200.00      |  |
|     | DEXUS/AU                                   | 345,000   | 3,025,650.00    |  |
|     | GDI PROPERTY GROUP                         | 160,000   | 129,600.00      |  |
|     | GOODMAN GROUP                              | 551,600   | 11,158,868.00   |  |
|     |                                            |           |                 |  |

|                |                                        |            |                 |  |
|----------------|----------------------------------------|------------|-----------------|--|
| 小計             | GPT GROUP                              | 614,000    | 2,916,500.00    |  |
|                | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR           | 91,000     | 312,130.00      |  |
|                | HEALTHCO REIT                          | 73,000     | 112,785.00      |  |
|                | HMC CAPITAL LTD                        | 66,000     | 306,240.00      |  |
|                | HOMEEO DAILY NEEDS REIT                | 517,000    | 682,440.00      |  |
|                | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L           | 66,000     | 242,220.00      |  |
|                | INGENIA COMMUNITIES GROUP              | 118,000    | 551,060.00      |  |
|                | MIRVAC GROUP                           | 1,266,000  | 2,886,480.00    |  |
|                | NATIONAL STORAGE REIT                  | 358,000    | 862,780.00      |  |
|                | RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE           | 100,000    | 81,000.00       |  |
|                | REGION RE LTD                          | 359,000    | 929,810.00      |  |
|                | RURAL FUNDS GROUP                      | 121,000    | 295,240.00      |  |
|                | SCENTRE GROUP                          | 1,670,000  | 4,959,900.00    |  |
|                | STOCKLAND TRUST GROUP                  | 766,000    | 3,018,040.00    |  |
|                | VICINITY CENTRES                       | 1,240,000  | 2,591,600.00    |  |
|                | WAYPOINT REIT                          | 237,000    | 651,750.00      |  |
|                | 銘柄数：31                                 | 10,840,000 | 43,337,047.00   |  |
|                |                                        |            | (3,995,675,733) |  |
|                | 組入時価比率：6.8%                            |            | 6.9%            |  |
| ニュージーランド<br>ドル | ARGOSY PROPERTY LTD                    | 290,000    | 329,150.00      |  |
|                | GOODMAN PROPERTY TRUST                 | 340,000    | 727,600.00      |  |
|                | KIWI PROPERTY GROUP LTD                | 500,000    | 480,000.00      |  |
|                | PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND        | 440,000    | 574,200.00      |  |
|                | STRIDE PROPERTY GROUP                  | 170,000    | 244,800.00      |  |
|                | VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST        | 150,000    | 372,000.00      |  |
|                | 銘柄数：6                                  | 1,890,000  | 2,727,750.00    |  |
| 香港ドル           | CHAMPION REIT                          | 600,000    | 2,142,000.00    |  |
|                | FORTUNE REIT                           | 460,000    | 3,082,000.00    |  |
|                | LINK REIT                              | 679,400    | 36,517,750.00   |  |
|                | PROSPERITY REIT                        | 430,000    | 976,100.00      |  |
|                | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT        | 330,000    | 1,138,500.00    |  |
|                | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT<br>TRUST | 759,800    | 1,975,480.00    |  |
|                | 銘柄数：6                                  | 3,259,200  | 45,831,830.00   |  |

|          |                                        |            |                 |  |
|----------|----------------------------------------|------------|-----------------|--|
|          |                                        |            | (784,640,929)   |  |
|          | 組入時価比率：1.3%                            |            | 1.3%            |  |
| シンガポールドル | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD          | 170,000    | 226,100.00      |  |
|          | CAPITALAND ASCENDAS REIT               | 1,078,762  | 2,988,170.74    |  |
|          | CAPITALAND ASCOTT TRUST                | 655,956    | 688,753.80      |  |
|          | CAPITALAND CHINA TRUST                 | 386,279    | 440,358.06      |  |
|          | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 1,617,694  | 3,105,972.48    |  |
|          | CDL HOSPITALITY TRUSTS                 | 267,000    | 339,090.00      |  |
|          | DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST            | 170,000    | 106,250.00      |  |
|          | EC WORLD REIT                          | 60,000     | 27,300.00       |  |
|          | ESR-LOGOS REIT                         | 1,809,692  | 633,392.20      |  |
|          | FAR EAST HOSPITALITY TRUST             | 330,000    | 217,800.00      |  |
|          | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST           | 356,400    | 98,010.00       |  |
|          | FRASERS CENTREPOINT TRUST              | 353,838    | 757,213.32      |  |
|          | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST   | 946,746    | 1,192,899.96    |  |
|          | KEPPEL DC REIT                         | 421,211    | 855,058.33      |  |
|          | KEPPEL REIT                            | 656,000    | 600,240.00      |  |
|          | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL            | 625,000    | 431,250.00      |  |
|          | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST             | 638,900    | 1,495,026.00    |  |
|          | MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | 1,029,980  | 1,709,766.80    |  |
|          | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST    | 747,716    | 1,263,640.04    |  |
|          | QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I           | 780,216    | 265,273.44      |  |
|          | PARAGON REIT                           | 360,000    | 345,600.00      |  |
|          | PARKWAY LIFE REAL ESTATE               | 124,000    | 497,240.00      |  |
|          | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME           | 180,000    | 148,500.00      |  |
|          | STARHILL GLOBAL REIT                   | 460,000    | 248,400.00      |  |
|          | SUNTEC REIT                            | 712,000    | 989,680.00      |  |
| 小計       | 銘柄数：25                                 | 14,937,390 | 19,670,985.17   |  |
|          |                                        |            | (1,976,934,009) |  |
|          | 組入時価比率：3.3%                            |            | 3.4%            |  |
| ウォン      | D&D PLATFORM REIT CO LTD               | 16,000     | 57,760,000.00   |  |
|          | E KOCREF CR-REIT CO LTD                | 8,000      | 41,680,000.00   |  |
|          | ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD         | 54,000     | 224,370,000.00  |  |
|          | IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD            | 12,000     | 60,480,000.00   |  |

|    |             |                               |                  |                  |  |
|----|-------------|-------------------------------|------------------|------------------|--|
|    |             | 有価証券報告書（内国投資信託）               |                  |                  |  |
|    | 小計          | JR REIT XXVII                 | 48,000           | 215,280,000.00   |  |
|    |             | KORAMCO ENERGY PLUS REIT      | 11,445           | 59,285,100.00    |  |
|    |             | LOTTE REIT CO LTD             | 40,000           | 155,800,000.00   |  |
|    |             | MIRAE ASIA PAC REAL EST-1     | 30,000           | 125,100,000.00   |  |
|    |             | NH ALL-ONE REIT CO LTD        | 14,000           | 50,190,000.00    |  |
|    |             | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD     | 21,000           | 141,330,000.00   |  |
|    |             | SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD | 8,000            | 31,640,000.00    |  |
|    |             | SK REITS CO LTD               | 22,822           | 119,359,060.00   |  |
|    |             | 銘柄数：12                        | 285,267          | 1,282,274,160.00 |  |
|    |             |                               |                  | (133,356,512)    |  |
|    | 組入時価比率：0.2% |                               | 0.2%             |                  |  |
|    | 新シェケル       | MENIVIM-THE NEW REIT LTD      | 220,000          | 337,920.00       |  |
|    |             | REIT 1 LTD                    | 65,000           | 1,036,750.00     |  |
|    |             | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD | 70,000           | 529,900.00       |  |
|    |             | 銘柄数：3                         | 355,000          | 1,904,570.00     |  |
|    |             |                               |                  | (72,124,732)     |  |
| 小計 | 組入時価比率：0.1% |                               | 0.1%             |                  |  |
| 合計 |             |                               | 58,298,948,054   |                  |  |
|    |             |                               | (58,298,948,054) |                  |  |

(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         | 2023年 2月17日現在 |       |             |           |
|------------|---------------|-------|-------------|-----------|
|            | 契約額等（円）       |       | 時価（円）       | 評価損益（円）   |
|            |               | うち1年超 |             |           |
| 市場取引       |               |       |             |           |
| REIT指数先物取引 |               |       |             |           |
| 買建         | 727,582,464   | -     | 722,362,368 | 5,220,096 |
| 市場取引以外の取引  |               |       |             |           |
| 為替予約取引     |               |       |             |           |
| 買建         | 17,406,545    | -     | 17,460,157  | 53,612    |
| 米ドル        | 17,406,545    | -     | 17,460,157  | 53,612    |

|    |   |   |   |           |
|----|---|---|---|-----------|
| 合計 | - | - | - | 5,166,484 |
|----|---|---|---|-----------|

## （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。

## 野村マネー マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

（2023年 2月17日現在）

|                 |               |
|-----------------|---------------|
| 資産の部            |               |
| 流動資産            |               |
| コール・ローン         | 3,607,618,242 |
| 地方債証券           | 430,283,464   |
| 特殊債券            | 693,453,194   |
| 社債券             | 100,035,130   |
| 未収利息            | 756,500       |
| 前払費用            | 2,032,148     |
| 流動資産合計          | 4,834,178,678 |
| 資産合計            | 4,834,178,678 |
| 負債の部            |               |
| 流動負債            |               |
| 未払利息            | 863           |
| 流動負債合計          | 863           |
| 負債合計            | 863           |
| 純資産の部           |               |
| 元本等             |               |
| 元本              | 4,740,562,738 |
| 剰余金             |               |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 93,615,077    |
| 元本等合計           | 4,834,177,815 |
| 純資産合計           | 4,834,177,815 |
| 負債純資産合計         | 4,834,178,678 |

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

|                       |                                                                            |
|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------|
| 1.運用資産の評価基準及び評価方法     | 地方債証券、特殊債券、社債券<br>原則として時価で評価しております。<br>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 |
| 2.費用・収益の計上基準          | 有価証券売買等損益<br>約定日基準で計上しております。                                               |
| 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。           |

## （重要な会計上の見積りに関する注記）

該当事項はありません。

## （貸借対照表に関する注記）

| 2023年 2月17日現在              |           |
|----------------------------|-----------|
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |           |
| 1口当たり純資産額                  | 1.0197円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (10,197円) |

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年 2月18日<br>至 2023年 2月17日 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針                 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。                                                                                                                                                                                                    |
| 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク        | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。<br>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。<br>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。                                                                                                                                                               |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制               | 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。<br>○市場リスクの管理<br>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。<br>○信用リスクの管理<br>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。<br>○流動性リスクの管理<br>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。 |

## (2)金融商品の時価等に関する事項

| 2023年 2月17日現在                                                                                                                                                                                                                                           |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1．貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2．時価の算定方法</p> <p>地方債証券、特殊債券、社債券<br/>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務<br/>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年 2月17日現在                      |                |
|------------------------------------|----------------|
| 期首                                 | 2022年 2月18日    |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額   | 7,924,810,012円 |
| 同期中における追加設定元本額                     | 2,577,948,308円 |
| 同期中における一部解約元本額                     | 5,762,195,582円 |
| 期末元本額                              | 4,740,562,738円 |
| 期末元本額の内訳＊                          |                |
| 野村世界業種別投資シリーズ（マネープール・ファンド）         | 577,413,374円   |
| ノムラ・アジア・シリーズ（マネープール・ファンド）          | 87,276,471円    |
| ネクストコア                             | 2,282,012円     |
| 野村世界高金利通貨投信                        | 34,318,227円    |
| 野村新世界高金利通貨投信                       | 982,608円       |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（欧州通貨コース）        | 982,609円       |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円コース）           | 982,609円       |
| 欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（豪ドルコース）         | 982,609円       |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型         | 982,608円       |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型       | 98,261円        |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型       | 98,261円        |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型       | 982,608円       |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型   | 982,608円       |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型  | 982,608円       |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型     | 982,608円       |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型        | 98,261円        |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型      | 98,261円        |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）年2回決算型      | 9,826円         |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型      | 982,608円       |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型  | 982,608円       |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型 | 98,260円        |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型    | 98,261円        |
| 野村日本ブランド株投資（円コース）毎月分配型             | 982,609円       |
| 野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型           | 982,608円       |
| 野村日本ブランド株投資（ブラジルリアルコース）毎月分配型       | 982,608円       |

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

|                                      |          |
|--------------------------------------|----------|
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型  | 984,252円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（円コース）年2回決算型       | 984,252円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）年2回決算型     | 98,261円  |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（豪ドルコース）年2回決算型     | 984,252円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型 | 984,252円 |
| 野村日本ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型           | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型           | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型          | 982,609円 |
| 野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型          | 982,609円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）毎月分配型      | 982,607円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）毎月分配型  | 982,607円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）毎月分配型  | 982,608円 |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）年2回決算型     | 98,261円  |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）年2回決算型 | 98,261円  |
| 野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）年2回決算型 | 98,261円  |
| 野村米国ブランド株投資（円コース）毎月分配型               | 98,261円  |
| 野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型           | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型           | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資（円コース）年2回決算型              | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型          | 983,768円 |
| 野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型          | 983,768円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型             | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）毎月分配型         | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）毎月分配型         | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（円コース）年2回決算型            | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）年2回決算型        | 983,672円 |
| ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）年2回決算型        | 983,672円 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース              | 983,381円 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース              | 98,261円  |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース              | 983,381円 |
| 野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース              | 983,381円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型      | 982,609円 |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型     | 98,262円  |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）毎月分配型   | 982,609円 |
| 野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）年2回決算型  | 98,261円  |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型          | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型     | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型         | 983,091円 |
| 野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型    | 983,091円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型          | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型     | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）毎月分配型  | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型         | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型    | 982,898円 |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）年2回決算型 | 982,898円 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型                | 982,801円 |
| 野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型               | 491,401円 |
| 野村グローバルREITプレミアム（円コース）毎月分配型          | 982,608円 |

|                                    |          |
|------------------------------------|----------|
| 野村グローバルＲＥＩＴプレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型   | 982,608円 |
| 野村グローバルＲＥＩＴプレミアム（円コース）年２回決算型       | 982,608円 |
| 野村グローバルＲＥＩＴプレミアム（通貨セレクトコース）年２回決算型  | 982,608円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型           | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型      | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（円コース）年２回決算型          | 982,415円 |
| 野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年２回決算型     | 982,415円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）毎月分配型       | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型  | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）年２回決算型      | 982,029円 |
| 野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）年２回決算型 | 982,029円 |
| 野村カルミニャック・ファンド Ａコース                | 981,547円 |
| 野村カルミニャック・ファンド Ｂコース                | 981,547円 |
| 野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）毎月分配型           | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）毎月分配型           | 966円     |
| 野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）毎月分配型           | 177,539円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型       | 398,357円 |
| 野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）毎月分配型         | 123,377円 |
| 野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）毎月分配型        | 626,503円 |
| 野村通貨選択日本株投信（中国元コース）毎月分配型           | 23,859円  |
| 野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型     | 27,600円  |
| 野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型        | 149,947円 |
| 野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）年２回決算型          | 981,451円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）年２回決算型          | 3,114円   |
| 野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）年２回決算型          | 132,547円 |
| 野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）年２回決算型      | 100,946円 |
| 野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）年２回決算型        | 18,851円  |
| 野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）年２回決算型       | 373,897円 |
| 野村通貨選択日本株投信（中国元コース）年２回決算型          | 13,042円  |
| 野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）年２回決算型    | 14,308円  |
| 野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）年２回決算型       | 63,772円  |
| 野村エマージング債券プレミアム毎月分配型               | 981,451円 |
| 野村エマージング債券プレミアム年２回決算型              | 981,451円 |
| ノムラ ＴＨＥ ＵＳＡ Ａコース                   | 981,258円 |
| ノムラ ＴＨＥ ＵＳＡ Ｂコース                   | 981,258円 |
| 野村日本ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型           | 9,809円   |
| 野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）毎月分配型        | 9,809円   |
| 野村日本ブランド株投資（米ドルコース）年２回決算型          | 9,809円   |
| 野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）年２回決算型       | 9,809円   |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型      | 9,808円   |
| 野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年２回決算型     | 9,808円   |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型    | 9,808円   |
| 野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年２回決算型   | 9,808円   |
| 野村米国ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型           | 9,807円   |
| 野村米国ブランド株投資（米ドルコース）年２回決算型          | 9,807円   |
| 野村ＰＩＭＣＯ新興国インフラ関連債券投信（米ドルコース）毎月分配型  | 9,807円   |
| 野村ＰＩＭＣＯ新興国インフラ関連債券投信（米ドルコース）年２回決算型 | 9,807円   |
| 野村グローバルボンド投信 Ａコース                  | 98,049円  |

|                                          |                |
|------------------------------------------|----------------|
| 野村グローバルボンド投信 Bコース                        | 980,489円       |
| 野村グローバルボンド投信 Cコース                        | 98,049円        |
| 野村グローバルボンド投信 Dコース                        | 980,489円       |
| 野村グローバルボンド投信 Eコース                        | 98,049円        |
| 野村グローバルボンド投信 Fコース                        | 980,489円       |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型            | 9,805円         |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型         | 9,805円         |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型           | 9,805円         |
| 野村新米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型        | 9,805円         |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド（円コース）毎月分配型              | 9,803円         |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド（米ドルコース）毎月分配型            | 980,297円       |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド（通貨セレクトコース）毎月分配型         | 980,297円       |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド（円コース）年2回決算型             | 9,803円         |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド（米ドルコース）年2回決算型           | 980,297円       |
| 野村高配当インフラ関連株ファンド（通貨セレクトコース）年2回決算型        | 9,803円         |
| ノムラ新興国債券ファンズ（野村SMA・EW向け）                 | 9,801円         |
| 野村ブルーベイ・トータルリターンファンド（野村SMA・EW向け）         | 9,801円         |
| グローバル・ストック Aコース                          | 97,953円        |
| グローバル・ストック Bコース                          | 979,528円       |
| グローバル・ストック Cコース                          | 97,953円        |
| グローバル・ストック Dコース                          | 979,528円       |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース（野村SMA・EW向け）      | 9,794円         |
| 野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース（野村SMA・EW向け）      | 9,794円         |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース（野村SMA・EW向け） | 9,794円         |
| 野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース（野村SMA・EW向け） | 9,794円         |
| 野村ファンドラップ債券プレミア                          | 9,795円         |
| 野村ファンドラップオルタナティブプレミア                     | 9,795円         |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド（為替ヘッジあり）毎月分配型      | 9,797円         |
| 野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド（為替ヘッジあり）年2回決算型     | 9,797円         |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース                  | 9,797円         |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース                  | 9,797円         |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース                  | 9,797円         |
| 野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース                  | 9,797円         |
| （年3%目標払出）のむラップ・ファンド（普通型）                 | 98,001円        |
| （年6%目標払出）のむラップ・ファンド（普通型）                 | 98,001円        |
| 野村ブラックロック循環経済関連株投信 Aコース                  | 98,011円        |
| 野村ブラックロック循環経済関連株投信 Bコース                  | 98,011円        |
| 野村環境リーダーズ戦略ファンド Aコース                     | 98,020円        |
| 野村環境リーダーズ戦略ファンド Bコース                     | 98,020円        |
| マイライフ・エール（資産成長型）                         | 98,049円        |
| マイライフ・エール（年2%目標払出型）                      | 98,049円        |
| マイライフ・エール（年6%目標払出型）                      | 98,049円        |
| 野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Aコース                  | 98,059円        |
| 野村PIMCO・トレンド戦略ファンド Bコース                  | 98,059円        |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30（非課税適格機関投資家専用）   | 1,248,281,712円 |
| ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50（適格機関投資家転売制限付）   | 158,756,834円   |

|                                                |                |
|------------------------------------------------|----------------|
| 野村日経２２５ターゲット（公社債運用移行型）Ｋプライス（適格機関投資家専用）         | 1,941,761,887円 |
| 野村アンジェロ・ゴードンＢＤＣファンド（為替ヘッジあり）２２１０（適格機関投資家転売制限付） | 478,525,202円   |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド                                   | 85,180,134円    |
| 野村ＤＣテンブルトン・トータル・リターン Ａコース                      | 9,818円         |
| 野村ＤＣテンブルトン・トータル・リターン Ｂコース                      | 9,818円         |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）                             | 7,492,405円     |

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2023年2月17日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2023年2月17日現在)

（単位：円）

| 種類    | 通貨           | 銘柄                                | 券面総額        | 評価額           | 備考 |
|-------|--------------|-----------------------------------|-------------|---------------|----|
| 地方債証券 | 日本円          | 東京都 公募第 7 1 9 回                   | 100,000,000 | 100,071,496   |    |
|       |              | 神奈川県 公募第 1 9 6 回                  | 200,000,000 | 200,124,440   |    |
|       |              | 静岡県 公募平成 2 5 年度第 1 回              | 30,000,000  | 30,027,754    |    |
|       |              | 名古屋市 公募第 4 8 2 回                  | 100,000,000 | 100,059,774   |    |
|       |              | 銘柄数：4                             | 430,000,000 | 430,283,464   |    |
|       | 組入時価比率：8.9%  |                                   | 35.2%       |               |    |
|       | 合計           |                                   |             | 430,283,464   |    |
| 特殊債券  | 日本円          | 日本政策投資銀行社債 財投機関債第 9 1 回           | 100,000,000 | 100,014,864   |    |
|       |              | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 6 回  | 200,000,000 | 200,172,304   |    |
|       |              | 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第 1 9 5 回  | 292,000,000 | 293,225,480   |    |
|       |              | 預金保険機構債券 政府保証第 2 2 1 回            | 100,000,000 | 100,040,546   |    |
|       |              | 銘柄数：4                             | 692,000,000 | 693,453,194   |    |
|       | 組入時価比率：14.3% |                                   | 56.6%       |               |    |
|       | 合計           |                                   |             | 693,453,194   |    |
| 社債券   | 日本円          | 三井住友ファイナンス＆リース 第 1 8 回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 100,035,130   |    |
|       | 小計           | 銘柄数：1                             | 100,000,000 | 100,035,130   |    |
|       | 組入時価比率：2.1%  |                                   | 8.2%        |               |    |
| 合計    |              |                                   |             | 100,035,130   |    |
| 合計    |              |                                   |             | 1,223,771,788 |    |

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

#### 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）

2023年3月31日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 5,638,016,464円 |
| 負債総額           | 607,534,341円   |
| 純資産総額（ - ）     | 5,030,482,123円 |
| 発行済口数          | 4,982,286,132口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0097円        |

#### （参考）国内株式マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 565,332,756,661円 |
| 負債総額           | 73,228,881,667円  |
| 純資産総額（ - ）     | 492,103,874,994円 |
| 発行済口数          | 223,340,788,512口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.2034円          |

#### （参考）国内債券マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 22,391,882,972円 |
| 負債総額           | 265,238,695円    |
| 純資産総額（ - ）     | 22,126,644,277円 |
| 発行済口数          | 16,770,345,641口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.3194円         |

#### （参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                    |
|----------------|--------------------|
| 資産総額           | 1,494,016,734,598円 |
| 負債総額           | 3,379,749,763円     |
| 純資産総額（ - ）     | 1,490,636,984,835円 |
| 発行済口数          | 317,061,413,538口   |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 4.7014円            |

## （参考）外国債券マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                  |
|----------------|------------------|
| 資産総額           | 703,274,622,767円 |
| 負債総額           | 534,302,024円     |
| 純資産総額（ - ）     | 702,740,320,743円 |
| 発行済口数          | 275,444,092,102口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.5513円          |

## （参考）新興国株式マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 89,364,356,779円 |
| 負債総額           | 594,329,109円    |
| 純資産総額（ - ）     | 88,770,027,670円 |
| 発行済口数          | 56,847,455,340口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.5615円         |

## （参考）新興国債券マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 29,438,582,073円 |
| 負債総額           | 151,344,510円    |
| 純資産総額（ - ）     | 29,287,237,563円 |
| 発行済口数          | 15,332,932,812口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.9101円         |

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 8,877,440,164円 |
| 負債総額           | 5,094,430円     |
| 純資産総額（ - ）     | 8,872,345,734円 |
| 発行済口数          | 5,898,899,820口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.5041円        |

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 46,696,860,815円 |
| 負債総額           | 1,490,856,155円  |
| 純資産総額（ - ）     | 45,206,004,660円 |
| 発行済口数          | 18,004,537,256口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.5108円         |

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                 |
|----------------|-----------------|
| 資産総額           | 56,239,541,381円 |
| 負債総額           | 222,799,142円    |
| 純資産総額（ - ）     | 56,016,742,239円 |
| 発行済口数          | 18,907,653,218口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 2.9626円         |

（参考）野村マネー マザーファンド

2023年3月31日現在

|                |                |
|----------------|----------------|
| 資産総額           | 4,799,632,934円 |
| 負債総額           | 2,782円         |
| 純資産総額（ - ）     | 4,799,630,152円 |
| 発行済口数          | 4,706,762,600口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.0197円        |

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

##### (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

##### (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

##### (3) 受益権の譲渡

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るときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### (4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

#### (5) 受益権の再分割

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

#### (6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱い

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、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

2023年3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。

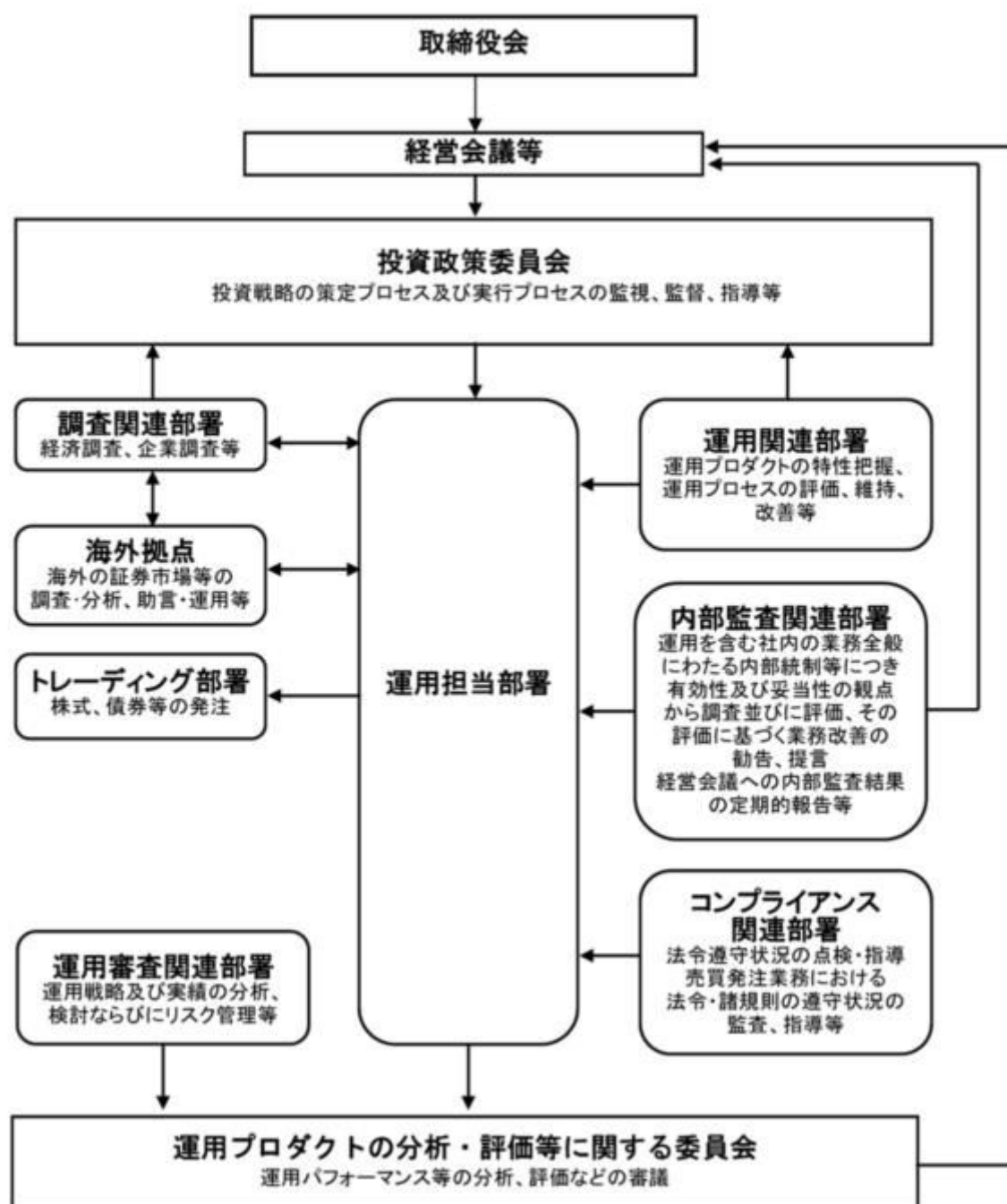
###### 代表取締役・業務執行取締役

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2023年2月28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  | 1,006 | 39,480,600 |
| 単位型株式投資信託  | 198   | 841,486    |
| 追加型公社債投資信託 | 14    | 6,333,980  |
| 単位型公社債投資信託 | 483   | 1,076,248  |
| 合計         | 1,701 | 47,732,314 |

### ３【委託会社等の経理状況】

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

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

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

３．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2021年4月1日から2022年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

#### (１)【貸借対照表】

|          |          | 前事業年度<br>(2021年3月31日) | 当事業年度<br>(2022年3月31日) |
|----------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 区分       | 注記<br>番号 | 金額(百万円)               | 金額(百万円)               |
| (資産の部)   |          |                       |                       |
| 流動資産     |          |                       |                       |
| 現金・預金    |          | 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<br>(2021年3月31日) |        | 当事業年度<br>(2022年3月31日) |        |
|-----------|----------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
| 区分        | 注記<br>番号 | 金額(百万円)               |        | 金額(百万円)               |        |
| (負債の部)    |          |                       |        |                       |        |
| 流動負債      |          |                       |        |                       |        |
| 預り金       |          |                       | 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<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |         | 当事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日) |         |
|-----------|----------|----------------------------------------|---------|----------------------------------------|---------|
| 区分        | 注記<br>番号 | 金額(百万円)                                |         | 金額(百万円)                                |         |
| 営業収益      |          |                                        |         |                                        |         |
| 委託者報酬     |          |                                        | 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<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日) |        | 当事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日) |        |
|--------------|----------|----------------------------------------|--------|----------------------------------------|--------|
| 区分           | 注記<br>番号 | 金額(百万円)                                |        | 金額(百万円)                                |        |
| 営業外収益        |          |                                        |        |                                        |        |
| 受取配当金        | 1        | 4,540                                  |        | 3,530                                  |        |
| 受取利息         |          | 0                                      |        | 10                                     |        |
| 金銭の信託運用益     |          | 1,698                                  |        | -                                      |        |
| その他          |          | 447                                    |        | 1,268                                  |        |
| 営業外収益計       |          |                                        | 6,687  |                                        | 4,809  |
| 営業外費用        |          |                                        |        |                                        |        |
| 金銭の信託運用損     |          | -                                      |        | 1,387                                  |        |
| 時効後支払損引当金繰入額 |          | 13                                     |        | 12                                     |        |
| 為替差損         |          | 26                                     |        | 23                                     |        |
| その他          |          | 32                                     |        | 266                                    |        |
| 営業外費用計       |          |                                        | 72     |                                        | 1,689  |
| 経常利益         |          |                                        | 36,157 |                                        | 36,477 |
| 特別利益         |          |                                        |        |                                        |        |
| 投資有価証券等売却益   |          | 71                                     |        | 26                                     |        |
| 株式報酬受入益      |          | 48                                     |        | 53                                     |        |
| 固定資産売却益      |          | -                                      |        | 9                                      |        |
| 資産除去債務履行差額   |          | -                                      |        | 141                                    |        |
| 移転補償金        |          | 2,077                                  |        | -                                      |        |
| 特別利益計        |          |                                        | 2,197  |                                        | 230    |
| 特別損失         |          |                                        |        |                                        |        |
| 投資有価証券等売却損   |          | -                                      |        | 0                                      |        |
| 投資有価証券等評価損   |          | 36                                     |        | -                                      |        |
| 関係会社株式評価損    |          | 582                                    |        | 727                                    |        |
| 固定資産除却損      | 2        | 105                                    |        | 374                                    |        |
| 資産除去債務履行差額   |          | -                                      |        | 0                                      |        |
| 事務所移転費用      |          | 406                                    |        | 54                                     |        |
| 特別損失計        |          |                                        | 1,129  |                                        | 1,158  |
| 税引前当期純利益     |          |                                        | 37,225 |                                        | 35,549 |
| 法人税、住民税及び事業税 |          |                                        | 11,239 |                                        | 10,474 |
| 法人税等調整額      |          |                                        | 290    |                                        | 171    |
| 当期純利益        |          |                                        | 26,276 |                                        | 24,904 |

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2020年4月 1 日 至 2021年3月31日)

(単位：百万円)

| 株主資本 |       |          |         |       |          |      |        |         |
|------|-------|----------|---------|-------|----------|------|--------|---------|
| 資本金  | 資本剰余金 |          |         | 利益剰余金 |          |      | 株主資本合計 |         |
|      | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 |      |        | 利益剰余金合計 |
|      |       |          |         |       | 別途積立金    | 繰越利益 |        |         |

|                     |        |        |       |        |     |        | 剰余金    |        |        |
|---------------------|--------|--------|-------|--------|-----|--------|--------|--------|--------|
| 当期首残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 29,069 | 54,360 | 85,270 |
| 当期変動額               |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
| 剰余金の配当              |        |        |       |        |     |        | 23,950 | 23,950 | 23,950 |
| 当期純利益               |        |        |       |        |     |        | 26,276 | 26,276 | 26,276 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
| 当期変動額合計             | -      | -      | -     | -      | -   | -      | 2,326  | 2,326  | 2,326  |
| 当期末残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 31,395 | 56,686 | 87,596 |

(単位：百万円)

|                     | 評価・換算差額等     |            | 純資産合計  |
|---------------------|--------------|------------|--------|
|                     | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 |        |
| 当期首残高               | 10           | 10         | 85,281 |
| 当期変動額               |              |            |        |
| 剰余金の配当              |              |            | 23,950 |
| 当期純利益               |              |            | 26,276 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 46           | 46         | 46     |
| 当期変動額合計             | 46           | 46         | 2,372  |
| 当期末残高               | 57           | 57         | 87,654 |

当事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：百万円)

|        | 株主資本   |            |                   |                   |            |            |                   |                   |                   |
|--------|--------|------------|-------------------|-------------------|------------|------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|        | 資本金    | 資本剰余金      |                   |                   | 利益剰余金      |            |                   |                   | 株 主<br>資 本<br>合 計 |
|        |        | 資 本<br>準備金 | その他<br>資 本<br>剰余金 | 資 本<br>剰余金<br>合 計 | 利 益<br>準備金 | その他利益剰余金   |                   | 利 益<br>剰余金<br>合 計 |                   |
|        |        |            |                   |                   |            | 別 途<br>積立金 | 繰 越<br>利 益<br>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<br>項目の当期<br>変動額（純<br>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<br>評価差額金 | 評価・換算<br>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<br>の当期変動額（純<br>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           | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券<br/>時価のあるもの … 決算期末日の市場価格等に基づく時価法<br/>(評価差額は全部純資産直入法により処理し、<br/>売却原価は移動平均法により算定しております。)<br/>時価のないもの … 移動平均法による原価法</p>                                                                                                   |    |    |      |       |      |       |
| 2．金銭の信託の評価基準及び評価方法          | 時価法                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |    |      |       |      |       |
| 3．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<br>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              | <p>(1) 有形固定資産<br/>定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。</p> <p>主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table> <tr> <td>建物</td><td>6年</td></tr> <tr> <td>附属設備</td><td>6～15年</td></tr> <tr> <td>器具備品</td><td>4～15年</td></tr> </table> | 建物 | 6年 | 附属設備 | 6～15年 | 器具備品 | 4～15年 |
| 建物                          | 6年                                                                                                                                                                                                                                                                           |    |    |      |       |      |       |
| 附属設備                        | 6～15年                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |    |      |       |      |       |
| 器具備品                        | 4～15年                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |    |      |       |      |       |

|                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>6．引当金の計上基準</p>    | <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産<br/> 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(５年)に基づく定額法によっております。</p> <p>(1) 貸倒引当金<br/> 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金<br/> 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金<br/> 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。<br/> 退職給付見込額の期間帰属方法<br/> 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。<br/> 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法<br/> 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。<br/> 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金<br/> 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> |
| <p>7．収益及び費用の計上基準</p> | <p>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。</p> <p>委託者報酬<br/> 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。</p> <p>運用受託報酬<br/> 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。</p> <p>成功報酬<br/> 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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <p>8．消費税等の会計処理方法</p> | <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 9. 連結納税制度の適用 | <p>連結納税制度を適用しております。</p> <p>なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p> |
|--------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## [ 会計上の見積りに関する注記]

該当事項はありません。

## [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<br>(2021年3月31日)                                                                 | 当事業年度末<br>(2022年3月31日)                                                                 |
|----------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>１．関係会社に対する資産及び負債<br/>区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <p>未払費用 1,256百万円</p> | <p>１．関係会社に対する資産及び負債<br/>区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <p>未払費用 1,223百万円</p> |
| <p>２．有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <p>建物 346百万円</p> <p>器具備品 643</p> <p>合計 990</p>            | <p>２．有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <p>建物 589百万円</p> <p>器具備品 618</p> <p>合計 1,207</p>          |

### 損益計算書関係

| 前事業年度<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日)                                | 当事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日)                                |
|-----------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------|
| 1. 関係会社に係る注記<br>区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。<br>受取配当金 4,334百万円 | 1. 関係会社に係る注記<br>区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。<br>受取配当金 3,525百万円 |
| 2. 固定資産除却損<br>建物 -百万円<br>器具備品 2<br>ソフトウェア 102<br>合計 105               | 2. 固定資産除却損<br>建物 346百万円<br>器具備品 28<br>ソフトウェア -<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>10年以内 | 10年超 |
|--------------|--------|-------------|--------------|------|
| 預金           | 4,281  | -           | -            | -    |
| 金銭の信託        | 35,912 | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬      | 24,499 | -           | -            | -    |
| 未収運用受託報酬     | 4,347  | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券 |        |             |              |      |
| その他有価証券      | 30,400 | -           | -            | -    |
| 合計           | 99,441 | -           | -            | -    |

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<br>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<br>5年以内 | 5年超<br>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<br>(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<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|-------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの<br>株式     | -                     | -             | -           |
| 小計                            | -                     | -             | -           |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの<br>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<br>(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<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|----------------------|-----------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの  |                       |               |             |
| 株式                   | -                     | -             | -           |
| 小計                   | -                     | -             | -           |
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの |                       |               |             |
| 譲渡性預金                | 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<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち一年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|-----------|---------------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>売建<br>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<br>(2021年3月31日) | 当事業年度末<br>(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                                        | 31.0% | 法定実効税率                                        | 31.0% |
| (調整)                                          |       | (調整)                                          |       |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目                            | 0.0%  | 交際費等永久に損金に算入されない項目                            | 0.0%  |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                          | 3.5%  | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                          | 2.9%  |
| タックスヘイブン税制                                    | 1.9%  | タックスヘイブン税制                                    | 1.8%  |
| 外国税額控除                                        | 0.5%  | 外国税額控除                                        | 0.5%  |
| 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税                          | 0.2%  | 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税                          | 0.4%  |
| その他                                           | 0.3%  | その他                                           | 0.1%  |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率                             | 29.4% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率                             | 29.9% |

## 資産除去債務関係

### 資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

#### 1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

#### 2．当該資産除去債務の金額の算定方法

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

#### 3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：百万円）

|                | 前事業年度                        | 当事業年度                        |
|----------------|------------------------------|------------------------------|
|                | 自 2020年4月 1日<br>至 2021年3月31日 | 自 2021年4月 1日<br>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<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額<br>(百万円) | 科目 | 期末残高<br>(百万円) |
|----|--------|-----|-----|-------|--------------------|-----------|-------|---------------|----|---------------|
|----|--------|-----|-----|-------|--------------------|-----------|-------|---------------|----|---------------|

|         |          |        |                 |     |   |                                                 |                       |        |          |       |
|---------|----------|--------|-----------------|-----|---|-------------------------------------------------|-----------------------|--------|----------|-------|
| 親会社の子会社 | 野村證券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000<br>(百万円) | 証券業 | - | 当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等<br>役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1） | 26,722 | 未払手数料    | 5,690 |
|         |          |        |                 |     |   |                                                 | コマーシャル・ペーパーの償還（*2）    | 20,000 | 有価証券     | -     |
|         |          |        |                 |     |   |                                                 | 有価証券受取利息              | 0      | その他営業外収益 | 0     |

## （エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

（\*1） 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

（\*2） コマーシャル・ペーパーの購入については、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<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容    | 取引金額<br>(百万円) | 科目    | 期末残高<br>(百万円) |
|-----|----------------------|------|----------------|-------|--------------------|-----------|----------|---------------|-------|---------------|
| 子会社 | ノムラ・エー・エム・ファイナンス・インク | ケイマン | 2,500<br>(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<br>(被所有)割合 | 関連当事者との関係                                       | 取引の内容                 | 取引金額<br>(百万円) | 科目    | 期末残高<br>(百万円) |
|---------|----------|--------|-----------------|-------|--------------------|-------------------------------------------------|-----------------------|---------------|-------|---------------|
| 親会社の子会社 | 野村證券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000<br>(百万円) | 証券業   | -                  | 当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等<br>役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払（*1） | 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<br>(自 2020年4月1日<br>至 2021年3月31日)        |            | 当事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>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 |

## 中間財務諸表

## 中間貸借対照表

|          |          | 2022年9月30日現在 |
|----------|----------|--------------|
| 区分       | 注記<br>番号 | 金額(百万円)      |
| (資産の部)   |          |              |
| 流動資産     |          |              |
| 現金・預金    |          | 1,959        |
| 金銭の信託    |          | 40,970       |
| 有価証券     |          | 8,000        |
| 未収委託者報酬  |          | 27,052       |
| 未収運用受託報酬 |          | 4,915        |
| 短期貸付金    |          | 1,448        |
| その他      |          | 923          |
| 貸倒引当金    |          | 16           |
| 流動資産計    |          | 85,253       |
| 固定資産     |          |              |
| 有形固定資産   | 1        | 1,534        |
| 無形固定資産   |          | 5,483        |
| ソフトウェア   |          | 5,482        |
| その他      |          | 0            |
| 投資その他の資産 |          | 15,974       |
| 投資有価証券   |          | 2,133        |
| 関係会社株式   |          | 10,025       |
| 長期差入保証金  |          | 519          |
| 前払年金費用   |          | 1,433        |
| 繰延税金資産   |          | 1,758        |
| その他      |          | 104          |
| 固定資産計    |          | 22,993       |
| 資産合計     |          | 108,246      |

|           |          | 2022年9月30日現在 |
|-----------|----------|--------------|
| 区分        | 注記<br>番号 | 金額(百万円)      |
| (負債の部)    |          |              |
| 流動負債      |          |              |
| 未払金       |          | 12,363       |
| 未払収益分配金   |          | 0            |
| 未払償還金     |          | 11           |
| 未払手数料     |          | 8,301        |
| 関係会社未払金   |          | 3,205        |
| その他未払金    | 2        | 842          |
| 未払費用      |          | 9,504        |
| 未払法人税等    |          | 1,213        |
| 賞与引当金     |          | 2,096        |
| その他       |          | 226          |
| 流動負債計     |          | 25,405       |
| 固定負債      |          |              |
| 退職給付引当金   |          | 3,045        |
| 時効後支払損引当金 |          | 595          |
| 資産除去債務    |          | 1,123        |
| 固定負債計     |          | 4,763        |
| 負債合計      |          | 30,169       |
| (純資産の部)   |          |              |
| 株主資本      |          | 77,770       |
| 資本金       |          | 17,180       |
| 資本剰余金     |          | 13,729       |
| 資本準備金     |          | 11,729       |
| その他資本剰余金  |          | 2,000        |
| 利益剰余金     |          | 46,860       |
| 利益準備金     |          | 685          |
| その他利益剰余金  |          | 46,175       |
| 別途積立金     |          | 24,606       |
| 繰越利益剰余金   |          | 21,568       |
| 評価・換算差額等  |          | 307          |

|              |  |         |
|--------------|--|---------|
| その他有価証券評価差額金 |  | 307     |
| 純資産合計        |  | 78,077  |
| 負債・純資産合計     |  | 108,246 |

## 中間損益計算書

|              |          | 自 2022年4月 1日<br>至 2022年9月30日 |
|--------------|----------|------------------------------|
| 区分           | 注記<br>番号 | 金額(百万円)                      |
| 営業収益         |          |                              |
| 委託者報酬        |          | 57,740                       |
| 運用受託報酬       |          | 9,162                        |
| その他営業収益      |          | 181                          |
| 営業収益計        |          | 67,085                       |
| 営業費用         |          |                              |
| 支払手数料        |          | 19,423                       |
| 調査費          |          | 14,540                       |
| その他営業費用      |          | 2,613                        |
| 営業費用計        |          | 36,577                       |
| 一般管理費        | 1        | 14,575                       |
| 営業利益         |          | 15,931                       |
| 営業外収益        | 2        | 7,366                        |
| 営業外費用        | 3        | 1,574                        |
| 経常利益         |          | 21,723                       |
| 特別利益         | 4        | 30                           |
| 特別損失         | 5        | 49                           |
| 税引前中間純利益     |          | 21,705                       |
| 法人税、住民税及び事業税 |          | 4,322                        |
| 法人税等調整額      |          | 966                          |
| 中間純利益        |          | 16,415                       |

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

(単位：百万円)

|  | 株主資本  |  |  |          |  |     |
|--|-------|--|--|----------|--|-----|
|  | 資本剰余金 |  |  | 利益剰余金    |  | 株 主 |
|  |       |  |  | その他利益剰余金 |  |     |

|                       | 資本金    | 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 | 別途積立金  | 繰越利益剰余金 | 利益剰余金合計 | 資本合計   |
|-----------------------|--------|--------|----------|---------|-------|--------|---------|---------|--------|
| 当期首残高                 | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606 | 30,030  | 55,322  | 86,232 |
| 当中間期変動額               |        |        |          |         |       |        |         |         |        |
| 剰余金の配当                |        |        |          |         |       |        | 24,877  | 24,877  | 24,877 |
| 中間純利益                 |        |        |          |         |       |        | 16,415  | 16,415  | 16,415 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） |        |        |          |         |       |        |         |         |        |
| 当中間期変動額合計             | -      | -      | -        | -       | -     | -      | 8,461   | 8,461   | 8,461  |
| 当中間期末残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606 | 21,568  | 46,860  | 77,770 |

（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                 | 174          | 174        | 86,407 |
| 当中間期変動額               |              |            |        |
| 剰余金の配当                |              |            | 24,877 |
| 中間純利益                 |              |            | 16,415 |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額） | 132          | 132        | 132    |
| 当中間期変動額合計             | 132          | 132        | 8,329  |
| 当中間期末残高               | 307          | 307        | 78,077 |

## [重要な会計方針]

|                         |                                                                                                                                                                                |
|-------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1．有価証券の評価基準及び評価方法       | <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 … 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券<br/>市場価格のない … 時価法<br/>株式等以外のもの<br/>(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。)</p> <p>市場価格のない … 移動平均法による原価法<br/>株式等</p> |
| 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、中間会計期間末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

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、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、支払見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。

## (3) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。

退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。

## (4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 7．収益及び費用の計上基準 | <p>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。</p> <p><b>委託者報酬</b></p> <p>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。</p> <p><b>運用受託報酬</b></p> <p>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。</p> <p><b>成功報酬</b></p> <p>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。</p> |
| 8．消費税等の会計処理方法 | <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

#### [会計方針の変更]

（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の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準適用指針が定める新たな会計方針を将来にわたって適用することとしております。

これによる中間財務諸表に与える影響はありません。

#### [追加情報]

当社は、当中間会計期間から、連結納税制度からグループ通算制度へ移行しております。これに伴い、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については、「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。以下「実務対応報告第42号」という。）に従っております。

また、実務対応報告第42号第32項（１）に基づき、実務対応報告第42号の適用に伴う会計方針の変更による影響はないものとみなしております。

#### [注記事項]

##### 中間貸借対照表関係

| 2022年9月30日現在     |          |
|------------------|----------|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額 | 1,577百万円 |



|                  |        |        |   |
|------------------|--------|--------|---|
| 資産計              | 40,970 | 40,970 | - |
| (2)その他（デリバティブ取引） | 74     | 74     | - |
| 負債計              | 74     | 74     | - |

（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。当該金融商品の中間貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

|               | 中間貸借対照表計上額<br>(百万円) |
|---------------|---------------------|
| 市場価格のない株式等（ ） | 10,260              |
| 組合出資金等        | 1,898               |
| 合計            | 12,159              |

（ ）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．金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：同一の資産又は負債の活発な市場における（無調整の）相場価格により算定した時価

レベル2の時価：レベル1のインプット以外の直接または間接的に観察可能なインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

### （１）時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

| 区分              | 中間貸借対照表計上額（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） | -                  | 40,970 | -    | 40,970 |
| 資産計             | -                  | 40,970 | -    | 40,970 |
| デリバティブ取引（通貨関連）  | -                  | 74     | -    | 74     |
| 負債計             | -                  | 74     | -    | 74     |

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

#### 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。構成物のレベルに基づき、レベル2の時価に分類しております。

#### 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

当中間会計期間末（2022年9月30日）

## １．売買目的有価証券(2022年9月30日)

該当事項はありません。

## ２．満期保有目的の債券(2022年9月30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9月30日)

市場価格のない株式等の中間貸借対照表計上額

| 区分     | 中間貸借対照表<br>計上額（百万円） |
|--------|---------------------|
| 子会社株式  | 9,919               |
| 関連会社株式 | 106                 |

## ４．その他有価証券(2022年9月30日)

| 区分                         | 中間貸借対照表<br>計上額<br>(百万円) | 取得原価<br>(百万円) | 差額<br>(百万円) |
|----------------------------|-------------------------|---------------|-------------|
| 中間貸借対照表計上額が<br>取得原価を超えないもの |                         |               |             |
| 譲渡性預金                      | 8,000                   | 8,000         | -           |
| 小計                         | 8,000                   | 8,000         | -           |
| 合計                         | 8,000                   | 8,000         | -           |

## 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

当中間会計期間（2022年9月30日）

| 区分        | 取引の種類               | 契約額等<br>(百万円) | 契約額等の<br>うち一年超<br>(百万円) | 時価<br>(百万円) | 評価損益<br>(百万円) |
|-----------|---------------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引<br>売建<br>米ドル | 1,371         | -                       | 74          | 74            |

## 資産除去債務関係

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減（単位：百万円）

|                |                              |
|----------------|------------------------------|
|                | 自 2022年4月 1日<br>至 2022年9月30日 |
| 期首残高           | 1,123                        |
| 有形固定資産の取得に伴う増加 | -                            |
| 時の経過による調整額     | -                            |
| 中間期末残高         | 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

| 区分      | 当中間会計期間<br>(自 2022年4月 1日<br>至 2022年9月30日 ) |
|---------|--------------------------------------------|
| 委託者報酬   | 57,740百万円                                  |
| 運用受託報酬  | 8,912百万円                                   |
| 成功報酬（注） | 250百万円                                     |
| その他営業収益 | 181百万円                                     |
| 合計      | 67,085百万円                                  |

（注）成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬または運用受託報酬に含めて表示しております。

## ２．顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

[重要な会計方針] 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中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため、記載を省略しております。

## セグメント情報等

当中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

## １．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## ２．関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 1 株当たり情報

|  |                              |
|--|------------------------------|
|  | 自 2022年4月 1日<br>至 2022年9月30日 |
|--|------------------------------|

|           |            |
|-----------|------------|
| 1株当たり純資産額 | 15,158円67銭 |
|-----------|------------|

|            |           |
|------------|-----------|
| 1株当たり中間純利益 | 3,187円11銭 |
|------------|-----------|

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益につきましては、潜在株式がないため、記載しておりません。

2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

|              |           |
|--------------|-----------|
| 中間純利益        | 16,415百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額 | -         |
| 普通株式に係る中間純利益 | 16,415百万円 |
| 期中平均株式数      | 5,150千株   |

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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。)。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。 )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 <sup>*</sup> | (c)事業の内容                                                   |
|------------|-----------------------|------------------------------------------------------------|
| 野村信託銀行株式会社 | 35,000百万円             | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。 |

\* 2023年2月末現在

## (2) 販売会社

| (a)名称          | (b)資本金の額 <sup>*</sup> | (c)事業の内容                        |
|----------------|-----------------------|---------------------------------|
| 野村證券株式会社       | 10,000百万円             | 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。 |
| 損保ジャパンDＣ証券株式会社 | 3,000百万円              |                                 |
| 株式会社足利銀行       | 135,000百万円            | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。              |
| 株式会社山陰合同銀行     | 20,705百万円             |                                 |
| 株式会社三井住友銀行     | 1,770,996百万円          |                                 |
| 株式会社武蔵野銀行      | 45,743百万円             |                                 |
| 住友生命保険相互会社     | 639,000百万円            | 保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。           |

\* 2023年2月末現在

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には「基金」および「基金償却積立金」の合計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】

(2022年9月末現在の持株比率5.0%以上を記載します。)

## (1) 受託者

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

| 提出年月日       | 提出書類          |
|-------------|---------------|
| 2022年 5月12日 | 有価証券届出書       |
| 2022年 5月12日 | 有価証券報告書       |
| 2022年11月16日 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 2022年11月16日 | 半期報告書         |

## 独立監査人の監査報告書

2022年6月7日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の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

2023年4月25日

野村アセットマネジメント株式会社

取締役会 御 中

## EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

湯 原 尚

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村DC運用戦略ファンド（マイルド）の2022年2月18日から2023年2月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村DC運用戦略ファンド（マイルド）の2023年2月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2022年11月24日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

湯 原 尚

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士

水 永 真太郎

### 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2022年4月1日から2023年3月31日までの第64期事業年度の中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2022年4月1日から2022年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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

### 中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財

務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

## 利害関係

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

以 上

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