

## 【表紙】

|                                          |                                                                                                                                                                            |
|------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 【提出書類】                                   | 有価証券届出書                                                                                                                                                                    |
| 【提出先】                                    | 関東財務局長殿                                                                                                                                                                    |
| 【提出日】                                    | 2024年5月17日提出                                                                                                                                                               |
| 【発行者名】                                   | 野村アセットマネジメント株式会社                                                                                                                                                           |
| 【代表者の役職氏名】                               | C E O兼代表取締役社長 小池 広靖                                                                                                                                                        |
| 【本店の所在の場所】                               | 東京都江東区豊洲二丁目2番1号                                                                                                                                                            |
| 【事務連絡者氏名】                                | 松井 秀仁                                                                                                                                                                      |
| 【電話番号】                                   | 03-6387-5000                                                                                                                                                               |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券に係るファンドの名称】 | のむラップ・ファンド（保守型）<br>のむラップ・ファンド（やや保守型）<br>のむラップ・ファンド（普通型）<br>のむラップ・ファンド（やや積極型）<br>のむラップ・ファンド（積極型）                                                                            |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資<br>信託受益証券の金額】        | のむラップ・ファンド（保守型）<br>2兆円を上限とします。<br>のむラップ・ファンド（やや保守型）<br>2兆円を上限とします。<br>のむラップ・ファンド（普通型）<br>2兆円を上限とします。<br>のむラップ・ファンド（やや積極型）<br>2兆円を上限とします。<br>のむラップ・ファンド（積極型）<br>2兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】                               | 該当事項はありません。                                                                                                                                                                |

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

のむラップ・ファンド（保守型）

のむラップ・ファンド（やや保守型）

のむラップ・ファンド（普通型）

のむラップ・ファンド（やや積極型）

のむラップ・ファンド（積極型）

（以上を総称して「のむラップ・ファンド」または「各ファンド」という場合、あるいは個別に「ファンド」という場合があります。また、各々、「のむラップ・ファンド（保守型）」を「保守型」、「のむラップ・ファンド（やや保守型）」を「やや保守型」、「のむラップ・ファンド（普通型）」を「普通型」、「のむラップ・ファンド（やや積極型）」を「やや積極型」、「のむラップ・ファンド（積極型）」を「積極型」という場合があります。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

なお、当初元本は1口当たり1円です。

#### ■信用格付■

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき2兆円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額<sup>※</sup>とします。

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

#### （５）【申込手数料】

- ①各ファンドにつき、取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（税抜1.0%）以内<sup>※</sup>で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

- ②収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

#### （６）【申込単位】

|                                |                                       |
|--------------------------------|---------------------------------------|
| 一般コース<br>(分配金を受取るコース)          | 1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または<br>1万円以上1円単位 |
| 自動けいぞく投資コース<br>(分配金が再投資されるコース) | 1万円以上1円単位                             |

ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した投資者が収益分配金を再投資する場合には1口単位とします。

#### （７）【申込期間】

2024年5月18日から2025年5月16日まで

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

#### （８）【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時

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

#### （９）【払込期日】

取得申込日から起算して5営業日目までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。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。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、野村アセットマネジメント株式会社(「委託者」または「委託会社」といいます。 )の指定する口座を經由して、野村信託銀行株式会社(「受託者」または「受託会社」といいます。 )の指定するファンド口座に払い込まれます。

#### （１０）【払込取扱場所】

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

でお問い合わせ下さい。

**野村アセットマネジメント株式会社**

**サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）**

**＜受付時間＞ 営業日の午前9時～午後5時**

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

**（１１）【振替機関に関する事項】**

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

**株式会社証券保管振替機構**

**（１２）【その他】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- ◆「のむラップ・ファンド」は、リスク水準が異なるスイッチング可能なファンドで構成されています。
- ◆国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象<sup>※1</sup>とし、以下の投資方針に基づき分散投資を行ないます。

|                     |                                           |
|---------------------|-------------------------------------------|
| 保守型 <sup>※2</sup>   | 安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を図ることを目的として運用を行ないます。  |
| やや保守型 <sup>※2</sup> | 安定した収益の確保と信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。     |
| 普通型 <sup>※2</sup>   | 信託財産の成長と安定した収益の確保を図ることを目的として運用を行ないます。     |
| やや積極型 <sup>※2</sup> | 信託財産の成長と安定した収益の確保を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。 |
| 積極型 <sup>※2</sup>   | 信託財産の成長を図ることを目的として積極的な運用を行ないます。           |

- ◆各資産への分散投資を行なうにあたっては、ファンドの投資助言会社である野村證券株式会社<sup>※3</sup>が、独自に開発したモデルを用い最適化した結果を踏まえ、各ファンドごとに投資配分比率を決定します。

- ※1 各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「世界REITインデックス マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。
- ※2 「保守型」、「やや保守型」、「普通型」、「やや積極型」、「積極型」の名称は、各ファンド間の相対的なリスク量を表すものです。また、いずれの名称も、元本を確保することを意味するものではありません。
- ※3 野村證券株式会社は金融商品取引法に基づき、投資運用業および投資助言・代理業の登録を行なっています。

#### ■信託金の限度額■

受益権の信託金限度額は、各ファンドにつき1兆円です。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。

（のむラップ・ファンド（保守型））

（のむラップ・ファンド（やや保守型））

(のむラップ・ファンド（普通型）)

(のむラップ・ファンド（やや積極型）)

(のむラップ・ファンド（積極型）)

## 《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               |
|         |        | 債 券               |
|         | 海 外    | 不動産投信             |
| 追加型     | 内 外    | 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) |              |           |
|                                                             | 年2回          | 日本               |              |           |
|                                                             | 年4回          | 北米               | ファミリーファンド    | あり<br>( ) |
| 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6回<br>(隔月)  | 欧州               |              |           |
|                                                             | 年12回<br>(毎月) | アジア              |              |           |
|                                                             | 日々           | オセアニア            |              |           |
| 不動産投信                                                       | その他<br>( )   | 中南米              | ファンド・オブ・ファンズ | なし        |
| 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)) |              | 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                           |              |                  |              |           |

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

◆一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（2023年1月19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)…MRF及びMMFの運営に関する規則（以下「MRF等規則」という。）に定めるMMFをいう。
- (2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)…MRF等規則に定める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。

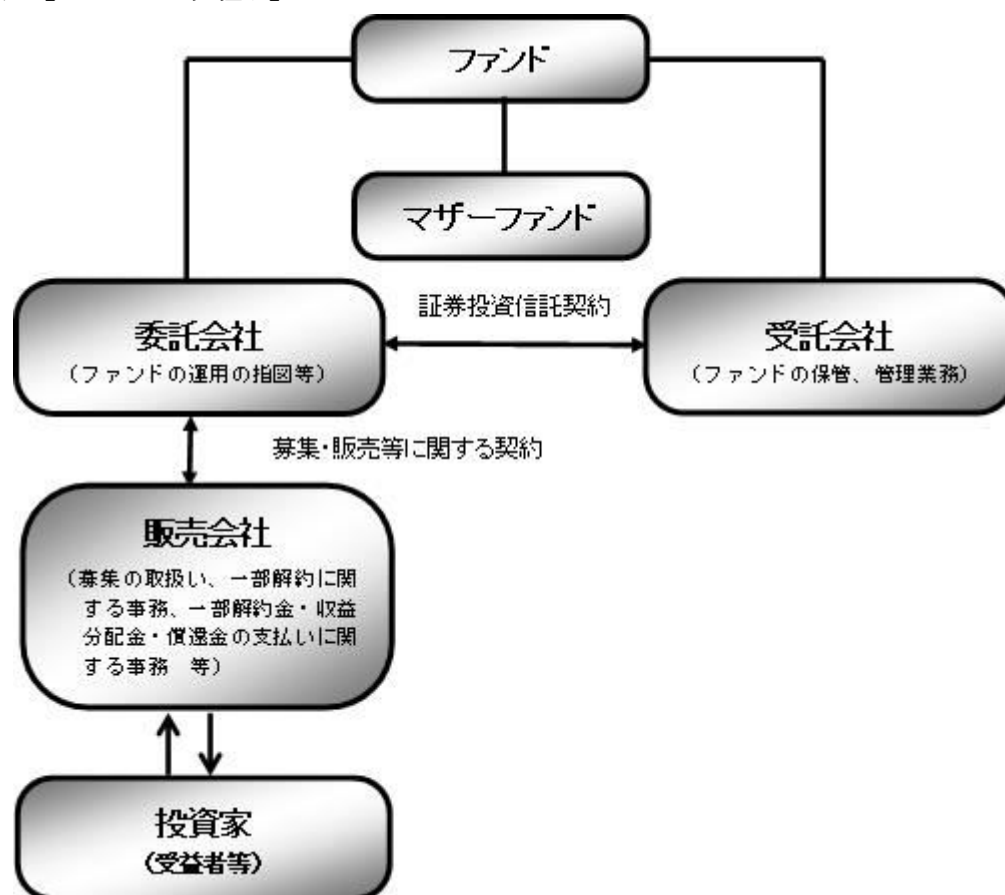
- (2)条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型／絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組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】

2010年3月15日 「保守型」「普通型」「積極型」につき信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

2016年11月11日 「やや保守型」「やや積極型」につき信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



|                    |                                                                                                                        |
|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p><b>ファンド</b></p> | <p>のむラップ・ファンド（保守型）</p> <p>のむラップ・ファンド（やや保守型）</p> <p>のむラップ・ファンド（普通型）</p> <p>のむラップ・ファンド（やや積極型）</p> <p>のむラップ・ファンド（積極型）</p> |
|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                            |                                                                                                           |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>マザーファンド<br/>(親投資信託)</b> | 国内株式マザーファンド<br>国内債券NOMURA-BPI総合 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>世界REITインデックス マザーファンド |
| <b>委託会社(委託者)</b>           | 野村アセットマネジメント株式会社                                                                                          |
| <b>受託会社(受託者)</b>           | 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(2024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] マザーファンドへの投資を通じて、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）に分散投資を行ないます。

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

|                                        |                                                                                                               |
|----------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ＜国内株式＞<br>国内株式マザーファンド                  | ○主要投資対象<br>わが国の株式<br>○対象指数<br>東証株価指数（TOPIX）（配当込み）                                                             |
| ＜国内債券＞<br>国内債券NOMURA-BPI総合<br>マザーファンド  | ○主要投資対象<br>わが国の公社債<br>○対象指数<br>NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）                                      |
| ＜外国株式＞<br>外国株式MSCI-KOKUSAI<br>マザーファンド  | ○主要投資対象<br>外国の株式<br>○対象指数<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）＊<br>＊ MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。            |
| ＜外国債券＞<br>外国債券マザーファンド                  | ○主要投資対象<br>外国の公社債<br>○対象指数<br>FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）                                                 |
| ＜世界各国のREIT＞<br>世界REITインデックス<br>マザーファンド | ○主要投資対象<br>世界各国のREIT<br>○対象指数<br>S&P先進国REIT指数（配当込み、円換算ベース）＊<br>＊ S&P先進国REIT指数（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。 |

- [2] 各マザーファンドへの投資配分比率は、ファンドの投資助言会社である野村證券株式会社、独自に開発したモデルを用い、各資産の期待リターンや推定リスク、各資産間の相関係数等をもとに最適化した結果を踏まえ決定します。

◆一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

- [3] 各ファンドにおける、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「世界REITインデックス マザーファンド」の各受益証券への投資比率の合計は、信託財産の純資産総額に対して以下のとおりとします。

| 保守型     | やや保守型   | 普通型     | やや積極型   | 積極型  |
|---------|---------|---------|---------|------|
| 原則50%以内 | 原則60%以内 | 原則75%以内 | 原則85%以内 | 制限なし |

◆各ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は、上記制限のもと、下記を上限の目処とします。

|                         | 保守型 | やや保守型 | 普通型 | やや積極型 | 積極型 |
|-------------------------|-----|-------|-----|-------|-----|
| 国内株式マザーファンド             | 20% | 25%   | 30% | 35%   | 40% |
| 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 80% | 70%   | 60% | 50%   | 40% |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 30% | 35%   | 45% | 50%   | 60% |
| 外国債券マザーファンド             | 50% | 50%   | 50% | 50%   | 50% |
| 世界REITインデックスマザーファンド     | 20% | 25%   | 30% | 35%   | 40% |

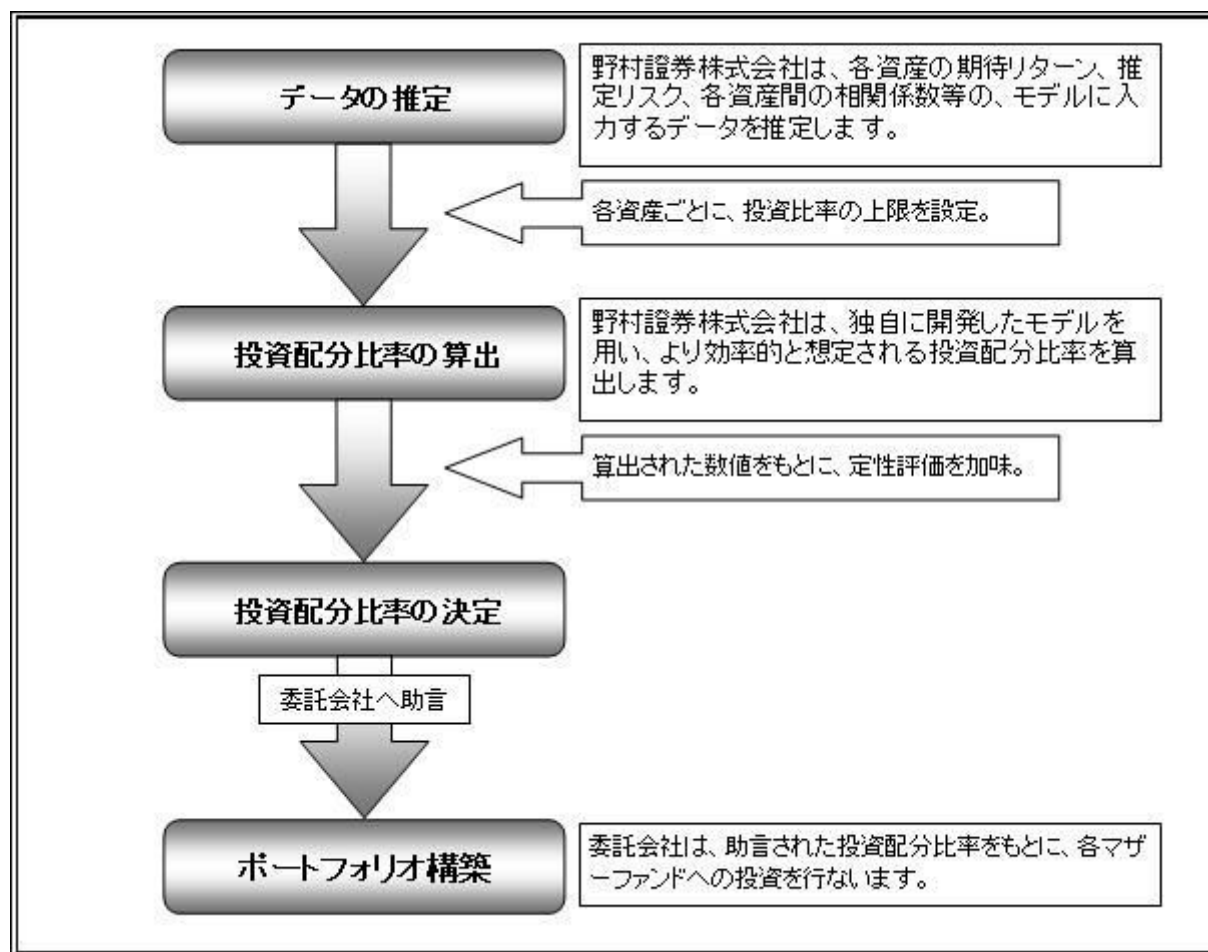
※上記の各マザーファンドへの投資比率の上限の目処は、今後変更される場合があります。また、一時的に上限の目処を超える場合があります。

- [4] 投資配分比率の見直しを定期的に行なうことを基本とします。

◆市況見通しの変化等によっては、適宜リバランスや投資配分比率の見直しを行なう場合があります。

[5] 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

## ■ポートフォリオ構築プロセス■



＊上記のポートフォリオ構築プロセスは、今後変更となる場合があります。

## ■各マザーファンドが対象とする指数等の著作権等について■

**「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」**

- ①配当込みTOPIXの指数値及び配当込みTOPIX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、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有する。
- ②J P Xは、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、配当込みTOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又は配当込みTOPIXに係る標章若しくは商標の変更若しくは使用の停止を行うことができる。
- ③J P Xは、配当込みTOPIXの指数値及び配当込みTOPIX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配当込みTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④J P Xは、配当込みTOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではない。また、J P Xは、配当込みTOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。
- ⑤本件商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではない。
- ⑥J P Xは、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ⑦J P Xは、当社又は本件商品の購入者のニーズを配当込みTOPIXの指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
- ⑧以上の項目に限らず、J P Xは本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

**「NOMURA-BPI総合」**

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

**「MSCI-KOKUSAI指数」**

MSCI-KOKUSAI指数の著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

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

#### 「S&P先進国REIT指数」

本ファンドは、スタンダード・アンド・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は一切負いません。

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ことを問わず、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】

国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）※を実質的な主要投資対象とします。

◆各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「世界REITインデックス マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、外国株式、外国債券、世界各国（日本を含む）の不動産投資信託証券（REIT）に投資を行います。

※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。

## ＜各ファンドに共通＞

### ①投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限るものとします。）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. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ハ. 金銭債権（イ及びロ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

### ②有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託者は、信託金を、主として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の受益証券、国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンドの受益証券、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドの受益証券、外国債券マザーファンドの受益証券、世界REITインデックスマザーファンドの受益証券のほか、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くものとし、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
4. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債にかかる運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行なうことができるものとします。

### ③金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記②に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

## (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）（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います。

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

- ① 主としてわが国の株式に投資することにより、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指します。
- ② 非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。
- ③ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。



### (3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は行ないません。
- ③ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ④ 有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。
- ⑤ スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑦ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

## （国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド）

### 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

##### (3) 投資制限

- ① 株式への投資は行ないません。
- ② 外貨建資産への投資は行ないません。
- ③ 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。
- ④ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。
- ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率

以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

③ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

④ 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

⑤ スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

⑥ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

⑦ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

⑧ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑨ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債<sup>※</sup>への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

※転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)をいいます。

⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

⑪ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合に

は、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国債券マザーファンド）  
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

（1）投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

（2）投資態度

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

② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

③ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（3）投資制限

① 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

② 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

③ スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（世界REITインデックス マザーファンド）  
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

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。

※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。

### (2) 投資態度

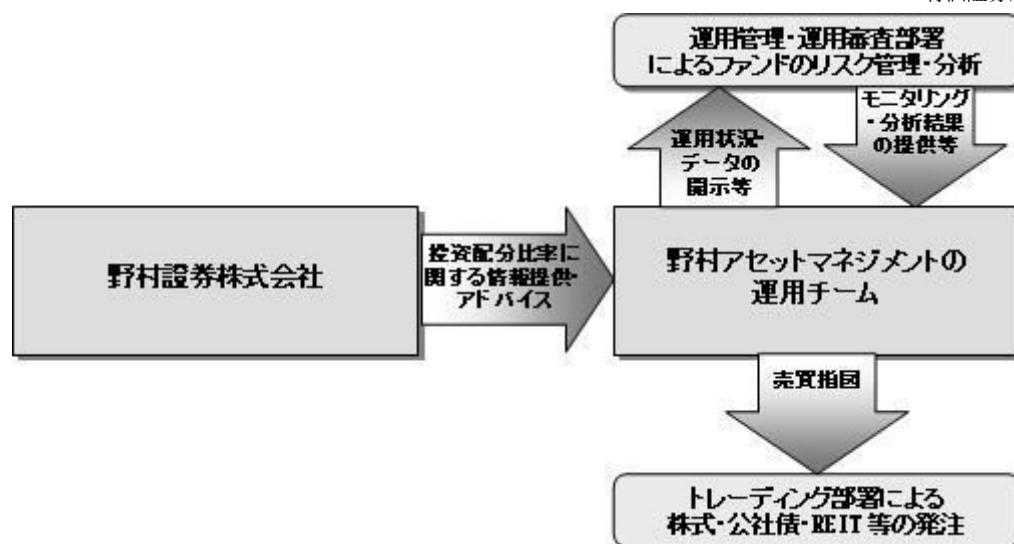
- ① REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
- ② 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ③ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

- ① 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ 株式への直接投資は行いません。
- ④ 不動産投信指数先物取引は約款第15条の2の範囲で行ないます。
- ⑤ 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数（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（配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。
- ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。
- ⑦ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

### (3) 【運用体制】

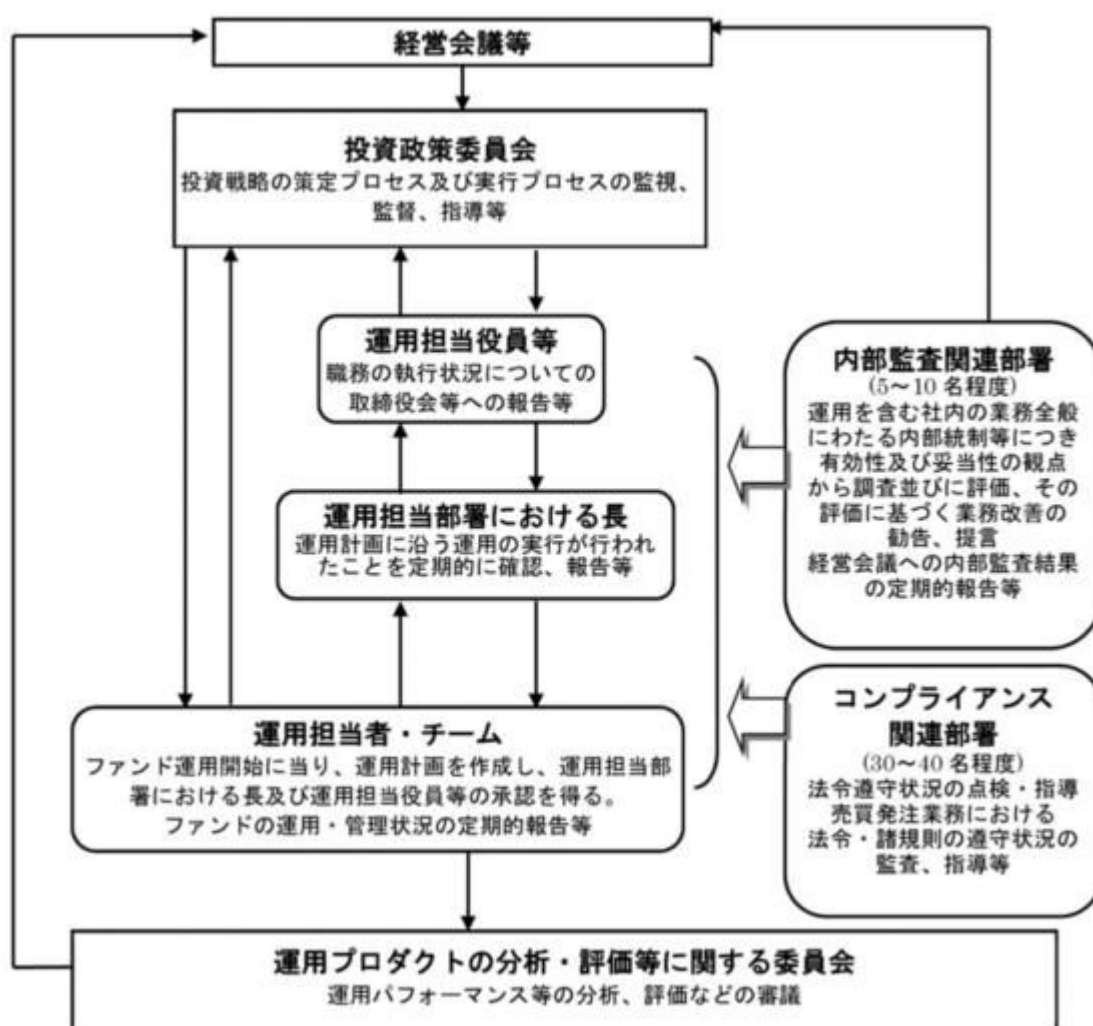
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



《委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等》

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合な

どを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

- ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、上記①の範囲内で、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。
- ③留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行ないます。

※利子・配当等収益とは、利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

※売買益とは、売買損益に評価損益を加減した利益金額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

※毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

※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18日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

#### ◆分配金のお支払い

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

「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、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。

#### （５）【投資制限】

##### <各ファンドに共通>

- ①外貨建資産への投資割合（運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限）

外貨建資産への直接投資は行ないません。

## ②デリバティブの使用(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

デリバティブの直接利用は行ないません。なお、各マザーファンドにおいて対象指数の動きに連動する投資成果を目指すため、有価証券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引を、実質的に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的または為替相場等の変動リスクを減じる目的で、実質的に活用する場合があります。

## ③株式への投資割合(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

株式への直接投資は行ないません。

## ④公社債の借入れ(約款第19条)

(i) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。

なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

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

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

(iv) 上記(i)の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

## ⑤資金の借入れ(約款第25条)

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

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

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

(iv) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

## ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

## 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へ帰属します。

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。

**【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。

**【為替変動リスク】**

ファンドは、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影響を受けます。

※基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

**《その他の留意点》**

- ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。
- ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要がある場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受け付けが中止等となる可能性、換金代金の支払いが遅延する可能性等があります。
- 資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。
- ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが遅延する可能性があります。
- 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ファンドで使用するモデルは、委託会社が信頼できると判断したデータ等の評価に基づき採用しておりますが、今後の運用成果を保証するものではありません。また、今後使用するモデルが変更となる場合があります。
- 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。

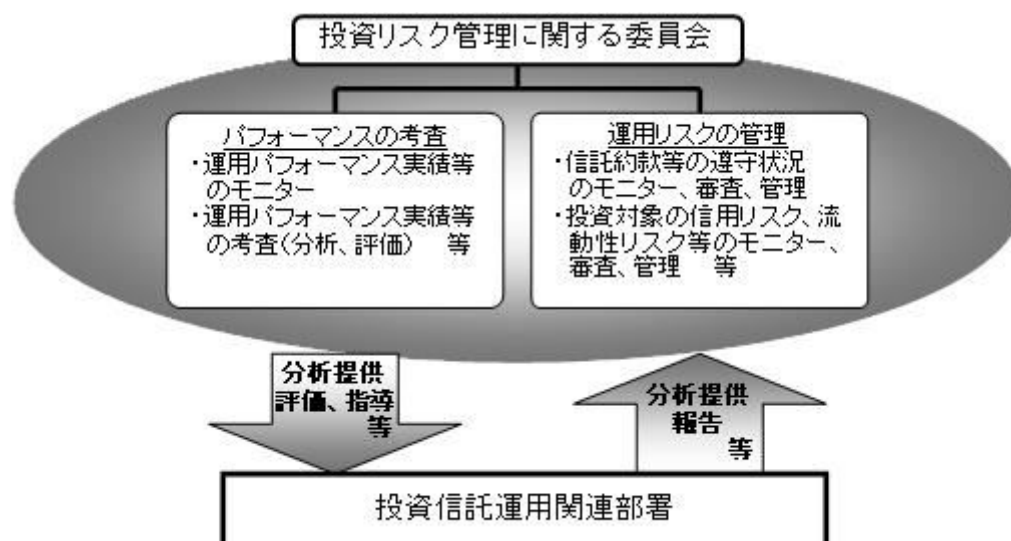
#### ◆運用リスクの管理

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

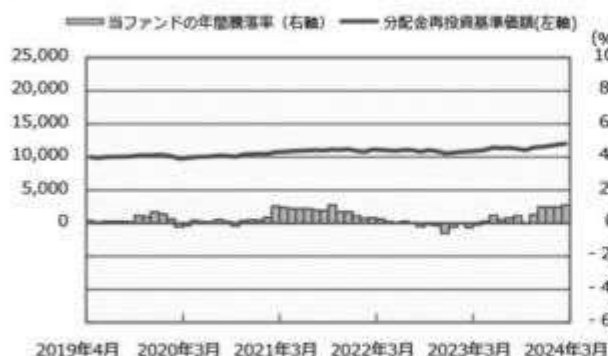


※投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

## ■ リスクの定量的比較 (2019年4月末～2024年3月末：月次)

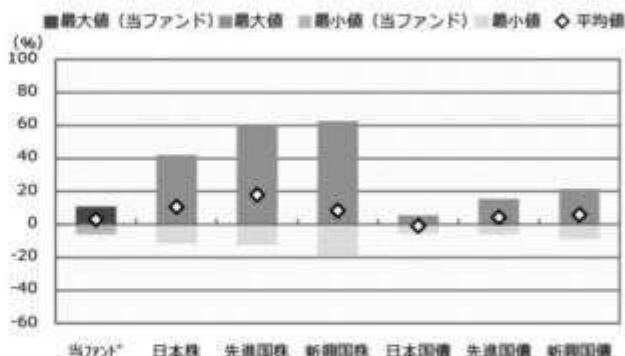
### 保守型

#### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2019年4月 2020年3月 2021年3月 2022年3月 2023年3月 2024年3月

#### ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



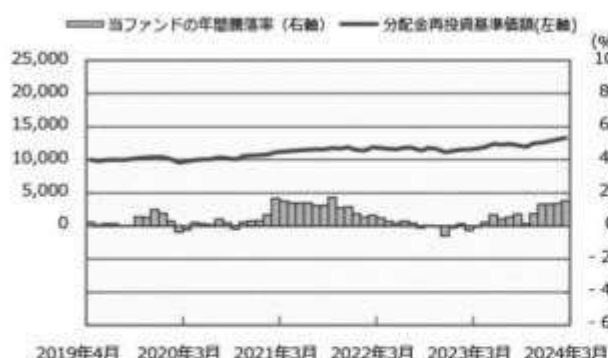
|         | 当ファンド | 日本株    | 先進国株   | 新興国株   | 日本国債  | 先進国債  | 新興国債  |
|---------|-------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 最大値 (%) | 10.9  | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 5.4   | 15.3  | 21.5  |
| 最小値 (%) | △ 6.0 | △ 11.4 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 8.8 |
| 平均値 (%) | 3.1   | 10.7   | 17.9   | 8.4    | △ 0.8 | 4.3   | 5.9   |

- \* 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。2019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、2019年4月から2024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。
- \* 2019年4月から2024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。

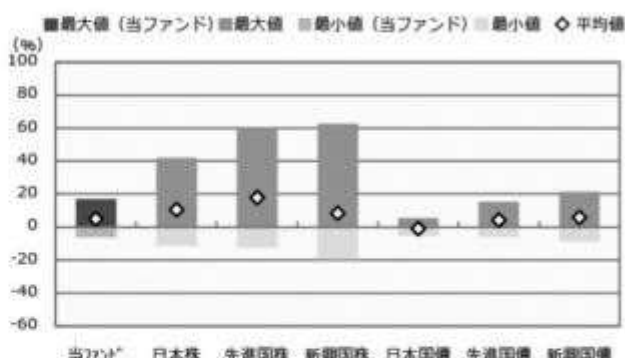
### やや保守型

#### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2019年4月 2020年3月 2021年3月 2022年3月 2023年3月 2024年3月

#### ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



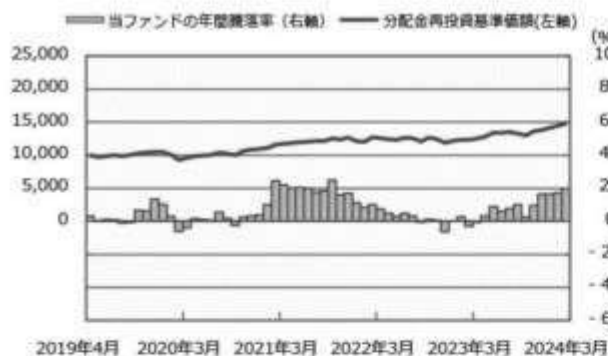
|         | 当ファンド | 日本株    | 先進国株   | 新興国株   | 日本国債  | 先進国債  | 新興国債  |
|---------|-------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 最大値 (%) | 17.1  | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 5.4   | 15.3  | 21.5  |
| 最小値 (%) | △ 6.2 | △ 11.4 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 8.8 |
| 平均値 (%) | 5.0   | 10.7   | 17.9   | 8.4    | △ 0.8 | 4.3   | 5.9   |

- \* 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。2019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、2019年4月から2024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。

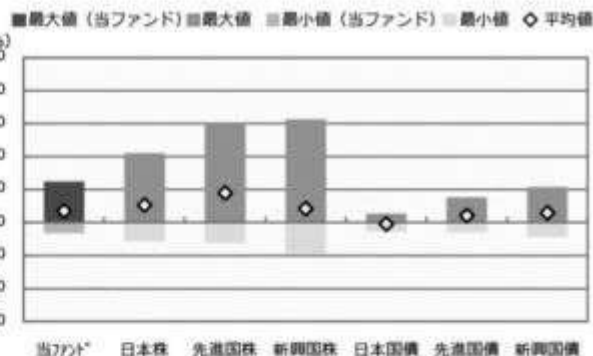
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2019年4月から2024年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 普通型

### ファンドの年間総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総落率の比較



|         | 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 (%) | 24.8  | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 5.4   | 15.3  | 21.5  |
| 最小値 (%) | △ 6.4 | △ 11.4 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 8.8 |
| 平均値 (%) | 7.1   | 10.7   | 17.9   | 8.4    | △ 0.8 | 4.3   | 5.9   |

\* 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。2019年4月末を10,000として指数化しております。

\* 年間総落率は、2019年4月から2024年3月の5年間の各月末における1年間の総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。

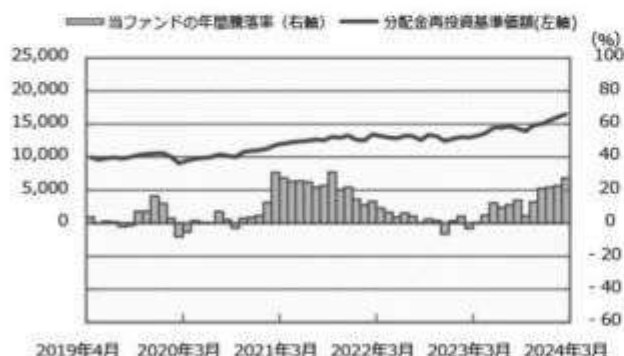
\* 2019年4月から2024年3月の5年間の各月末における1年間の総落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

\* 決算日に対応した数値とは異なります。

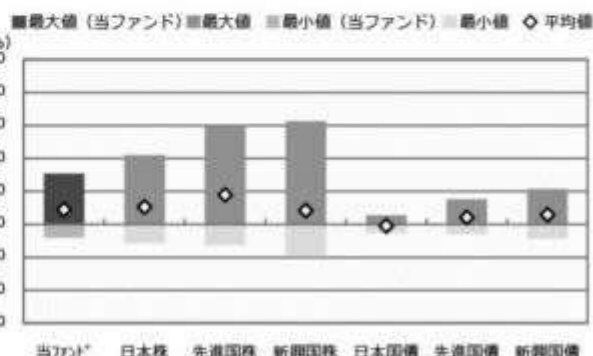
\* 当ファンドは分配金再投資基準価額の総落率です。

## やや積極型

### ファンドの年間総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総落率の比較



|         | 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 (%) | 30.8  | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 5.4   | 15.3  | 21.5  |
| 最小値 (%) | △ 8.1 | △ 11.4 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 8.8 |
| 平均値 (%) | 9.1   | 10.7   | 17.9   | 8.4    | △ 0.8 | 4.3   | 5.9   |

\* 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。2019年4月末を10,000として指数化しております。

\* 年間総落率は、2019年4月から2024年3月の5年間の各月末における1年間の総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。

\* 2019年4月から2024年3月の5年間の各月末における1年間の総落率の最大値・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。

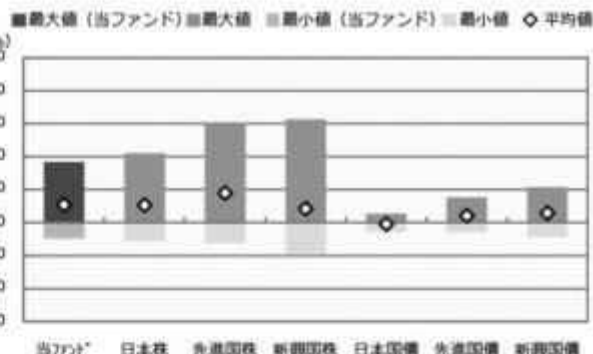
\* 当ファンドは分配金再投資基準価額の総落率です。

## 積極型

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



## ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



|         | 当ファンド | 日本株    | 先進国株   | 新興国株   | 日本国債  | 先進国債  | 新興国債  |
|---------|-------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 最大値 (%) | 36.7  | 42.1   | 59.8   | 62.7   | 5.4   | 15.3  | 21.5  |
| 最小値 (%) | △ 9.7 | △ 11.4 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 8.8 |
| 平均値 (%) | 10.8  | 10.7   | 17.9   | 8.4    | △ 0.8 | 4.3   | 5.9   |

\* 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。2019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、2019年4月から2024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。

\* 2019年4月から2024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。

## &lt;代表的な資産クラスの指数&gt;

- 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・ディバースファイド（円ベース）

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・配当込みTOPIX（「東証株価指数（TOPIX）（配当込み）」といいます。）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」といいます。）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、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村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国債を用いられる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてののみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価値を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイス等を法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメークを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国のJ.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての勧誘、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に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。
- JPMS LLC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】

- ①各ファンドにつき、取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率)(税抜1.0%)以内<sup>\*</sup>で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

さい。

②収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、各ファンドについて、ファンドの計算期間を通じて毎日、当該ファンドの純資産総額に下記の信託報酬率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

| ファンド  | 信託報酬率                   | ＜委託会社＞ | ＜販売会社＞  | ＜受託会社＞ |
|-------|-------------------------|--------|---------|--------|
| 保守型   | 年1.188%<br>(税抜年1.08%)   | 年0.70% | 年0.35%  | 年0.03% |
| やや保守型 | 年1.2705%<br>(税抜年1.155%) | 年0.75% | 年0.375% | 年0.03% |
| 普通型   | 年1.353%<br>(税抜年1.23%)   | 年0.80% | 年0.40%  | 年0.03% |
| やや積極型 | 年1.4355%<br>(税抜年1.305%) | 年0.85% | 年0.425% | 年0.03% |
| 積極型   | 年1.518%<br>(税抜年1.38%)   | 年0.90% | 年0.45%  | 年0.03% |

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。

◆投資助言会社が受ける報酬は、委託会社が受ける報酬から、毎年2月および8月ならびに信託契約終了のとき支払うものとし、その報酬額は、各ファンドの日々の平均純資産総額に、次の率を乗じて得た額とします。

| ファンド  | 率       |
|-------|---------|
| 保守型   | 年0.35%  |
| やや保守型 | 年0.375% |
| 普通型   | 年0.40%  |
| やや積極型 | 年0.425% |
| 積極型   | 年0.45%  |

## 《支払先の役務の内容》

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

#### （４）【その他の手数料等】

- ①ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息はファンドから支払われます。
- ②ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。
- ③ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。
- ④監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときにファンドから支払われます。
- ⑤ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額<sup>※</sup>をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を1口当たりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

#### （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

##### ■個人、法人別の課税について■

##### ◆個人の投資家に対する課税

##### ＜収益分配金に対する課税＞

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

なお、配当控除は適用されません。

##### ＜換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税＞

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

##### 《損益通算について》

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

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

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

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

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合にNISA（少額投資非課税制度）の適用対象となります。保守型、やや保守型、普通型、やや積極型は、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象であり、積極型は、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」及び「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象ですが、販売会社により取扱いが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。

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」は、上場株式、公募株式投資信託等に係る非課税制度です。NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が無期限で非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

#### ◆法人の投資家に対する課税

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

#### ■換金（解約）時および償還時の課税について■

〔個人の投資家の場合〕

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

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

〔法人の投資家の場合〕

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ■個別元本について■

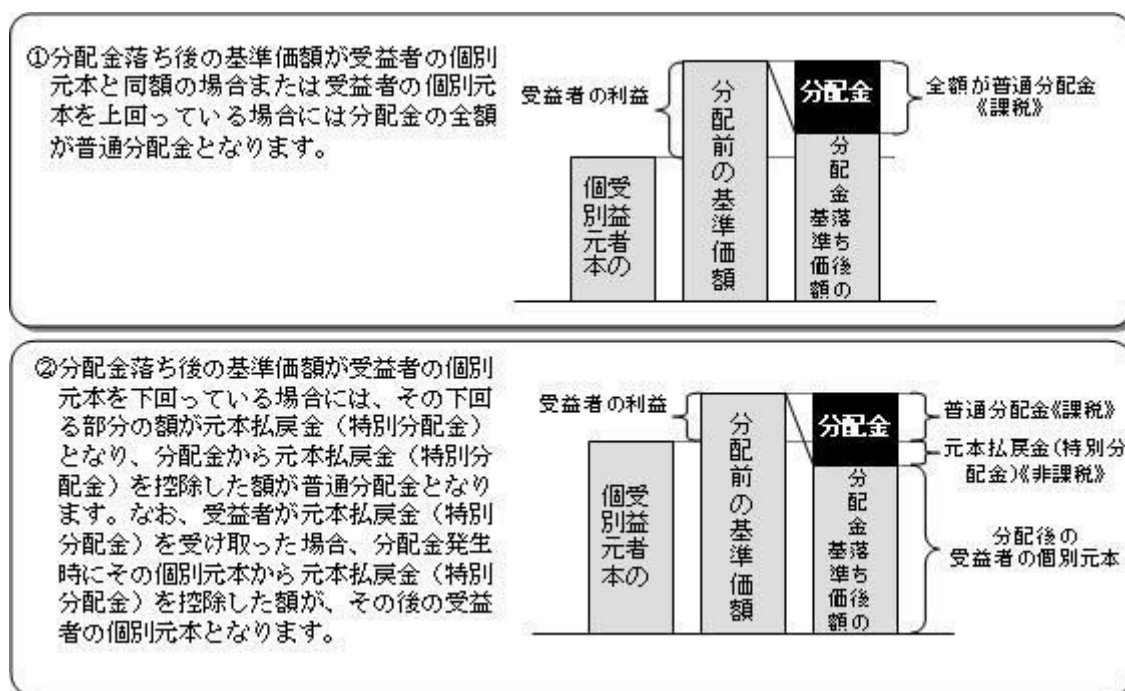
◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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



## ■分配金の課税について■

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



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

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

※上記は2024年3月末現在の情報に基づくものですので、税法が改正された場合等には、内容が変更される場合があります。

## （参考情報）ファンドの総経費率

（単位：％）

|       | 総経費率（①＋②） | ①運用管理費用の比率 | ②その他費用の比率 |
|-------|-----------|------------|-----------|
| 保守型   | 1.20      | 1.19       | 0.01      |
| やや保守型 | 1.28      | 1.27       | 0.01      |
| 普通型   | 1.36      | 1.35       | 0.01      |
| やや積極型 | 1.44      | 1.43       | 0.01      |
| 積極型   | 1.53      | 1.52       | 0.01      |

（2023年2月21日～2024年2月19日）

- \* 総経費率の算出にあたっては、作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。）を作成期中の平均受益権口数に作成期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除しています。
- \* 交付運用報告書に記載している1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
- \* 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
- \* 各比率は、年率換算した値です。
- \* マザーファンドが支払った費用を含みます。
- \* その他費用には、外貨建資産の保管等に要する費用、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用、信託事務の処理に要するその他の諸費用等が含まれます。
- \* その他費用には、有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が含まれる場合があります。
- \* 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
- \* 最新の詳細費用につきましては、委託会社ホームページに掲載している交付運用報告書をご覧ください。



## 5【運用状況】

以下は2024年3月29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】

#### のむラップ・ファンド（保守型）

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券          | 日本   | 61,224,069,198 | 98.81   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 731,855,061    | 1.18    |
| 合計（純資産総額）          |      | 61,955,924,259 | 100.00  |

#### のむラップ・ファンド（やや保守型）

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券          | 日本   | 10,798,027,353 | 98.89   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 120,852,225    | 1.10    |
| 合計（純資産総額）          |      | 10,918,879,578 | 100.00  |

#### のむラップ・ファンド（普通型）

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|--------------------|------|-----------------|---------|
| 親投資信託受益証券          | 日本   | 367,122,100,611 | 98.82   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 4,370,097,474   | 1.17    |
| 合計（純資産総額）          |      | 371,492,198,085 | 100.00  |

#### のむラップ・ファンド（やや積極型）

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）        | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券          | 日本   | 28,124,483,993 | 98.52   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 420,366,143    | 1.47    |
| 合計（純資産総額）          |      | 28,544,850,136 | 100.00  |

#### のむラップ・ファンド（積極型）

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|--------------------|------|-----------------|---------|
| 親投資信託受益証券          | 日本   | 218,985,877,181 | 98.70   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 2,867,723,314   | 1.29    |
| 合計（純資産総額）          |      | 221,853,600,495 | 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   | 691,119,584,470 | 97.61   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 16,864,674,228  | 2.38    |
| 合計（純資産総額）          |      | 707,984,258,698 | 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   | 16,841,600,000 | 2.37    |

## （参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

| 資産の種類              | 国／地域 | 時価合計（円）           | 投資比率（％） |
|--------------------|------|-------------------|---------|
| 国債証券               | 日本   | 946,729,213,400   | 82.97   |
| 地方債証券              | 日本   | 60,393,489,299    | 5.29    |
| 特殊債券               | 日本   | 76,933,763,653    | 6.74    |
| 社債券                | 日本   | 51,246,876,700    | 4.49    |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —    | 5,628,985,202     | 0.49    |
| 合計（純資産総額）          |      | 1,140,932,328,254 | 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     | 1,673,072,582,350 | 73.13   |
|         | カナダ      | 73,425,757,146    | 3.20    |
|         | ドイツ      | 54,481,840,046    | 2.38    |
|         | イタリア     | 17,224,330,468    | 0.75    |
|         | フランス     | 73,921,585,768    | 3.23    |
|         | オランダ     | 32,553,765,438    | 1.42    |
|         | スペイン     | 15,922,606,492    | 0.69    |
|         | ベルギー     | 4,700,672,916     | 0.20    |
|         | オーストリア   | 1,134,886,106     | 0.04    |
|         | ルクセンブルグ  | 295,113,107       | 0.01    |
|         | フィンランド   | 6,054,120,895     | 0.26    |
|         | アイルランド   | 2,127,451,746     | 0.09    |
|         | ポルトガル    | 1,102,922,017     | 0.04    |
|         | スイス      | 796,614,465       | 0.03    |
|         | イギリス     | 90,299,384,807    | 3.94    |
|         | スイス      | 58,625,429,180    | 2.56    |
|         | スウェーデン   | 19,226,438,994    | 0.84    |
|         | ノルウェー    | 3,694,442,924     | 0.16    |
|         | デンマーク    | 22,745,252,984    | 0.99    |
|         | オーストラリア  | 42,478,274,961    | 1.85    |
|         | ニュージーランド | 1,142,064,750     | 0.04    |
|         | 香港       | 10,331,875,663    | 0.45    |
|         | シンガポール   | 6,441,641,669     | 0.28    |
|         | イスラエル    | 2,454,052,164     | 0.10    |
|         | 小計       | 2,214,253,107,056 | 96.78   |
| 新株予約権証券 | カナダ      | 0                 | 0.00    |
| 投資証券    | アメリカ     | 37,287,642,132    | 1.62    |
|         | カナダ      | 166,982,644       | 0.00    |
|         | フランス     | 792,736,698       | 0.03    |

|                    |         |                   |        |
|--------------------|---------|-------------------|--------|
|                    | ベルギー    | 194,369,868       | 0.00   |
|                    | イギリス    | 781,316,888       | 0.03   |
|                    | オーストラリア | 2,895,759,565     | 0.12   |
|                    | 香港      | 409,998,330       | 0.01   |
|                    | シンガポール  | 809,198,177       | 0.03   |
|                    | 小計      | 43,338,004,302    | 1.89   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —       | 30,118,338,508    | 1.31   |
| 合計（純資産総額）          |         | 2,287,709,449,866 | 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    | 22,424,903,577 | 0.98    |
|          | 買建 | カナダ     | 959,884,369    | 0.04    |
|          | 買建 | ドイツ     | 2,775,349,346  | 0.12    |
|          | 買建 | イギリス    | 1,191,422,972  | 0.05    |
|          | 買建 | スイス     | 761,962,188    | 0.03    |
|          | 買建 | オーストラリア | 588,036,078    | 0.02    |

## （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     | 404,107,762,496 | 46.62   |
|       | カナダ      | 17,455,411,948  | 2.01    |
|       | メキシコ     | 7,470,539,592   | 0.86    |
|       | ドイツ      | 44,258,251,655  | 5.10    |
|       | イタリア     | 71,449,849,456  | 8.24    |
|       | フランス     | 57,620,340,038  | 6.64    |
|       | オランダ     | 12,387,442,670  | 1.42    |
|       | スペイン     | 50,964,642,037  | 5.88    |
|       | ベルギー     | 14,749,303,164  | 1.70    |
|       | オーストリア   | 11,436,431,414  | 1.31    |
|       | フィンランド   | 3,132,354,039   | 0.36    |
|       | アイルランド   | 4,028,215,100   | 0.46    |
|       | イギリス     | 44,284,901,117  | 5.10    |
|       | スウェーデン   | 1,628,090,305   | 0.18    |
|       | ノルウェー    | 1,346,585,832   | 0.15    |
|       | デンマーク    | 2,283,153,430   | 0.26    |
|       | ポーランド    | 4,736,045,741   | 0.54    |
|       | オーストラリア  | 11,623,283,035  | 1.34    |
|       | ニュージーランド | 2,096,134,930   | 0.24    |
|       | シンガポール   | 3,534,315,488   | 0.40    |
|       | マレーシア    | 4,206,378,126   | 0.48    |
|       | 中国       | 78,127,771,987  | 9.01    |

|                    |       |                 |        |
|--------------------|-------|-----------------|--------|
|                    | イスラエル | 2,863,947,553   | 0.33   |
|                    | 小計    | 855,791,151,153 | 98.74  |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —     | 10,895,853,797  | 1.25   |
| 合計（純資産総額）          |       | 866,687,004,950 | 100.00 |

（参考）世界REITインデックス マザーファンド

| 資産の種類              | 国／地域     | 時価合計（円）         | 投資比率（％） |
|--------------------|----------|-----------------|---------|
| 投資証券               | 日本       | 11,184,178,250  | 6.59    |
|                    | アメリカ     | 121,672,946,562 | 71.72   |
|                    | カナダ      | 2,336,769,684   | 1.37    |
|                    | ドイツ      | 58,230,973      | 0.03    |
|                    | イタリア     | 10,159,731      | 0.00    |
|                    | フランス     | 2,796,974,565   | 1.64    |
|                    | オランダ     | 274,476,444     | 0.16    |
|                    | スペイン     | 642,848,914     | 0.37    |
|                    | ベルギー     | 1,629,271,506   | 0.96    |
|                    | アイルランド   | 53,803,904      | 0.03    |
|                    | シンガポール   | 54,065,088      | 0.03    |
|                    | ガーンジー    | 167,541,047     | 0.09    |
|                    | イギリス     | 7,772,621,355   | 4.58    |
|                    | オーストラリア  | 12,040,987,609  | 7.09    |
|                    | ニュージーランド | 446,739,675     | 0.26    |
|                    | 香港       | 1,481,684,241   | 0.87    |
|                    | シンガポール   | 4,834,338,632   | 2.84    |
|                    | 韓国       | 284,074,988     | 0.16    |
|                    | イスラエル    | 191,253,605     | 0.11    |
|                    | 小計       | 167,932,966,773 | 98.99   |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | —        | 1,698,894,506   | 1.00    |
| 合計（純資産総額）          |          | 169,631,861,279 | 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   | 91,086,000    | 0.05    |
| 株価指数先物取引   | 買建 | アメリカ | 1,381,289,197 | 0.81    |

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

のむラップ・ファンド（保守型）

| 順位 | 国／地域 | 種類        | 銘柄名                      | 数量             | 簿価単価（円） | 簿価金額（円）        | 評価単価（円） | 評価金額（円）        | 投資比率（％） |
|----|------|-----------|--------------------------|----------------|---------|----------------|---------|----------------|---------|
| 1  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 国内債券NOMURA－BPI総合マザーファンド  | 23,347,478,746 | 1.2588  | 29,389,806,246 | 1.2596  | 29,408,484,228 | 47.46   |
| 2  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国債券マザーファンド              | 4,978,706,432  | 2.8822  | 14,350,017,087 | 2.9390  | 14,632,418,203 | 23.61   |
| 3  | 日本   | 親投資信託受益証券 | 外国株式MSCI－KOKUSA Iマザーファンド | 1,193,772,930  | 6.3874  | 7,625,105,214  | 6.7570  | 8,066,323,688  | 13.01   |

|   |    |               |                         |               |        |               |        |               |      |
|---|----|---------------|-------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|------|
| 4 | 日本 | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式マザーファンド             | 1,478,757,288 | 2.9417 | 4,350,060,315 | 3.1147 | 4,605,885,324 | 7.43 |
| 5 | 日本 | 親投資信託<br>受益証券 | 世界REITインデックス<br>マザーファンド | 1,621,188,771 | 2.6751 | 4,336,872,837 | 2.7825 | 4,510,957,755 | 7.28 |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.81   |
| 合 計       | 98.81   |

## のむラップ・ファンド（やや保守型）

| 順位 | 国／<br>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NOMURA－BPI総<br>合 マザーファンド | 2,911,343,824 | 1.2589          | 3,665,092,796   | 1.2596          | 3,667,128,680   | 33.58           |
| 2  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券マザーファンド                  | 1,070,505,175 | 2.8825          | 3,085,737,127   | 2.9390          | 3,146,214,709   | 28.81           |
| 3  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国株式MSCI－KOKUSA<br>Iマザーファンド  | 299,305,851   | 6.3883          | 1,912,060,110   | 6.7570          | 2,022,409,635   | 18.52           |
| 4  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 世界REITインデックス マ<br>ザーファンド     | 358,253,734   | 2.6752          | 958,421,281     | 2.7825          | 996,841,014     | 9.12            |
| 5  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式マザーファンド                  | 309,960,290   | 2.9421          | 911,963,238     | 3.1147          | 965,433,315     | 8.84            |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.89   |
| 合 計       | 98.89   |

## のむラップ・ファンド（普通型）

| 順位 | 国／<br>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 | 外国債券マザーファンド                  | 33,802,293,275 | 2.8830          | 97,455,017,855  | 2.9390          | 99,344,939,935  | 26.74           |
| 2  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国株式MSCI－KOKUSA<br>Iマザーファンド  | 13,996,719,703 | 6.3884          | 89,416,698,693  | 6.7570          | 94,575,835,033  | 25.45           |
| 3  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券NOMURA－BPI総<br>合 マザーファンド | 69,026,814,831 | 1.2588          | 86,896,889,164  | 1.2596          | 86,946,175,961  | 23.40           |
| 4  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 世界REITインデックス マ<br>ザーファンド     | 16,189,940,060 | 2.6763          | 43,329,772,071  | 2.7825          | 45,048,508,216  | 12.12           |
| 5  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式マザーファンド                  | 13,229,730,461 | 2.9421          | 38,923,239,267  | 3.1147          | 41,206,641,466  | 11.09           |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.82   |
| 合 計       | 98.82   |

## のむラップ・ファンド（やや積極型）

| 順位 | 国／<br>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 | 外国株式MSCI－KOKUSA<br>Iマザーファンド | 1,658,514,371 | 6.3923          | 10,601,723,902  | 6.7570          | 11,206,581,604  | 39.25           |
| 2  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券マザーファンド                 | 2,312,874,880 | 2.8839          | 6,670,197,716   | 2.9390          | 6,797,539,272   | 23.81           |
| 3  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 世界REITインデックス マ<br>ザーファンド    | 1,467,032,827 | 2.6756          | 3,925,312,966   | 2.7825          | 4,082,018,841   | 14.30           |

|   |    |               |                                 |               |        |               |        |               |       |
|---|----|---------------|---------------------------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|
| 4 | 日本 | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式マザーファンド                     | 1,210,448,197 | 2.9433 | 3,562,771,371 | 3.1147 | 3,770,182,999 | 13.20 |
| 5 | 日本 | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券NOMURA－B P I 総<br>合 マザーファンド | 1,800,699,649 | 1.2589 | 2,266,918,159 | 1.2596 | 2,268,161,277 | 7.94  |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.52   |
| 合 計       | 98.52   |

## のむラップ・ファンド（積極型）

| 順位 | 国／<br>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 | 外国株式MSCI－KOKUSA<br>Iマザーファンド     | 17,523,028,534 | 6.3941          | 112,045,106,886 | 6.7570          | 118,403,103,804 | 53.36           |
| 2  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 外国債券マザーファンド                     | 12,489,379,442 | 2.8842          | 36,021,892,058  | 2.9390          | 36,706,286,180  | 16.54           |
| 3  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 世界REITインデックス マ<br>ザーファンド        | 11,312,414,824 | 2.6764          | 30,276,905,933  | 2.7825          | 31,476,794,247  | 14.18           |
| 4  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内株式マザーファンド                     | 7,127,339,837  | 2.9433          | 20,978,328,676  | 3.1147          | 22,199,525,390  | 10.00           |
| 5  | 日本       | 親投資信託<br>受益証券 | 国内債券NOMURA－B P I 総<br>合 マザーファンド | 8,097,941,855  | 1.2589          | 10,194,926,094  | 1.2596          | 10,200,167,560  | 4.59            |

## 種類別及び業種別投資比率

| 種類        | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 98.70   |
| 合 計       | 98.70   |

## （参考）国内株式マザーファンド

| 順位 | 国／<br>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      | 9,697,300  | 1,986.17        | 19,260,536,660  | 3,792.00        | 36,772,161,600  | 5.19            |
| 2  | 日本       | 株式 | 三菱UFJフィナン<br>シャル・グループ | 銀行業        | 10,592,600 | 891.21          | 9,440,313,675   | 1,557.00        | 16,492,678,200  | 2.32            |
| 3  | 日本       | 株式 | ソニーグループ               | 電気機器       | 1,249,300  | 12,563.26       | 15,695,291,454  | 12,985.00       | 16,222,160,500  | 2.29            |
| 4  | 日本       | 株式 | 東京エレクトロン              | 電気機器       | 373,800    | 16,246.14       | 6,072,810,780   | 39,570.00       | 14,791,266,000  | 2.08            |
| 5  | 日本       | 株式 | 三菱商事                  | 卸売業        | 3,587,900  | 1,867.64        | 6,700,923,025   | 3,487.00        | 12,511,007,300  | 1.76            |
| 6  | 日本       | 株式 | キーエンス                 | 電気機器       | 176,700    | 63,989.27       | 11,306,904,960  | 69,540.00       | 12,287,718,000  | 1.73            |
| 7  | 日本       | 株式 | 日立製作所                 | 電気機器       | 857,300    | 7,951.49        | 6,816,815,580   | 13,905.00       | 11,920,756,500  | 1.68            |
| 8  | 日本       | 株式 | 三井住友フィナン<br>シャルグループ   | 銀行業        | 1,236,700  | 5,774.47        | 7,141,292,796   | 8,909.00        | 11,017,760,300  | 1.55            |
| 9  | 日本       | 株式 | 信越化学工業                | 化学         | 1,586,400  | 4,087.85        | 6,484,973,760   | 6,584.00        | 10,444,857,600  | 1.47            |
| 10 | 日本       | 株式 | 三井物産                  | 卸売業        | 1,399,500  | 4,478.06        | 6,267,044,970   | 7,106.00        | 9,944,847,000   | 1.40            |
| 11 | 日本       | 株式 | 日本電信電話                | 情報・通<br>信業 | 52,686,600 | 167.43          | 8,821,784,392   | 179.80          | 9,473,050,680   | 1.33            |
| 12 | 日本       | 株式 | 任天堂                   | その他製<br>品  | 1,115,000  | 5,800.57        | 6,467,640,006   | 8,196.00        | 9,138,540,000   | 1.29            |
| 13 | 日本       | 株式 | リクルートホール<br>ディングス     | サービス<br>業  | 1,344,100  | 3,941.06        | 5,297,187,020   | 6,707.00        | 9,014,878,700   | 1.27            |
| 14 | 日本       | 株式 | 伊藤忠商事                 | 卸売業        | 1,256,000  | 4,808.57        | 6,039,571,240   | 6,466.00        | 8,121,296,000   | 1.14            |
| 15 | 日本       | 株式 | 東京海上ホールディ<br>ングス      | 保険業        | 1,719,200  | 2,805.81        | 4,823,756,934   | 4,703.00        | 8,085,397,600   | 1.14            |
| 16 | 日本       | 株式 | 本田技研工業                | 輸送用機器      | 4,184,400  | 1,243.63        | 5,203,845,372   | 1,891.00        | 7,912,700,400   | 1.11            |

|    |    |    |                |        |           |           |               |           |               |      |
|----|----|----|----------------|--------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 17 | 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ     | 情報・通信業 | 873,700   | 5,314.62  | 4,643,387,956 | 8,962.00  | 7,830,099,400 | 1.10 |
| 18 | 日本 | 株式 | 第一三共           | 医薬品    | 1,543,000 | 4,409.47  | 6,803,827,630 | 4,777.00  | 7,370,911,000 | 1.04 |
| 19 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業    | 2,347,800 | 2,051.03  | 4,815,429,052 | 3,046.00  | 7,151,398,800 | 1.01 |
| 20 | 日本 | 株式 | 武田薬品工業         | 医薬品    | 1,567,600 | 4,551.20  | 7,134,470,648 | 4,184.00  | 6,558,838,400 | 0.92 |
| 21 | 日本 | 株式 | HOYA           | 精密機器   | 347,700   | 15,081.83 | 5,243,953,996 | 18,740.00 | 6,515,898,000 | 0.92 |
| 22 | 日本 | 株式 | KDDI           | 情報・通信業 | 1,368,700 | 4,232.75  | 5,793,366,974 | 4,482.00  | 6,134,513,400 | 0.86 |
| 23 | 日本 | 株式 | ソフトバンク         | 情報・通信業 | 2,852,400 | 1,544.20  | 4,404,677,656 | 1,951.00  | 5,565,032,400 | 0.78 |
| 24 | 日本 | 株式 | 三菱電機           | 電気機器   | 1,985,300 | 1,754.80  | 3,483,805,072 | 2,512.00  | 4,987,073,600 | 0.70 |
| 25 | 日本 | 株式 | ディスコ           | 機械     | 85,900    | 17,798.90 | 1,528,926,314 | 57,190.00 | 4,912,621,000 | 0.69 |
| 26 | 日本 | 株式 | オリエンタルランド      | サービス業  | 960,800   | 4,887.19  | 4,695,613,611 | 4,849.00  | 4,658,919,200 | 0.65 |
| 27 | 日本 | 株式 | 村田製作所          | 電気機器   | 1,606,800 | 2,591.31  | 4,163,722,980 | 2,824.00  | 4,537,603,200 | 0.64 |
| 28 | 日本 | 株式 | SMC            | 機械     | 53,400    | 70,102.16 | 3,743,455,789 | 84,830.00 | 4,529,922,000 | 0.63 |
| 29 | 日本 | 株式 | 三菱重工業          | 機械     | 3,119,300 | 568.95    | 1,774,731,595 | 1,448.50  | 4,518,306,050 | 0.63 |
| 30 | 日本 | 株式 | ダイキン工業         | 機械     | 212,900   | 25,557.03 | 5,441,093,652 | 20,600.00 | 4,385,740,000 | 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   | 0.07    |
|    |       | 鉱業       | 0.32    |
|    |       | 建設業      | 2.03    |
|    |       | 食料品      | 3.00    |
|    |       | 繊維製品     | 0.35    |
|    |       | パルプ・紙    | 0.16    |
|    |       | 化学       | 5.58    |
|    |       | 医薬品      | 4.16    |
|    |       | 石油・石炭製品  | 0.51    |
|    |       | ゴム製品     | 0.67    |
|    |       | ガラス・土石製品 | 0.67    |
|    |       | 鉄鋼       | 0.91    |
|    |       | 非鉄金属     | 0.69    |
|    |       | 金属製品     | 0.50    |
|    |       | 機械       | 5.48    |
|    |       | 電気機器     | 16.98   |
|    |       | 輸送用機器    | 9.27    |
|    |       | 精密機器     | 2.15    |
|    |       | その他製品    | 2.22    |
|    |       | 電気・ガス業   | 1.35    |
|    |       | 陸運業      | 2.43    |
|    |       | 海運業      | 0.68    |
|    |       | 空運業      | 0.39    |
|    |       | 倉庫・運輸関連業 | 0.12    |
|    |       | 情報・通信業   | 7.08    |
|    |       | 卸売業      | 7.23    |

|  |            |       |
|--|------------|-------|
|  | 小売業        | 4.12  |
|  | 銀行業        | 7.22  |
|  | 証券、商品先物取引業 | 0.90  |
|  | 保険業        | 2.65  |
|  | その他金融業     | 1.16  |
|  | 不動産業       | 2.08  |
|  | サービス業      | 4.33  |
|  | 合 計        | 97.61 |

## (参考) 国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

| 順位 | 国／<br>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（2年）第452回  | 28,000,000,000 | 99.93           | 27,981,580,000  | 99.88           | 27,968,080,000  | 0.005     | 2025/9/1   | 2.45            |
| 2  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（2年）第453回  | 26,000,000,000 | 99.81           | 25,952,765,000  | 99.86           | 25,964,900,000  | 0.005     | 2025/10/1  | 2.27            |
| 3  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（2年）第455回  | 15,000,000,000 | 99.91           | 14,986,780,000  | 99.77           | 14,966,250,000  | 0.005     | 2025/12/1  | 1.31            |
| 4  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第370回 | 15,000,000,000 | 99.50           | 14,925,940,000  | 98.77           | 14,815,500,000  | 0.5       | 2033/3/20  | 1.29            |
| 5  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（5年）第163回  | 13,000,000,000 | 100.38          | 13,050,275,000  | 100.33          | 13,042,900,000  | 0.4       | 2028/9/20  | 1.14            |
| 6  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（5年）第162回  | 13,000,000,000 | 99.64           | 12,954,480,000  | 99.88           | 12,985,570,000  | 0.3       | 2028/9/20  | 1.13            |
| 7  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第360回 | 13,000,000,000 | 98.35           | 12,785,665,000  | 97.92           | 12,729,860,000  | 0.1       | 2030/9/20  | 1.11            |
| 8  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第372回 | 12,000,000,000 | 100.83          | 12,100,378,000  | 101.02          | 12,122,640,000  | 0.8       | 2033/9/20  | 1.06            |
| 9  | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（5年）第157回  | 12,000,000,000 | 100.33          | 12,040,380,000  | 99.70           | 11,964,600,000  | 0.2       | 2028/3/20  | 1.04            |
| 10 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第369回 | 12,000,000,000 | 100.33          | 12,039,700,000  | 99.00           | 11,880,840,000  | 0.5       | 2032/12/20 | 1.04            |
| 11 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第363回 | 12,050,000,000 | 97.61           | 11,762,288,000  | 97.21           | 11,714,046,000  | 0.1       | 2031/6/20  | 1.02            |
| 12 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第350回 | 11,650,000,000 | 99.94           | 11,643,691,000  | 99.31           | 11,569,964,500  | 0.1       | 2028/3/20  | 1.01            |
| 13 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第367回 | 10,500,000,000 | 98.49           | 10,341,700,000  | 96.98           | 10,182,900,000  | 0.2       | 2032/6/20  | 0.89            |
| 14 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（5年）第165回  | 10,000,000,000 | 99.69           | 9,969,480,000   | 99.76           | 9,976,700,000   | 0.3       | 2028/12/20 | 0.87            |
| 15 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第347回 | 10,000,000,000 | 99.91           | 9,991,000,000   | 99.63           | 9,963,200,000   | 0.1       | 2027/6/20  | 0.87            |
| 16 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（5年）第154回  | 10,000,000,000 | 99.86           | 9,986,000,000   | 99.55           | 9,955,200,000   | 0.1       | 2027/9/20  | 0.87            |
| 17 | 日本       | 国債証券 | 国庫債券 利付（10年）第348回 | 10,000,000,000 | 99.98           | 9,998,000,000   | 99.55           | 9,955,200,000   | 0.1       | 2027/9/20  | 0.87            |



|    |    |      |                   |                |        |               |        |               |       |            |      |
|----|----|------|-------------------|----------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 18 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３６８回 | 10,000,000,000 | 97.87  | 9,787,185,000 | 96.73  | 9,673,600,000 | 0.2   | 2032/9/20  | 0.84 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３５１回 | 9,500,000,000  | 99.83  | 9,484,420,000 | 99.22  | 9,426,660,000 | 0.1   | 2028/6/20  | 0.82 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３６５回 | 9,500,000,000  | 97.20  | 9,234,328,000 | 96.66  | 9,183,365,000 | 0.1   | 2031/12/20 | 0.80 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（２年）第４５６回  | 9,000,000,000  | 100.01 | 9,001,370,000 | 99.89  | 8,990,550,000 | 0.1   | 2026/1/1   | 0.78 |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（５年）第１５３回  | 9,000,000,000  | 99.76  | 8,978,600,000 | 99.32  | 8,939,520,000 | 0.005 | 2027/6/20  | 0.78 |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３５２回 | 9,000,000,000  | 99.63  | 8,967,210,000 | 99.03  | 8,912,700,000 | 0.1   | 2028/9/20  | 0.78 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３７３回 | 9,000,000,000  | 98.87  | 8,898,300,000 | 98.86  | 8,897,760,000 | 0.6   | 2033/12/20 | 0.77 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３７１回 | 9,000,000,000  | 97.18  | 8,746,745,000 | 97.65  | 8,788,950,000 | 0.4   | 2033/6/20  | 0.77 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３６４回 | 9,050,000,000  | 97.46  | 8,820,177,000 | 96.94  | 8,773,432,000 | 0.1   | 2031/9/20  | 0.76 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３６６回 | 9,000,000,000  | 97.80  | 8,802,485,000 | 97.21  | 8,749,530,000 | 0.2   | 2032/3/20  | 0.76 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３６２回 | 8,500,000,000  | 98.44  | 8,367,400,000 | 97.47  | 8,285,035,000 | 0.1   | 2031/3/20  | 0.72 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（２０年）第１８６回 | 8,000,000,000  | 100.94 | 8,075,880,000 | 100.75 | 8,060,720,000 | 1.5   | 2043/9/20  | 0.70 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付（１０年）第３６１回 | 8,000,000,000  | 98.15  | 7,852,110,000 | 97.71  | 7,817,280,000 | 0.1   | 2030/12/20 | 0.68 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類    | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券  | 82.97   |
| 地方債証券 | 5.29    |
| 特殊債券  | 6.74    |
| 社債券   | 4.49    |
| 合 計   | 99.50   |

（参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

| 順位 | 国／地域 | 種類 | 銘柄名            | 業種          | 数量        | 簿価単価(円)   | 簿価金額(円)        | 評価単価(円)    | 評価金額(円)         | 投資比率(%) |
|----|------|----|----------------|-------------|-----------|-----------|----------------|------------|-----------------|---------|
| 1  | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア      | 1,726,900 | 44,098.21 | 76,153,207,316 | 63,701.21  | 110,005,628,529 | 4.80    |
| 2  | アメリカ | 株式 | APPLE INC      | コンピュータ・周辺機器 | 3,592,700 | 24,785.91 | 89,048,373,723 | 25,963.78  | 93,280,096,836  | 4.07    |
| 3  | アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP    | 半導体・半導体製造装置 | 604,130   | 45,446.60 | 27,455,656,796 | 136,808.01 | 82,649,828,881  | 3.61    |
| 4  | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 大規模小売り      | 2,274,800 | 16,140.59 | 36,716,636,749 | 27,311.33  | 62,127,826,678  | 2.71    |

|    |       |    |                              |                         |           |            |                |            |                |      |
|----|-------|----|------------------------------|-------------------------|-----------|------------|----------------|------------|----------------|------|
| 5  | アメリカ  | 株式 | META PLATFORMS INC-CLASS A   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    | 542,900   | 33,571.19  | 18,225,800,927 | 73,521.66  | 39,914,913,449 | 1.74 |
| 6  | アメリカ  | 株式 | ALPHABET INC-CL A            | インタラクティブ・メディアおよびサービス    | 1,447,500 | 15,734.00  | 22,774,966,915 | 22,852.31  | 33,078,720,607 | 1.44 |
| 7  | アメリカ  | 株式 | ALPHABET INC-CL C            | インタラクティブ・メディアおよびサービス    | 1,260,200 | 15,752.91  | 19,851,819,383 | 23,053.68  | 29,052,255,853 | 1.26 |
| 8  | アメリカ  | 株式 | ELI LILLY & CO.              | 医薬品                     | 197,360   | 55,406.27  | 10,934,982,382 | 117,790.92 | 23,247,216,682 | 1.01 |
| 9  | アメリカ  | 株式 | BROADCOM INC                 | 半導体・半導体製造装置             | 108,777   | 101,270.63 | 11,015,915,826 | 200,680.32 | 21,829,404,050 | 0.95 |
| 10 | アメリカ  | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO          | 銀行                      | 707,100   | 19,843.30  | 14,031,203,223 | 30,327.42  | 21,444,520,803 | 0.93 |
| 11 | アメリカ  | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B  | 金融サービス                  | 320,600   | 47,142.04  | 15,113,740,347 | 63,670.93  | 20,412,901,184 | 0.89 |
| 12 | アメリカ  | 株式 | TESLA INC                    | 自動車                     | 699,800   | 30,060.96  | 21,036,660,697 | 26,616.36  | 18,626,131,457 | 0.81 |
| 13 | アメリカ  | 株式 | EXXON MOBIL CORP             | 石油・ガス・消耗燃料              | 977,600   | 16,556.85  | 16,185,979,434 | 17,599.89  | 17,205,660,676 | 0.75 |
| 14 | アメリカ  | 株式 | UNITEDHEALTH GROUP INC       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 226,270   | 71,715.98  | 16,227,174,881 | 74,902.52  | 16,948,194,784 | 0.74 |
| 15 | アメリカ  | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES      | 金融サービス                  | 387,100   | 34,012.62  | 13,166,285,707 | 42,255.50  | 16,357,105,134 | 0.71 |
| 16 | デンマーク | 株式 | NOVO NORDISK A/S-B           | 医薬品                     | 798,200   | 12,142.08  | 9,691,810,639  | 19,282.84  | 15,391,566,081 | 0.67 |
| 17 | アメリカ  | 株式 | MASTERCARD INC               | 金融サービス                  | 204,800   | 55,049.51  | 11,274,141,449 | 72,914.51  | 14,932,892,406 | 0.65 |
| 18 | オランダ  | 株式 | ASML HOLDING NV              | 半導体・半導体製造装置             | 98,600    | 102,563.81 | 10,112,792,172 | 145,642.72 | 14,360,372,981 | 0.62 |
| 19 | アメリカ  | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO          | 家庭用品                    | 576,500   | 22,379.04  | 12,901,517,468 | 24,566.27  | 14,162,456,096 | 0.61 |
| 20 | アメリカ  | 株式 | HOME DEPOT                   | 専門小売り                   | 243,400   | 43,683.63  | 10,632,596,913 | 58,080.87  | 14,136,885,218 | 0.61 |
| 21 | アメリカ  | 株式 | JOHNSON & JOHNSON            | 医薬品                     | 588,746   | 23,290.12  | 13,711,965,254 | 23,951.54  | 14,101,378,020 | 0.61 |
| 22 | アメリカ  | 株式 | MERCK & CO INC               | 医薬品                     | 619,800   | 16,125.48  | 9,994,573,172  | 19,978.54  | 12,382,704,980 | 0.54 |
| 23 | アメリカ  | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 生活必需品流通・小売り             | 108,520   | 76,336.23  | 8,284,008,734  | 110,927.50 | 12,037,853,201 | 0.52 |
| 24 | アメリカ  | 株式 | ABBVIE INC                   | バイオテクノロジー               | 431,800   | 23,873.15  | 10,308,428,416 | 27,571.76  | 11,905,486,400 | 0.52 |
| 25 | アメリカ  | 株式 | ADVANCED MICRO DEVICES       | 半導体・半導体製造装置             | 395,148   | 15,295.19  | 6,043,865,294  | 27,327.99  | 10,798,600,948 | 0.47 |
| 26 | アメリカ  | 株式 | SALESFORCE INC               | ソフトウェア                  | 236,740   | 30,306.17  | 7,174,684,138  | 45,601.66  | 10,795,737,888 | 0.47 |
| 27 | スイス   | 株式 | NESTLE SA-REG                | 食品                      | 653,000   | 18,433.74  | 12,037,237,108 | 16,078.34  | 10,499,156,020 | 0.45 |
| 28 | アメリカ  | 株式 | CHEVRON CORP                 | 石油・ガス・消耗燃料              | 437,300   | 24,494.09  | 10,711,268,682 | 23,883.41  | 10,444,216,680 | 0.45 |
| 29 | アメリカ  | 株式 | BANK OF AMERICA CORP         | 銀行                      | 1,742,000 | 4,305.29   | 7,499,825,273  | 5,741.46   | 10,001,635,862 | 0.43 |
| 30 | アメリカ  | 株式 | WALMART INC                  | 生活必需品流通・小売り             | 1,086,800 | 7,438.46   | 8,084,125,898  | 9,110.33   | 9,901,117,186  | 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 | 4.59    |
|    |       | メディア                 | 0.59    |
|    |       | 娯楽                   | 1.08    |
|    |       | 不動産管理・開発             | 0.31    |
|    |       | エネルギー設備・サービス         | 0.25    |
|    |       | 石油・ガス・消耗燃料           | 4.37    |
|    |       | 化学                   | 1.83    |
|    |       | 建設資材                 | 0.34    |
|    |       | 容器・包装                | 0.21    |
|    |       | 金属・鉱業                | 1.33    |
|    |       | 紙製品・林産品              | 0.08    |
|    |       | 航空宇宙・防衛              | 1.76    |
|    |       | 建設関連製品               | 0.64    |
|    |       | 建設・土木                | 0.32    |
|    |       | 電気設備                 | 0.96    |
|    |       | コングロマリット             | 0.94    |
|    |       | 機械                   | 1.92    |
|    |       | 商社・流通業               | 0.49    |
|    |       | 商業サービス・用品            | 0.61    |
|    |       | 航空貨物・物流サービス          | 0.44    |
|    |       | 旅客航空輸送               | 0.04    |
|    |       | 海上運輸                 | 0.04    |
|    |       | 陸上運輸                 | 1.10    |
|    |       | 運送インフラ               | 0.09    |
|    |       | 自動車用部品               | 0.14    |
|    |       | 自動車                  | 1.47    |
|    |       | 家庭用耐久財               | 0.31    |
|    |       | レジャー用品               | 0.01    |
|    |       | 繊維・アパレル・贅沢品          | 1.15    |
|    |       | ホテル・レストラン・レジャー       | 1.99    |
|    |       | 販売                   | 0.09    |
|    |       | 大規模小売り               | 3.10    |
|    |       | 専門小売り                | 1.68    |
|    |       | 生活必需品流通・小売り          | 1.70    |
|    |       | 飲料                   | 1.47    |
|    |       | 食品                   | 1.26    |
|    |       | タバコ                  | 0.48    |
|    |       | 家庭用品                 | 0.99    |
|    |       | パーソナルケア用品            | 0.57    |
|    |       | ヘルスケア機器・用品           | 2.22    |

|         |   |                         |       |
|---------|---|-------------------------|-------|
|         |   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 1.95  |
|         |   | バイオテクノロジー               | 1.72  |
|         |   | 医薬品                     | 4.94  |
|         |   | 銀行                      | 5.47  |
|         |   | 金融サービス                  | 3.16  |
|         |   | 保険                      | 3.07  |
|         |   | 情報技術サービス                | 1.33  |
|         |   | ソフトウェア                  | 8.72  |
|         |   | 通信機器                    | 0.64  |
|         |   | コンピュータ・周辺機器             | 4.41  |
|         |   | 電子装置・機器・部品              | 0.49  |
|         |   | 半導体・半導体製造装置             | 8.28  |
|         |   | 各種電気通信サービス              | 0.90  |
|         |   | 無線通信サービス                | 0.20  |
|         |   | 電力                      | 1.51  |
|         |   | ガス                      | 0.08  |
|         |   | 総合公益事業                  | 0.67  |
|         |   | 水道                      | 0.08  |
|         |   | 消費者金融                   | 0.40  |
|         |   | 資本市場                    | 3.15  |
|         |   | 各種消費者サービス               | 0.01  |
|         |   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      | 0.11  |
|         |   | ヘルスケア・テクノロジー            | 0.05  |
|         |   | ライフサイエンス・ツール/サービス       | 1.20  |
|         |   | 専門サービス                  | 0.96  |
| 新株予約権証券 | — | —                       | 0.00  |
| 投資証券    | — | —                       | 1.89  |
| 合 計     |   |                         | 98.68 |

（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         | 86,650,000 | 17,707.85       | 15,343,853,676  | 16,759.19       | 14,521,841,926  | 6.25      | 2030/5/15  | 1.67            |
| 2  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND        | 84,200,000 | 16,416.16       | 13,822,409,434  | 15,764.38       | 13,273,609,832  | 5.25      | 2028/11/15 | 1.53            |
| 3  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B         | 87,650,000 | 15,850.93       | 13,893,345,179  | 15,040.15       | 13,182,698,410  | 4.125     | 2032/11/15 | 1.52            |
| 4  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B         | 89,400,000 | 13,701.02       | 12,248,713,841  | 13,582.54       | 12,142,792,023  | 2.75      | 2032/8/15  | 1.40            |
| 5  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND        | 70,850,000 | 16,014.63       | 11,346,369,393  | 15,534.31       | 11,006,058,766  | 6         | 2026/2/15  | 1.26            |
| 6  | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 56,600,000 | 18,919.45       | 10,708,411,531  | 19,213.02       | 10,874,570,180  | 4.75      | 2035/4/25  | 1.25            |
| 7  | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 57,950,000 | 18,818.46       | 10,905,300,478  | 18,557.12       | 10,753,852,895  | 5.5       | 2029/4/25  | 1.24            |
| 8  | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B         | 74,000,000 | 13,920.42       | 10,301,112,444  | 14,105.97       | 10,438,418,040  | 0.25      | 2025/10/31 | 1.20            |

|    |      |      |                          |             |           |                |           |               |       |            |      |
|----|------|------|--------------------------|-------------|-----------|----------------|-----------|---------------|-------|------------|------|
| 9  | スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 56,900,000  | 17,656.86 | 10,046,757,481 | 17,372.03 | 9,884,687,030 | 5.9   | 2026/7/30  | 1.14 |
| 10 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 71,200,000  | 13,208.81 | 9,404,673,080  | 13,453.30 | 9,578,756,684 | 0.5   | 2027/4/30  | 1.10 |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 67,200,000  | 13,959.40 | 9,380,721,667  | 14,088.81 | 9,467,686,099 | 0.375 | 2025/11/30 | 1.09 |
| 12 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 65,000,000  | 14,186.76 | 9,221,394,208  | 14,216.57 | 9,240,771,012 | 2     | 2026/11/15 | 1.06 |
| 13 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 54,000,000  | 16,342.11 | 8,824,739,708  | 16,831.67 | 9,089,105,256 | 3.85  | 2029/12/15 | 1.04 |
| 14 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 62,300,000  | 13,986.70 | 8,713,718,564  | 14,342.25 | 8,935,222,800 | 0.25  | 2025/5/31  | 1.03 |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 64,230,000  | 14,185.60 | 9,111,412,742  | 13,749.92 | 8,831,574,017 | 2.875 | 2032/5/15  | 1.01 |
| 16 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 44,000,000  | 20,157.65 | 8,869,368,848  | 20,001.63 | 8,800,718,943 | 5.75  | 2032/10/25 | 1.01 |
| 17 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 59,300,000  | 14,543.57 | 8,624,341,108  | 14,546.59 | 8,626,131,509 | 2.25  | 2025/11/15 | 0.99 |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 63,100,000  | 13,518.15 | 8,529,957,270  | 13,414.86 | 8,464,780,090 | 1.125 | 2028/2/29  | 0.97 |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 59,550,000  | 13,804.49 | 8,220,574,822  | 14,198.82 | 8,455,401,508 | 0.25  | 2025/8/31  | 0.97 |
| 20 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 51,450,000  | 16,332.71 | 8,403,183,345  | 16,377.86 | 8,426,413,703 | 3.6   | 2025/9/29  | 0.97 |
| 21 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 43,850,000  | 18,448.50 | 8,089,670,315  | 19,045.21 | 8,351,324,936 | 5.75  | 2033/2/1   | 0.96 |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 102,200,000 | 8,774.97  | 8,968,028,632  | 8,000.48  | 8,176,490,738 | 1.375 | 2050/8/15  | 0.94 |
| 23 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 42,150,000  | 18,889.78 | 7,962,042,346  | 18,309.97 | 7,717,655,660 | 6.5   | 2027/7/4   | 0.89 |
| 24 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 45,650,000  | 16,442.73 | 7,506,109,924  | 16,586.81 | 7,571,881,687 | 3.85  | 2026/9/15  | 0.87 |
| 25 | スペイン | 国債証券 | SPANISH GOVERNMENT       | 38,400,000  | 19,424.31 | 7,458,938,053  | 19,623.08 | 7,535,262,874 | 5.75  | 2032/7/30  | 0.86 |
| 26 | ドイツ  | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 38,450,000  | 19,922.92 | 7,660,365,276  | 19,565.13 | 7,522,792,562 | 5.5   | 2031/1/4   | 0.86 |
| 27 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 96,900,000  | 8,194.14  | 7,940,127,352  | 7,749.11  | 7,508,892,773 | 1.25  | 2050/5/15  | 0.86 |
| 28 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B          | 50,000,000  | 15,571.57 | 7,785,786,094  | 14,962.38 | 7,481,191,569 | 4     | 2030/2/28  | 0.86 |
| 29 | スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 40,550,000  | 17,991.13 | 7,295,403,730  | 17,955.58 | 7,280,989,230 | 5.15  | 2028/10/31 | 0.84 |
| 30 | スペイン | 国債証券 | SPANISH GOVERNMENT       | 38,500,000  | 18,805.02 | 7,239,932,795  | 18,672.12 | 7,188,768,425 | 6     | 2029/1/31  | 0.82 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.74   |
| 合 計  | 98.74   |

（参考）世界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             | 703,600   | 19,456.85  | 13,689,845,175 | 19,716.61  | 13,872,606,937 | 8.17    |
| 2  | アメリカ    | 投資証券 | EQUINIX INC              | 71,500    | 121,945.38 | 8,719,094,749  | 124,963.21 | 8,934,869,894  | 5.26    |
| 3  | アメリカ    | 投資証券 | WELLTOWER INC            | 421,600   | 13,610.90  | 5,738,356,936  | 14,147.75  | 5,964,691,569  | 3.51    |
| 4  | アメリカ    | 投資証券 | SIMON PROPERTY GROUP INC | 248,300   | 21,491.08  | 5,336,235,747  | 23,694.15  | 5,883,257,668  | 3.46    |
| 5  | アメリカ    | 投資証券 | PUBLIC STORAGE           | 120,600   | 44,107.17  | 5,319,324,936  | 43,917.98  | 5,296,508,943  | 3.12    |
| 6  | アメリカ    | 投資証券 | REALTY INCOME CORP       | 633,500   | 8,523.22   | 5,399,463,530  | 8,191.28   | 5,189,176,513  | 3.05    |
| 7  | アメリカ    | 投資証券 | DIGITAL REALTY TRUST INC | 230,700   | 20,846.05  | 4,809,184,754  | 21,809.09  | 5,031,358,539  | 2.96    |
| 8  | オーストラリア | 投資証券 | GOODMAN GROUP            | 1,318,000 | 2,429.04   | 3,201,487,078  | 3,334.00   | 4,394,217,403  | 2.59    |
| 9  | アメリカ    | 投資証券 | EXTRA SPACE STORAGE INC  | 161,000   | 22,179.59  | 3,570,915,064  | 22,257.27  | 3,583,420,470  | 2.11    |

|    |         |      |                              |           |           |               |           |               |      |
|----|---------|------|------------------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 10 | アメリカ    | 投資証券 | VICI PROPERTIES INC          | 788,000   | 4,618.08  | 3,639,051,532 | 4,510.50  | 3,554,277,073 | 2.09 |
| 11 | アメリカ    | 投資証券 | AVALONBAY COMMUNITIES INC    | 108,100   | 27,293.90 | 2,950,471,406 | 28,095.63 | 3,037,138,641 | 1.79 |
| 12 | アメリカ    | 投資証券 | IRON MOUNTAIN INC            | 222,600   | 10,187.88 | 2,267,823,274 | 12,144.59 | 2,703,387,092 | 1.59 |
| 13 | アメリカ    | 投資証券 | EQUITY RESIDENTIAL           | 263,100   | 9,168.54  | 2,412,244,108 | 9,555.48  | 2,514,048,130 | 1.48 |
| 14 | アメリカ    | 投資証券 | INVITATION HOMES INC         | 438,600   | 5,099.80  | 2,236,773,980 | 5,391.71  | 2,364,804,050 | 1.39 |
| 15 | アメリカ    | 投資証券 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 120,100   | 18,664.02 | 2,241,549,714 | 19,518.26 | 2,344,143,398 | 1.38 |
| 16 | アメリカ    | 投資証券 | VENTAS INC                   | 306,800   | 7,239.47  | 2,221,070,235 | 6,592.39  | 2,022,545,682 | 1.19 |
| 17 | アメリカ    | 投資証券 | SUN COMMUNITIES INC          | 94,500    | 19,546.72 | 1,847,165,769 | 19,468.29 | 1,839,754,142 | 1.08 |
| 18 | アメリカ    | 投資証券 | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 49,000    | 36,405.26 | 1,783,857,952 | 37,066.68 | 1,816,267,423 | 1.07 |
| 19 | アメリカ    | 投資証券 | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 89,000    | 20,404.53 | 1,816,003,915 | 19,922.52 | 1,773,104,974 | 1.04 |
| 20 | イギリス    | 投資証券 | SEGRO PLC                    | 1,024,000 | 1,595.78  | 1,634,085,351 | 1,728.24  | 1,769,724,273 | 1.04 |
| 21 | アメリカ    | 投資証券 | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 536,000   | 3,021.64  | 1,619,600,974 | 3,131.15  | 1,678,301,117 | 0.98 |
| 22 | アメリカ    | 投資証券 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 538,000   | 2,961.34  | 1,593,201,305 | 2,838.93  | 1,527,348,375 | 0.90 |
| 23 | アメリカ    | 投資証券 | KIMCO REALTY CORP            | 508,000   | 3,047.43  | 1,548,095,085 | 2,969.15  | 1,508,328,251 | 0.88 |
| 24 | アメリカ    | 投資証券 | WP CAREY INC                 | 166,900   | 9,862.15  | 1,645,993,403 | 8,545.58  | 1,426,257,369 | 0.84 |
| 25 | アメリカ    | 投資証券 | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 203,800   | 7,031.36  | 1,432,992,691 | 6,975.45  | 1,421,598,483 | 0.83 |
| 26 | アメリカ    | 投資証券 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 142,300   | 10,345.76 | 1,472,202,884 | 9,750.80  | 1,387,539,409 | 0.81 |
| 27 | アメリカ    | 投資証券 | AMERICAN HOMES 4 RENT-A      | 242,700   | 5,391.13  | 1,308,427,532 | 5,568.85  | 1,351,562,273 | 0.79 |
| 28 | オーストラリア | 投資証券 | SCENTRE GROUP                | 3,930,000 | 283.45    | 1,113,970,280 | 334.28    | 1,313,751,447 | 0.77 |
| 29 | アメリカ    | 投資証券 | UDR INC                      | 231,000   | 5,680.42  | 1,312,177,353 | 5,664.24  | 1,308,441,311 | 0.77 |
| 30 | 香港      | 投資証券 | LINK REIT                    | 1,962,100 | 778.52    | 1,527,534,524 | 650.79    | 1,276,917,021 | 0.75 |

#### 種類別及び業種別投資比率

| 種類   | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 投資証券 | 98.99   |
| 合 計  | 98.99   |

#### ②【投資不動産物件】

##### のむラップ・ファンド（保守型）

該当事項はありません。

##### のむラップ・ファンド（やや保守型）

該当事項はありません。

##### のむラップ・ファンド（普通型）

該当事項はありません。

##### のむラップ・ファンド（やや積極型）

該当事項はありません。

##### のむラップ・ファンド（積極型）

該当事項はありません。

##### （参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

##### （参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式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）世界REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

のむラップ・ファンド（保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（普通型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（やや積極型）

該当事項はありません。

のむラップ・ファンド（積極型）

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

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

| 種類           | 取引所   | 名称                 | 買建／<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(2024年06月限) | 買建        | 608 | 日本円 | 16,549,376,810 | 16,841,600,000 | 2.37            |

（参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式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<br>カ | シカゴ<br>マーカン<br>タイル取<br>引所     | E-mini S&P500株<br>価指数先物(2024<br>年06月限) | 買建        | 558 | 米ドル       | 146,037,625 | 22,111,556,801 | 148,107,150 | 22,424,903,577 | 0.98            |
|                  | カナダ      | モントリ<br>オール取<br>引所            | S&P TSX60株価指<br>数先物(2024年06<br>月限)     | 買建        | 32  | カナダド<br>ル | 8,482,000   | 948,372,418    | 8,584,960   | 959,884,369    | 0.04            |
|                  | 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(2024年06月<br>限)         | 買建        | 337 | ユーロ       | 16,677,430  | 2,722,423,677  | 17,001,650  | 2,775,349,346  | 0.12            |

|  |         |                    |                         |    |    |        |           |               |           |               |      |
|--|---------|--------------------|-------------------------|----|----|--------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
|  | オーストラリア | シドニー先物取引所          | SPI200株価指数先物(2024年06月限) | 買建 | 30 | 豪ドル    | 5,846,050 | 576,478,989   | 5,963,250 | 588,036,078   | 0.02 |
|  | イギリス    | ロンドン国際金融先物オプション取引所 | FT100株価指数先物(2024年06月限)  | 買建 | 78 | 英ポンド   | 6,064,345 | 1,159,624,051 | 6,230,640 | 1,191,422,972 | 0.05 |
|  | スイス     | ユーレックス・チューリッヒ取引所   | SMI株価指数先物(2024年06月限)    | 買建 | 39 | スイスフラン | 4,502,060 | 755,985,920   | 4,537,650 | 761,962,188   | 0.03 |

（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）世界REITインデックス マザーファンド

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

| 種類         | 国／地域 | 取引所            | 名称                           | 買建／売建 | 枚数  | 通貨  | 帳簿価額       | 帳簿価額(円)       | 評価額        | 評価額(円)        | 投資比率(%) |
|------------|------|----------------|------------------------------|-------|-----|-----|------------|---------------|------------|---------------|---------|
| REIT指数先物取引 | 日本   | 大阪取引所          | REIT指数先物(2024年06月限)          | 買建    | 51  | 日本円 | 85,989,060 | 85,989,060    | 91,086,000 | 91,086,000    | 0.05    |
| 株価先物取引     | 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(2024年06月限) | 買建    | 262 | 米ドル | 9,153,680  | 1,385,958,688 | 9,122,840  | 1,381,289,197 | 0.81    |

（3）【運用実績】

①【純資産の推移】

のむラップ・ファンド（保守型）

2024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5計算期間     | (2015年 2月18日) | 14,449     | 14,460 | 1.3886       | 1.3896 |
| 第6計算期間     | (2016年 2月18日) | 21,912     | 21,929 | 1.3443       | 1.3453 |
| 第7計算期間     | (2017年 2月20日) | 30,711     | 30,733 | 1.3697       | 1.3707 |
| 第8計算期間     | (2018年 2月19日) | 35,454     | 35,480 | 1.4018       | 1.4028 |
| 第9計算期間     | (2019年 2月18日) | 40,084     | 40,112 | 1.4138       | 1.4148 |
| 第10計算期間    | (2020年 2月18日) | 42,494     | 42,523 | 1.4787       | 1.4797 |
| 第11計算期間    | (2021年 2月18日) | 41,691     | 41,719 | 1.5157       | 1.5167 |
| 第12計算期間    | (2022年 2月18日) | 48,732     | 48,763 | 1.5470       | 1.5480 |
| 第13計算期間    | (2023年 2月20日) | 56,567     | 56,604 | 1.5386       | 1.5396 |
| 第14計算期間    | (2024年 2月19日) | 60,448     | 60,484 | 1.6850       | 1.6860 |
| 2023年 3月末日 |               | 57,515     | —      | 1.5495       | —      |
| 4月末日       |               | 58,210     | —      | 1.5640       | —      |
| 5月末日       |               | 58,679     | —      | 1.5873       | —      |
| 6月末日       |               | 59,810     | —      | 1.6361       | —      |
| 7月末日       |               | 59,298     | —      | 1.6188       | —      |
| 8月末日       |               | 59,638     | —      | 1.6291       | —      |
| 9月末日       |               | 58,789     | —      | 1.6060       | —      |



|            |        |   |        |   |
|------------|--------|---|--------|---|
| 10月末日      | 57,885 | — | 1.5756 | — |
| 11月末日      | 59,618 | — | 1.6356 | — |
| 12月末日      | 59,412 | — | 1.6495 | — |
| 2024年 1月末日 | 59,604 | — | 1.6707 | — |
| 2月末日       | 60,950 | — | 1.6937 | — |
| 3月末日       | 61,955 | — | 1.7158 | — |

### のむラップ・ファンド（やや保守型）

2024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 | (2017年 2月20日) | 1,754      | 1,756  | 1.0428       | 1.0438 |
| 第2計算期間 | (2018年 2月19日) | 2,561      | 2,564  | 1.0771       | 1.0781 |
| 第3計算期間 | (2019年 2月18日) | 3,292      | 3,295  | 1.0905       | 1.0915 |
| 第4計算期間 | (2020年 2月18日) | 4,330      | 4,334  | 1.1619       | 1.1629 |
| 第5計算期間 | (2021年 2月18日) | 4,097      | 4,101  | 1.2108       | 1.2118 |
| 第6計算期間 | (2022年 2月18日) | 6,168      | 6,173  | 1.2645       | 1.2655 |
| 第7計算期間 | (2023年 2月20日) | 7,996      | 8,002  | 1.2751       | 1.2761 |
| 第8計算期間 | (2024年 2月19日) | 10,361     | 10,368 | 1.4380       | 1.4390 |
|        | 2023年 3月末日    | 8,033      | —      | 1.2786       | —      |
|        | 4月末日          | 8,167      | —      | 1.2938       | —      |
|        | 5月末日          | 8,232      | —      | 1.3189       | —      |
|        | 6月末日          | 8,610      | —      | 1.3704       | —      |
|        | 7月末日          | 8,789      | —      | 1.3595       | —      |
|        | 8月末日          | 8,960      | —      | 1.3727       | —      |
|        | 9月末日          | 8,929      | —      | 1.3504       | —      |
|        | 10月末日         | 8,771      | —      | 1.3229       | —      |
|        | 11月末日         | 9,294      | —      | 1.3812       | —      |
|        | 12月末日         | 9,813      | —      | 1.3956       | —      |
|        | 2024年 1月末日    | 10,111     | —      | 1.4222       | —      |
|        | 2月末日          | 10,563     | —      | 1.4469       | —      |
|        | 3月末日          | 10,918     | —      | 1.4722       | —      |

### のむラップ・ファンド（普通型）

2024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5計算期間  | (2015年 2月18日) | 21,005     | 21,017 | 1.7185       | 1.7195 |
| 第6計算期間  | (2016年 2月18日) | 37,150     | 37,173 | 1.5776       | 1.5786 |
| 第7計算期間  | (2017年 2月20日) | 45,690     | 45,717 | 1.6899       | 1.6909 |
| 第8計算期間  | (2018年 2月19日) | 58,457     | 58,490 | 1.7636       | 1.7646 |
| 第9計算期間  | (2019年 2月18日) | 75,805     | 75,847 | 1.7954       | 1.7964 |
| 第10計算期間 | (2020年 2月18日) | 92,176     | 92,223 | 1.9561       | 1.9571 |

|         |               |         |         |        |        |
|---------|---------------|---------|---------|--------|--------|
| 第11計算期間 | (2021年 2月18日) | 103,707 | 103,757 | 2.0652 | 2.0662 |
| 第12計算期間 | (2022年 2月18日) | 163,445 | 163,518 | 2.2197 | 2.2207 |
| 第13計算期間 | (2023年 2月20日) | 241,990 | 242,096 | 2.2751 | 2.2761 |
| 第14計算期間 | (2024年 2月19日) | 346,117 | 346,248 | 2.6405 | 2.6415 |
|         | 2023年 3月末日    | 247,361 | —       | 2.2680 | —      |
|         | 4月末日          | 254,169 | —       | 2.3020 | —      |
|         | 5月末日          | 262,247 | —       | 2.3567 | —      |
|         | 6月末日          | 278,013 | —       | 2.4698 | —      |
|         | 7月末日          | 282,889 | —       | 2.4591 | —      |
|         | 8月末日          | 294,263 | —       | 2.4878 | —      |
|         | 9月末日          | 295,774 | —       | 2.4422 | —      |
|         | 10月末日         | 294,241 | —       | 2.3849 | —      |
|         | 11月末日         | 311,188 | —       | 2.5057 | —      |
|         | 12月末日         | 317,232 | —       | 2.5389 | —      |
|         | 2024年 1月末日    | 334,677 | —       | 2.6028 | —      |
|         | 2月末日          | 353,208 | —       | 2.6599 | —      |
|         | 3月末日          | 371,492 | —       | 2.7196 | —      |

### のむラップ・ファンド（やや積極型）

2024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 | (2017年 2月20日) | 448        | 448    | 1.0761       | 1.0771 |
| 第2計算期間 | (2018年 2月19日) | 1,565      | 1,566  | 1.1287       | 1.1297 |
| 第3計算期間 | (2019年 2月18日) | 2,229      | 2,231  | 1.1485       | 1.1495 |
| 第4計算期間 | (2020年 2月18日) | 3,070      | 3,072  | 1.2717       | 1.2727 |
| 第5計算期間 | (2021年 2月18日) | 4,445      | 4,448  | 1.3517       | 1.3527 |
| 第6計算期間 | (2022年 2月18日) | 8,492      | 8,497  | 1.4851       | 1.4861 |
| 第7計算期間 | (2023年 2月20日) | 14,003     | 14,012 | 1.5475       | 1.5485 |
| 第8計算期間 | (2024年 2月19日) | 25,236     | 25,249 | 1.8748       | 1.8758 |
|        | 2023年 3月末日    | 14,487     | —      | 1.5326       | —      |
|        | 4月末日          | 15,062     | —      | 1.5616       | —      |
|        | 5月末日          | 15,583     | —      | 1.6089       | —      |
|        | 6月末日          | 16,633     | —      | 1.7042       | —      |
|        | 7月末日          | 17,149     | —      | 1.7063       | —      |
|        | 8月末日          | 18,117     | —      | 1.7310       | —      |
|        | 9月末日          | 18,448     | —      | 1.6939       | —      |
|        | 10月末日         | 18,424     | —      | 1.6470       | —      |
|        | 11月末日         | 20,106     | —      | 1.7470       | —      |
|        | 12月末日         | 21,215     | —      | 1.7757       | —      |
|        | 2024年 1月末日    | 23,517     | —      | 1.8389       | —      |
|        | 2月末日          | 26,307     | —      | 1.8924       | —      |
|        | 3月末日          | 28,544     | —      | 1.9490       | —      |

## のむラップ・ファンド（積極型）

2024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5計算期間  | (2015年 2月18日) | 12,370     | 12,377  | 1.8855       | 1.8865 |
| 第6計算期間  | (2016年 2月18日) | 15,939     | 15,949  | 1.6702       | 1.6712 |
| 第7計算期間  | (2017年 2月20日) | 19,026     | 19,036  | 1.8662       | 1.8672 |
| 第8計算期間  | (2018年 2月19日) | 22,241     | 22,253  | 1.9744       | 1.9754 |
| 第9計算期間  | (2019年 2月18日) | 26,325     | 26,338  | 2.0233       | 2.0243 |
| 第10計算期間 | (2020年 2月18日) | 32,358     | 32,372  | 2.2782       | 2.2792 |
| 第11計算期間 | (2021年 2月18日) | 39,717     | 39,733  | 2.4423       | 2.4433 |
| 第12計算期間 | (2022年 2月18日) | 73,291     | 73,317  | 2.7430       | 2.7440 |
| 第13計算期間 | (2023年 2月20日) | 119,576    | 119,617 | 2.8906       | 2.8916 |
| 第14計算期間 | (2024年 2月19日) | 196,873    | 196,928 | 3.5767       | 3.5777 |
|         | 2023年 3月末日    | 121,427    | —       | 2.8524       | —      |
|         | 4月末日          | 124,615    | —       | 2.9125       | —      |
|         | 5月末日          | 128,168    | —       | 3.0109       | —      |
|         | 6月末日          | 137,652    | —       | 3.2054       | —      |
|         | 7月末日          | 142,466    | —       | 3.2206       | —      |
|         | 8月末日          | 150,182    | —       | 3.2687       | —      |
|         | 9月末日          | 152,317    | —       | 3.1924       | —      |
|         | 10月末日         | 152,391    | —       | 3.0949       | —      |
|         | 11月末日         | 163,609    | —       | 3.3000       | —      |
|         | 12月末日         | 168,262    | —       | 3.3612       | —      |
|         | 2024年 1月末日    | 185,598    | —       | 3.4976       | —      |
|         | 2月末日          | 205,179    | —       | 3.6144       | —      |
|         | 3月末日          | 221,853    | —       | 3.7346       | —      |

## ②【分配の推移】

## のむラップ・ファンド（保守型）

|         | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|---------|-------------------------|-----------|
| 第5計算期間  | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第6計算期間  | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第7計算期間  | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第8計算期間  | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 0.0010円   |
| 第9計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 0.0010円   |

## のむラップ・ファンド（やや保守型）

|        | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|--------|-------------------------|-----------|
| 第1計算期間 | 2016年11月11日～2017年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第2計算期間 | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 0.0010円   |
| 第3計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第4計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第5計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第6計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第7計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第8計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 0.0010円   |

## のむラップ・ファンド（普通型）

|         | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|---------|-------------------------|-----------|
| 第5計算期間  | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第6計算期間  | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第7計算期間  | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第8計算期間  | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 0.0010円   |
| 第9計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 0.0010円   |

## のむラップ・ファンド（やや積極型）

|        | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|--------|-------------------------|-----------|
| 第1計算期間 | 2016年11月11日～2017年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第2計算期間 | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 0.0010円   |
| 第3計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第4計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第5計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第6計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第7計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第8計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 0.0010円   |

## のむラップ・ファンド（積極型）

|        | 計算期間                    | 1口当たりの分配金 |
|--------|-------------------------|-----------|
| 第5計算期間 | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第6計算期間 | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | 0.0010円   |
| 第7計算期間 | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 0.0010円   |
| 第8計算期間 | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 0.0010円   |
| 第9計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.0010円   |

|         |                         |         |
|---------|-------------------------|---------|
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 0.0010円 |
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 0.0010円 |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 0.0010円 |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 0.0010円 |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 0.0010円 |

### ③【収益率の推移】

#### のむラップ・ファンド（保守型）

|         | 計算期間                    | 収益率   |
|---------|-------------------------|-------|
| 第5計算期間  | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 11.6% |
| 第6計算期間  | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | △3.1% |
| 第7計算期間  | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 2.0%  |
| 第8計算期間  | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 2.4%  |
| 第9計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 0.9%  |
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 4.7%  |
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 2.6%  |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 2.1%  |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | △0.5% |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 9.6%  |

※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。

#### のむラップ・ファンド（やや保守型）

|        | 計算期間                    | 収益率   |
|--------|-------------------------|-------|
| 第1計算期間 | 2016年11月11日～2017年 2月20日 | 4.4%  |
| 第2計算期間 | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 3.4%  |
| 第3計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 1.3%  |
| 第4計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 6.6%  |
| 第5計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 4.3%  |
| 第6計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 4.5%  |
| 第7計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 0.9%  |
| 第8計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 12.9% |

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

#### のむラップ・ファンド（普通型）

|         | 計算期間                    | 収益率   |
|---------|-------------------------|-------|
| 第5計算期間  | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 19.7% |
| 第6計算期間  | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | △8.1% |
| 第7計算期間  | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 7.2%  |
| 第8計算期間  | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 4.4%  |
| 第9計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 1.9%  |
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 9.0%  |

|         |                         |       |
|---------|-------------------------|-------|
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 5.6%  |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 7.5%  |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 2.5%  |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 16.1% |

※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。

#### のむラップ・ファンド（やや積極型）

|        | 計算期間                    | 収益率   |
|--------|-------------------------|-------|
| 第1計算期間 | 2016年11月11日～2017年 2月20日 | 7.7%  |
| 第2計算期間 | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 5.0%  |
| 第3計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 1.8%  |
| 第4計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 10.8% |
| 第5計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 6.4%  |
| 第6計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 9.9%  |
| 第7計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 4.3%  |
| 第8計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 21.2% |

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

#### のむラップ・ファンド（積極型）

|         | 計算期間                    | 収益率    |
|---------|-------------------------|--------|
| 第5計算期間  | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 23.1%  |
| 第6計算期間  | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | △11.4% |
| 第7計算期間  | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 11.8%  |
| 第8計算期間  | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 5.9%   |
| 第9計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 2.5%   |
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 12.6%  |
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 7.2%   |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 12.4%  |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 5.4%   |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 23.8%  |

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

#### （４）【設定及び解約の実績】

#### のむラップ・ファンド（保守型）

|        | 計算期間                    | 設定口数           | 解約口数          | 発行済み口数         |
|--------|-------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 第5計算期間 | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 5,232,995,552  | 2,719,491,723 | 10,405,764,623 |
| 第6計算期間 | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | 8,647,464,358  | 2,752,459,905 | 16,300,769,076 |
| 第7計算期間 | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 10,074,422,211 | 3,953,141,382 | 22,422,049,905 |
| 第8計算期間 | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 8,245,634,392  | 5,375,777,007 | 25,291,907,290 |
| 第9計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 6,683,674,568  | 3,622,632,363 | 28,352,949,495 |

|         |                         |               |               |                |
|---------|-------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 7,256,673,085 | 6,871,185,722 | 28,738,436,858 |
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 5,853,220,978 | 7,084,358,604 | 27,507,299,232 |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 9,295,649,362 | 5,302,580,330 | 31,500,368,264 |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 9,157,557,507 | 3,892,291,676 | 36,765,634,095 |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 8,063,758,613 | 8,955,389,673 | 35,874,003,035 |

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### のむラップ・ファンド（やや保守型）

|        | 計算期間                    | 設定口数          | 解約口数          | 発行済み口数        |
|--------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|
| 第1計算期間 | 2016年11月11日～2017年 2月20日 | 1,683,928,835 | 1,075,577     | 1,682,853,258 |
| 第2計算期間 | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 1,216,556,735 | 520,704,097   | 2,378,705,896 |
| 第3計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 827,317,233   | 187,003,223   | 3,019,019,906 |
| 第4計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 1,362,550,967 | 654,402,581   | 3,727,168,292 |
| 第5計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 1,382,305,912 | 1,725,139,133 | 3,384,335,071 |
| 第6計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 2,299,623,862 | 805,460,496   | 4,878,498,437 |
| 第7計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 2,060,079,927 | 667,367,425   | 6,271,210,939 |
| 第8計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 2,295,351,129 | 1,361,195,557 | 7,205,366,511 |

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### のむラップ・ファンド（普通型）

|         | 計算期間                    | 設定口数           | 解約口数           | 発行済み口数          |
|---------|-------------------------|----------------|----------------|-----------------|
| 第5計算期間  | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 6,938,730,583  | 2,513,534,586  | 12,222,832,693  |
| 第6計算期間  | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | 14,624,481,293 | 3,298,164,142  | 23,549,149,844  |
| 第7計算期間  | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 8,370,562,015  | 4,882,793,242  | 27,036,918,617  |
| 第8計算期間  | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 13,898,310,644 | 7,788,778,406  | 33,146,450,855  |
| 第9計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 14,762,704,987 | 5,687,029,247  | 42,222,126,595  |
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 17,015,753,904 | 12,114,213,571 | 47,123,666,928  |
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 17,367,085,936 | 14,274,396,250 | 50,216,356,614  |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 35,642,462,288 | 12,225,527,102 | 73,633,291,800  |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 42,856,076,867 | 10,124,771,864 | 106,364,596,803 |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 50,685,178,559 | 25,969,844,276 | 131,079,931,086 |

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### のむラップ・ファンド（やや積極型）

|        | 計算期間                    | 設定口数          | 解約口数          | 発行済み口数         |
|--------|-------------------------|---------------|---------------|----------------|
| 第1計算期間 | 2016年11月11日～2017年 2月20日 | 418,434,475   | 2,119,224     | 416,315,251    |
| 第2計算期間 | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 1,136,667,950 | 165,912,216   | 1,387,070,985  |
| 第3計算期間 | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 748,002,975   | 193,991,442   | 1,941,082,518  |
| 第4計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 1,250,105,711 | 776,826,920   | 2,414,361,309  |
| 第5計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 1,873,074,115 | 998,933,831   | 3,288,501,593  |
| 第6計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 3,455,675,677 | 1,026,066,157 | 5,718,111,113  |
| 第7計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 4,165,589,208 | 834,803,538   | 9,048,896,783  |
| 第8計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 6,537,129,017 | 2,125,161,213 | 13,460,864,587 |

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。

のむラップ・ファンド（積極型）

|         | 計算期間                    | 設定口数           | 解約口数           | 発行済み口数         |
|---------|-------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 第5計算期間  | 2014年 2月19日～2015年 2月18日 | 3,164,392,511  | 1,768,791,397  | 6,561,006,765  |
| 第6計算期間  | 2015年 2月19日～2016年 2月18日 | 4,833,876,039  | 1,851,238,866  | 9,543,643,938  |
| 第7計算期間  | 2016年 2月19日～2017年 2月20日 | 2,890,629,040  | 2,239,285,849  | 10,194,987,129 |
| 第8計算期間  | 2017年 2月21日～2018年 2月19日 | 4,305,044,963  | 3,234,715,551  | 11,265,316,541 |
| 第9計算期間  | 2018年 2月20日～2019年 2月18日 | 4,187,189,703  | 2,441,328,586  | 13,011,177,658 |
| 第10計算期間 | 2019年 2月19日～2020年 2月18日 | 5,773,245,162  | 4,580,921,634  | 14,203,501,186 |
| 第11計算期間 | 2020年 2月19日～2021年 2月18日 | 7,849,562,545  | 5,791,022,042  | 16,262,041,689 |
| 第12計算期間 | 2021年 2月19日～2022年 2月18日 | 15,921,073,680 | 5,463,445,749  | 26,719,669,620 |
| 第13計算期間 | 2022年 2月19日～2023年 2月20日 | 19,997,678,152 | 5,349,774,563  | 41,367,573,209 |
| 第14計算期間 | 2023年 2月21日～2024年 2月19日 | 27,293,740,542 | 13,617,566,809 | 55,043,746,942 |

※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》



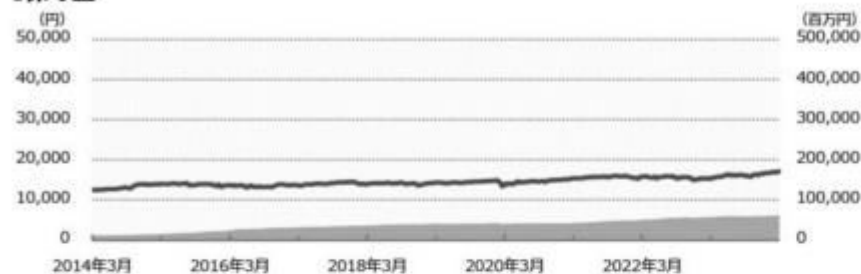


# 運用実績（2024年3月29日現在）

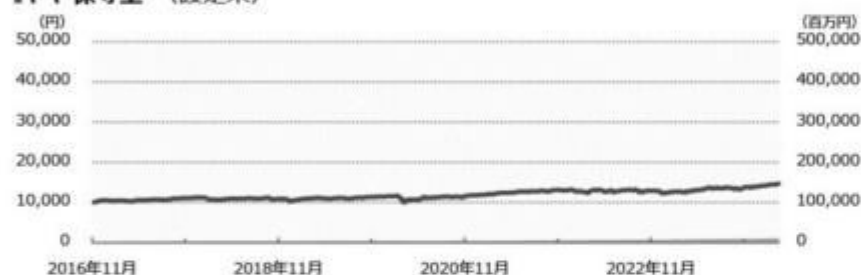
## ■ 基準価額・純資産の推移（日次）

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） — 純資産総額（右軸）

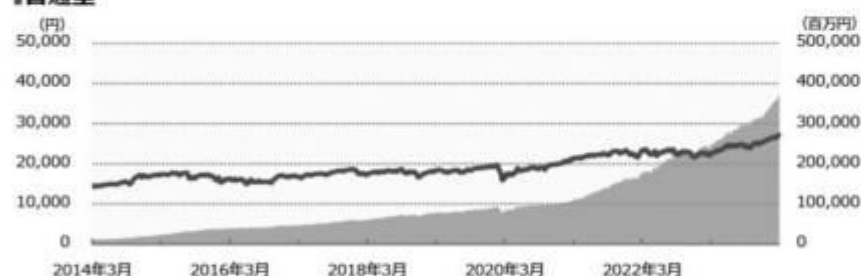
### Ⅰ保守型



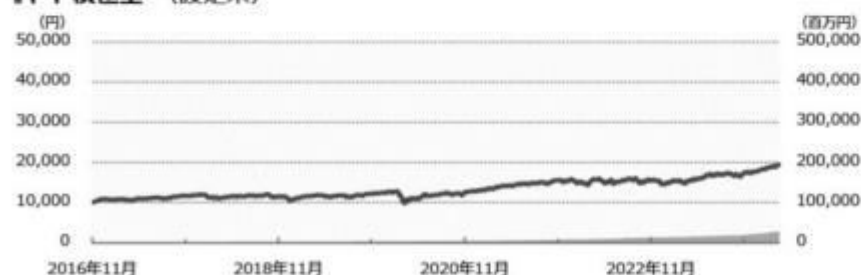
### Ⅱやや保守型（設定来）



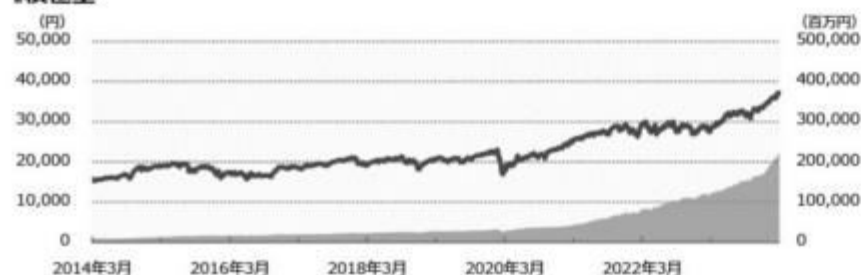
### Ⅲ普通型



### Ⅳやや積極型（設定来）



### Ⅴ積極型



## ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

### Ⅰ保守型

|         |       |
|---------|-------|
| 2024年2月 | 10 円  |
| 2023年2月 | 10 円  |
| 2022年2月 | 10 円  |
| 2021年2月 | 10 円  |
| 2020年2月 | 10 円  |
| 設定来累計   | 120 円 |

### Ⅱやや保守型

|         |      |
|---------|------|
| 2024年2月 | 10 円 |
| 2023年2月 | 10 円 |
| 2022年2月 | 10 円 |
| 2021年2月 | 10 円 |
| 2020年2月 | 10 円 |
| 設定来累計   | 80 円 |

### Ⅲ普通型

|         |       |
|---------|-------|
| 2024年2月 | 10 円  |
| 2023年2月 | 10 円  |
| 2022年2月 | 10 円  |
| 2021年2月 | 10 円  |
| 2020年2月 | 10 円  |
| 設定来累計   | 130 円 |

### Ⅳやや積極型

|         |      |
|---------|------|
| 2024年2月 | 10 円 |
| 2023年2月 | 10 円 |
| 2022年2月 | 10 円 |
| 2021年2月 | 10 円 |
| 2020年2月 | 10 円 |
| 設定来累計   | 80 円 |

### Ⅴ積極型

|         |       |
|---------|-------|
| 2024年2月 | 10 円  |
| 2023年2月 | 10 円  |
| 2022年2月 | 10 円  |
| 2021年2月 | 10 円  |
| 2020年2月 | 10 円  |
| 設定来累計   | 130 円 |

## ■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

|                          | 投資比率 (%) |       |      |       |      |
|--------------------------|----------|-------|------|-------|------|
|                          | 保守型      | やや保守型 | 普通型  | やや積極型 | 積極型  |
| 国内株式マザーファンド              | 7.4      | 8.8   | 11.1 | 13.2  | 10.0 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 47.5     | 33.6  | 23.4 | 7.9   | 4.6  |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド  | 13.0     | 18.5  | 25.5 | 39.3  | 53.4 |
| 外国債券マザーファンド              | 23.6     | 28.8  | 26.7 | 23.8  | 16.5 |
| 世界REITインデックス マザーファンド     | 7.3      | 9.1   | 12.1 | 14.3  | 14.2 |

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 (%) |       |     |       |     |
|----|-------------------|-------|----------|-------|-----|-------|-----|
|    |                   |       | 保守型      | やや保守型 | 普通型 | やや積極型 | 積極型 |
| 1  | トヨタ自動車            | 輸送用機器 | 0.4      | 0.5   | 0.6 | 0.7   | 0.5 |
| 2  | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業   | 0.2      | 0.2   | 0.3 | 0.3   | 0.2 |
| 3  | ソニーグループ           | 電気機器  | 0.2      | 0.2   | 0.3 | 0.3   | 0.2 |
| 4  | 東京エレクトロン          | 電気機器  | 0.2      | 0.2   | 0.2 | 0.3   | 0.2 |
| 5  | 三菱商事              | 卸売業   | 0.1      | 0.2   | 0.2 | 0.2   | 0.2 |

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄                | 種類   | 投資比率 (%) |       |     |       |     |
|----|-------------------|------|----------|-------|-----|-------|-----|
|    |                   |      | 保守型      | やや保守型 | 普通型 | やや積極型 | 積極型 |
| 1  | 国庫債券 利付（2年）第452回  | 国債証券 | 1.2      | 0.8   | 0.6 | 0.2   | 0.1 |
| 2  | 国庫債券 利付（2年）第453回  | 国債証券 | 1.1      | 0.8   | 0.5 | 0.2   | 0.1 |
| 3  | 国庫債券 利付（2年）第455回  | 国債証券 | 0.6      | 0.4   | 0.3 | 0.1   | 0.1 |
| 4  | 国庫債券 利付（10年）第370回 | 国債証券 | 0.6      | 0.4   | 0.3 | 0.1   | 0.1 |
| 5  | 国庫債券 利付（5年）第163回  | 国債証券 | 0.5      | 0.4   | 0.3 | 0.1   | 0.1 |

・「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 (%) |       |     |       |     |
|----|----------------------------|----------------------|----------|-------|-----|-------|-----|
|    |                            |                      | 保守型      | やや保守型 | 普通型 | やや積極型 | 積極型 |
| 1  | MICROSOFT CORP             | ソフトウェア               | 0.6      | 0.9   | 1.2 | 1.9   | 2.6 |
| 2  | APPLE INC                  | コンピュータ・周辺機器          | 0.5      | 0.8   | 1.0 | 1.6   | 2.2 |
| 3  | NVIDIA CORP                | 半導体・半導体製造装置          | 0.5      | 0.7   | 0.9 | 1.4   | 1.9 |
| 4  | AMAZON.COM INC             | 大規模小売り               | 0.4      | 0.5   | 0.7 | 1.1   | 1.4 |
| 5  | META PLATFORMS INC-CLASS A | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.2      | 0.3   | 0.4 | 0.7   | 0.9 |

・「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 (%) |       |     |       |     |
|----|------------------|------|----------|-------|-----|-------|-----|
|    |                  |      | 保守型      | やや保守型 | 普通型 | やや積極型 | 積極型 |
| 1  | US TREASURY N/B  | 国債証券 | 0.4      | 0.5   | 0.4 | 0.4   | 0.3 |
| 2  | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.4      | 0.4   | 0.4 | 0.4   | 0.3 |
| 3  | US TREASURY N/B  | 国債証券 | 0.4      | 0.4   | 0.4 | 0.4   | 0.3 |
| 4  | US TREASURY N/B  | 国債証券 | 0.3      | 0.4   | 0.4 | 0.3   | 0.2 |
| 5  | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.3      | 0.4   | 0.3 | 0.3   | 0.2 |

・「世界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 (%) |       |     |       |     |
|----|--------------------------|------|----------|-------|-----|-------|-----|
|    |                          |      | 保守型      | やや保守型 | 普通型 | やや積極型 | 積極型 |
| 1  | PROLOGIS INC             | 投資証券 | 0.6      | 0.7   | 1.0 | 1.2   | 1.2 |
| 2  | EQUINIX INC              | 投資証券 | 0.4      | 0.5   | 0.6 | 0.8   | 0.7 |
| 3  | WELLTOWER INC            | 投資証券 | 0.3      | 0.3   | 0.4 | 0.5   | 0.5 |
| 4  | SIMON PROPERTY GROUP INC | 投資証券 | 0.3      | 0.3   | 0.4 | 0.5   | 0.5 |
| 5  | PUBLIC STORAGE           | 投資証券 | 0.2      | 0.3   | 0.4 | 0.4   | 0.4 |

## ■ 年間収益率の推移（暦年ベース）

### ■ 保守型



### ■ やや保守型



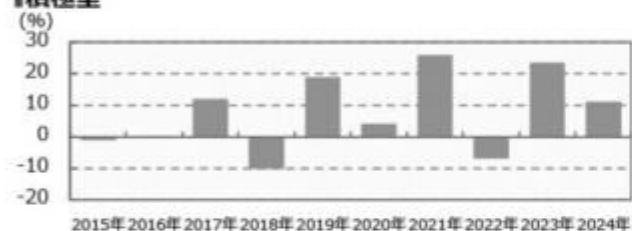
### ■ 普通型



### ■ やや積極型



### ■ 積極型



- ・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。
- ・『(やや保守型)』『(やや積極型)』の2016年は設定日（2016年11月11日）から年末までの収益率。
- ・2024年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### (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。

販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

## (2)申込締切時間

午後3時までにて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。

（注）2024年11月5日以降は以下に変更となる予定です。

原則、午後3時30分までにて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。

（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)購入コース

分配金を受取る「一般コース」と、分配金が再投資される「自動けいぞく投資コース」があります。販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。また、原則として、お買付け後のコース変更はできません。

## (4)販売単位

「一般コース」の場合は1万口以上1万口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1万円以上1円単位とします。ただし、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

## (5)販売価額

取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

## (6)申込代金の支払い

取得申込日から起算して5営業日目までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。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。

## (7)スイッチング

各ファンド間でスイッチングができます。

スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

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

なお、販売会社によっては「（年3%目標払出）のむラップ・ファンド（普通型）」「（年6%目標払出）のむラップ・ファンド（普通型）」の換金代金をもって、各ファンドへのスイッチングが可能です。

## (8)積立方式

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

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

## (9)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、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込み(スイッチングの申込みを含みます。)の受付けを中止することおよび既に受付けた取得申込み(スイッチングの申込みを含みます。)の受付けを取り消す場合があります。

#### (10)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/>**

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

## 2【換金（解約）手続等】

### (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。

（注）2024年11月5日以降は以下に変更となる予定です。

一部解約の実行の請求の受け付けについては、原則、午後3時30分までに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。

（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)換金単位

「一般コース」の場合は1万口単位、1口単位または1円単位、「自動けいぞく投資コース」の場合は1円単位または1口単位で換金できます。

### (4)換金価額

換金のお申込み日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

**(5)換金制限**

信託財産の資金管理を円滑に行なうため、1日1件10億円を超える一部解約は行なえません。また、別途、大口換金について、1日1件10億円以下の金額であっても、ファンドの残高、市場の流動性の状況等によっては、委託者の判断により一部解約の金額に制限を設ける場合や一部解約の実行の請求の受付時間に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5営業日目から販売会社において支払います。

**(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、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、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既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、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとしします。

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

| 対象 | 評価方法                                             |
|----|--------------------------------------------------|
| 株式 | 原則として、基準価額計算日 <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>①日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)<br>②金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く)<br>③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。

(保守型、普通型、積極型：2010年3月15日設定)

(やや保守型、やや積極型：2016年11月11日設定)

## (4) 【計算期間】

原則として、毎年2月19日から翌年2月18日までとします。

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

## (5) 【その他】

### (a) ファンドの繰上償還条項

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

### (b) 信託期間の終了

(i) 委託者は、上記「(a) ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議

(以下「書面決議」といいます。)を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

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

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

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

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

#### (c)運用報告書

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

#### (d)信託約款の変更等

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

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

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

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



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

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

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

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

#### 4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

① 収益分配金に対する請求権

■ 収益分配金の支払い開始日 ■

< 自動けいぞく投資契約を結んでいない場合 >

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

売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

＜自動けいぞく投資契約を結んでいる場合＞

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

■収益分配金請求権の失効■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

②償還金に対する請求権

■償還金の支払い開始日■

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

■償還金請求権の失効■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

③換金(解約)請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

のむラップ・ファンド（保守型）

のむラップ・ファンド（普通型）

のむラップ・ファンド（積極型）

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間(2023年2月21日から2024年2月19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。

のむラップ・ファンド（やや保守型）

のむラップ・ファンド（やや積極型）

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間(2023年2月21日から2024年2月19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】

## 【のむラップ・ファンド（保守型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第13期<br>(2023年 2月20日現在) | 第14期<br>(2024年 2月19日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部            |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 998,076,425             | 1,179,801,642           |
| 親投資信託受益証券       | 56,013,229,733          | 59,741,676,269          |
| 流動資産合計          | 57,011,306,158          | 60,921,477,911          |
| 資産合計            | 57,011,306,158          | 60,921,477,911          |
| 負債の部            |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払収益分配金         | 36,765,634              | 35,874,003              |
| 未払解約金           | 71,233,414              | 78,526,067              |
| 未払受託者報酬         | 9,307,135               | 9,923,036               |
| 未払委託者報酬         | 325,749,695             | 347,306,243             |
| 未払利息            | 206                     | 124                     |
| その他未払費用         | 930,644                 | 992,238                 |
| 流動負債合計          | 443,986,728             | 472,621,711             |
| 負債合計            | 443,986,728             | 472,621,711             |
| 純資産の部           |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 36,765,634,095          | 35,874,003,035          |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 19,801,685,335          | 24,574,853,165          |
| （分配準備積立金）       | 3,344,929,514           | 6,720,373,992           |
| 元本等合計           | 56,567,319,430          | 60,448,856,200          |
| 純資産合計           | 56,567,319,430          | 60,448,856,200          |
| 負債純資産合計         | 57,011,306,158          | 60,921,477,911          |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-------------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                        |                                        |
| 受取利息                                      | -                                      | 80                                     |
| 有価証券売買等損益                                 | 295,097,839                            | 6,077,967,537                          |
| 営業収益合計                                    | 295,097,839                            | 6,077,967,617                          |
| 営業費用                                      |                                        |                                        |
| 支払利息                                      | 195,141                                | 287,635                                |
| 受託者報酬                                     | 17,723,998                             | 19,362,580                             |
| 委託者報酬                                     | 620,339,831                            | 677,690,340                            |
| その他費用                                     | 1,772,273                              | 1,936,132                              |
| 営業費用合計                                    | 640,031,243                            | 699,276,687                            |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | △344,933,404                           | 5,378,690,930                          |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | △344,933,404                           | 5,378,690,930                          |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | △344,933,404                           | 5,378,690,930                          |
| 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（△） | 57,851,487                             | 631,544,132                            |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 17,231,738,113                         | 19,801,685,335                         |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 5,134,209,395                          | 4,917,582,991                          |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 5,134,209,395                          | 4,917,582,991                          |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 2,124,711,648                          | 4,855,687,956                          |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 2,124,711,648                          | 4,855,687,956                          |
| 分配金                                       | 36,765,634                             | 35,874,003                             |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 19,801,685,335                         | 24,574,853,165                         |

## (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          | 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る場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4.その他                 | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2023年 2月21日から2024年 2月19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13期<br>2023年 2月20日現在                                                         | 第14期<br>2024年 2月19日現在                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>36,765,634,095口                                       | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>35,874,003,035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 1.5386円<br>(10,000口当たり純資産額) (15,386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 1.6850円<br>(10,000口当たり純資産額) (16,850円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 |              |                 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |              |                 |
|----------------------------------------|--------------|-----------------|----------------------------------------|--------------|-----------------|
| 1. 分配金の計算過程                            |              |                 | 1. 分配金の計算過程                            |              |                 |
| 項目                                     |              |                 | 項目                                     |              |                 |
| 費用控除後の配当等収益額                           | A            | 400,290,624円    | 費用控除後の配当等収益額                           | A            | 954,701,965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              | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額              | B            | 3,163,866,788円  |
| 収益調整金額                                 | C            | 16,456,755,821円 | 収益調整金額                                 | C            | 17,854,479,173円 |
| 分配準備積立金額                               | D            | 2,981,404,524円  | 分配準備積立金額                               | D            | 2,637,679,242円  |
| 当ファンドの分配対象収益額                          | E=A+B+C+D    | 19,838,450,969円 | 当ファンドの分配対象収益額                          | E=A+B+C+D    | 24,610,727,168円 |
| 当ファンドの期末残存口数                           | F            | 36,765,634,095口 | 当ファンドの期末残存口数                           | F            | 35,874,003,035口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額                      | G=E/F×10,000 | 5,395円          | 10,000口当たり収益分配対象額                      | G=E/F×10,000 | 6,860円          |
| 10,000口当たり分配金額                         | H            | 10円             | 10,000口当たり分配金額                         | H            | 10円             |
| 収益分配金金額                                | I=F×H/10,000 | 36,765,634円     | 収益分配金金額                                | I=F×H/10,000 | 35,874,003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13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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、(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>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</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13期<br>2023年 2月20日現在                                                                                                                       | 第14期<br>2024年 2月19日現在    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                | 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>同左 |
| 2. 時価の算定方法<br>親投資信託受益証券<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。<br>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。 | 2. 時価の算定方法<br>同左         |

## （関連当事者との取引に関する注記）

| 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 期首元本額 31,500,368,264円                  | 期首元本額 36,765,634,095円                  |
| 期中追加設定元本額 9,157,557,507円               | 期中追加設定元本額 8,063,758,613円               |
| 期中一部解約元本額 3,892,291,676円               | 期中一部解約元本額 8,955,389,673円               |

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

| 種類        | 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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 | 186,799,999                            | 5,262,110,871                          |
| 合計        | 186,799,999                            | 5,262,110,871                          |

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式(2024年2月19日現在)

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券(2024年2月19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             | 1,584,515,212  | 4,661,168,399            |    |
|           |     | 外国債券マザーファンド             | 4,922,234,127  | 14,185,878,754           |    |
|           |     | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 1,215,485,817  | 7,763,794,107            |    |
|           |     | 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 22,888,034,243 | 28,811,457,505           |    |
|           |     | 世界REITインデックスマザーファンド     | 1,614,780,928  | 4,319,377,504            |    |
|           | 小計  | 銘柄数：5<br>組入時価比率：98.8%   | 32,225,050,327 | 59,741,676,269<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                         |                | 59,741,676,269           |    |

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



## 【のむラップ・ファンド（やや保守型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第7期<br>(2023年 2月20日現在) | 第8期<br>(2024年 2月19日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部            |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 144,757,900            | 192,306,633            |
| 親投資信託受益証券       | 7,909,326,340          | 10,255,465,678         |
| 流動資産合計          | 8,054,084,240          | 10,447,772,311         |
| 資産合計            | 8,054,084,240          | 10,447,772,311         |
| 負債の部            |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 未払収益分配金         | 6,271,210              | 7,205,366              |
| 未払解約金           | 1,486,751              | 19,244,822             |
| 未払受託者報酬         | 1,292,203              | 1,561,020              |
| 未払委託者報酬         | 48,457,552             | 58,538,522             |
| 未払利息            | 29                     | 20                     |
| その他未払費用         | 129,165                | 156,042                |
| 流動負債合計          | 57,636,910             | 86,705,792             |
| 負債合計            | 57,636,910             | 86,705,792             |
| 純資産の部           |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 6,271,210,939          | 7,205,366,511          |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 1,725,236,391          | 3,155,700,008          |
| （分配準備積立金）       | 441,780,405            | 1,318,809,266          |
| 元本等合計           | 7,996,447,330          | 10,361,066,519         |
| 純資産合計           | 7,996,447,330          | 10,361,066,519         |
| 負債純資産合計         | 8,054,084,240          | 10,447,772,311         |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                       |
| 受取利息                                      | -                                     | 14                                    |
| 有価証券売買等損益                                 | 137,769,145                           | 1,189,563,338                         |
| 営業収益合計                                    | 137,769,145                           | 1,189,563,352                         |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 支払利息                                      | 27,768                                | 44,124                                |
| 受託者報酬                                     | 2,402,792                             | 2,906,459                             |
| 委託者報酬                                     | 90,104,389                            | 108,992,508                           |
| その他費用                                     | 240,165                               | 290,524                               |
| 営業費用合計                                    | 92,775,114                            | 112,233,615                           |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 44,994,031                            | 1,077,329,737                         |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 44,994,031                            | 1,077,329,737                         |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 44,994,031                            | 1,077,329,737                         |
| 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（△） | 15,488,903                            | 83,862,888                            |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 1,290,244,305                         | 1,725,236,391                         |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 589,241,208                           | 826,466,287                           |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 589,241,208                           | 826,466,287                           |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 177,483,040                           | 382,264,153                           |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 177,483,040                           | 382,264,153                           |
| 分配金                                       | 6,271,210                             | 7,205,366                             |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 1,725,236,391                         | 3,155,700,008                         |

## (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              | 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<br>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<br>提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4.その他                     | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2023年 2月21日から2024年 2月<br>19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7期<br>2023年 2月20日現在                                                          | 第8期<br>2024年 2月19日現在                                                          |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>6,271,210,939口                                        | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>7,205,366,511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 1.2751円<br>(10,000口当たり純資産額) (12,751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 1.4380円<br>(10,000口当たり純資産額) (14,380円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 |              |                | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |              |                |
|---------------------------------------|--------------|----------------|---------------------------------------|--------------|----------------|
| 1. 分配金の計算過程                           |              |                | 1. 分配金の計算過程                           |              |                |
| 項目                                    |              |                | 項目                                    |              |                |
| 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 64,428,672円    | 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 169,761,797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             | 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            | 795,372,457円   |
| 収益調整金額                                | C            | 1,283,455,986円 | 収益調整金額                                | C            | 1,836,890,742円 |
| 分配準備積立金額                              | D            | 383,622,943円   | 分配準備積立金額                              | D            | 360,880,378円   |
| 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 1,731,507,601円 | 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 3,162,905,374円 |
| 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 6,271,210,939口 | 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 7,205,366,511口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額                     | G=E/F×10,000 | 2,761円         | 10,000口当たり収益分配対象額                     | G=E/F×10,000 | 4,389円         |
| 10,000口当たり分配金額                        | H            | 10円            | 10,000口当たり分配金額                        | H            | 10円            |
| 収益分配金金額                               | I=F×H/10,000 | 6,271,210円     | 収益分配金金額                               | I=F×H/10,000 | 7,205,366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7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                                                                             | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針<br>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<br>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<br>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<br>て運用することを目的としております。 | 1.金融商品に対する取組方針<br>同左                  |
| 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク<br>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コー<br>ル・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。                                                  | 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク<br>同左         |
| 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<br>2 有価証券関係に記載しております。                                                                                |                                       |
| これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変<br>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<br>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<br>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<br>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<br>なっております。                                        | 3.金融商品に係るリスク管理体制<br>同左                |
| ○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<br>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<br>す。                                                      |                                       |
| ○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<br>る情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた<br>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<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<br>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

| 第7期<br>2023年 2月20日現在                                                                                                                        | 第8期<br>2024年 2月19日現在     |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                | 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>同左 |
| 2. 時価の算定方法<br>親投資信託受益証券<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。<br>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。 | 2. 時価の算定方法<br>同左         |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                 | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 期首元本額 4,878,498,437円                  | 期首元本額 6,271,210,939円                  |
| 期中追加設定元本額 2,060,079,927円              | 期中追加設定元本額 2,295,351,129円              |
| 期中一部解約元本額 667,367,425円                | 期中一部解約元本額 1,361,195,557円              |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類        | 第7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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 | 109,616,291                           | 1,090,918,159                         |
| 合計        | 109,616,291                           | 1,090,918,159                         |

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式(2024年2月19日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2024年2月19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             | 319,382,402   | 939,527,211              |    |
|           |     | 外国債券マザーファンド             | 1,032,503,514 | 2,975,675,127            |    |
|           |     | 外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド | 296,982,538   | 1,896,946,263            |    |
|           |     | 国内債券NOMURA－BPI総合マザーファンド | 2,784,037,811 | 3,504,546,796            |    |
|           |     | 世界REITインデックスマザーファンド     | 350,955,281   | 938,770,281              |    |
|           | 小計  | 銘柄数：5<br>組入時価比率：99.0%   | 4,783,861,546 | 10,255,465,678<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                         |               | 10,255,465,678           |    |

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【のむラップ・ファンド（普通型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第13期<br>(2023年 2月20日現在) | 第14期<br>(2024年 2月19日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部            |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 4,426,333,857           | 7,032,155,101           |
| 親投資信託受益証券       | 239,418,807,215         | 341,994,197,900         |
| 流動資産合計          | 243,845,141,072         | 349,026,353,001         |
| 資産合計            | 243,845,141,072         | 349,026,353,001         |
| 負債の部            |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払収益分配金         | 106,364,596             | 131,079,931             |
| 未払解約金           | 193,812,851             | 652,250,705             |
| 未払受託者報酬         | 37,831,260              | 51,727,658              |
| 未払委託者報酬         | 1,513,250,320           | 2,069,106,392           |
| 未払利息            | 915                     | 741                     |
| その他未払費用         | 3,783,066               | 5,172,703               |
| 流動負債合計          | 1,855,043,008           | 2,909,338,130           |
| 負債合計            | 1,855,043,008           | 2,909,338,130           |
| 純資産の部           |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 106,364,596,803         | 131,079,931,086         |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 135,625,501,261         | 215,037,083,785         |
| （分配準備積立金）       | 18,791,496,852          | 54,663,295,508          |
| 元本等合計           | 241,990,098,064         | 346,117,014,871         |
| 純資産合計           | 241,990,098,064         | 346,117,014,871         |
| 負債純資産合計         | 243,845,141,072         | 349,026,353,001         |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-------------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                        |                                        |
| 受取利息                                      | -                                      | 371                                    |
| 有価証券売買等損益                                 | 7,131,210,541                          | 47,345,647,785                         |
| 営業収益合計                                    | 7,131,210,541                          | 47,345,648,156                         |
| 営業費用                                      |                                        |                                        |
| 支払利息                                      | 847,327                                | 1,550,572                              |
| 受託者報酬                                     | 68,033,644                             | 94,032,648                             |
| 委託者報酬                                     | 2,721,345,596                          | 3,761,305,918                          |
| その他費用                                     | 6,803,236                              | 9,403,145                              |
| 営業費用合計                                    | 2,797,029,803                          | 3,866,292,283                          |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 4,334,180,738                          | 43,479,355,873                         |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 4,334,180,738                          | 43,479,355,873                         |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 4,334,180,738                          | 43,479,355,873                         |
| 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（△） | 610,591,755                            | 3,827,868,795                          |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 89,811,733,648                         | 135,625,501,261                        |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 54,623,493,359                         | 73,479,972,020                         |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 54,623,493,359                         | 73,479,972,020                         |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 12,426,950,133                         | 33,588,796,643                         |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 12,426,950,133                         | 33,588,796,643                         |
| 分配金                                       | 106,364,596                            | 131,079,931                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 135,625,501,261                        | 215,037,083,785                        |

## (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              | 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<br>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<br>提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4.その他                     | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2023年 2月21日から2024年 2月<br>19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13期<br>2023年 2月20日現在                                                         | 第14期<br>2024年 2月19日現在                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>106,364,596,803口                                      | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>131,079,931,086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 2.2751円<br>(10,000口当たり純資産額) (22,751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 2.6405円<br>(10,000口当たり純資産額) (26,405円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 |              |                  | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |              |                  |
|----------------------------------------|--------------|------------------|----------------------------------------|--------------|------------------|
| 1.分配金の計算過程                             |              |                  | 1.分配金の計算過程                             |              |                  |
| 項目                                     |              |                  | 項目                                     |              |                  |
| 費用控除後の配当等収益額                           | A            | 2,756,558,494円   | 費用控除後の配当等収益額                           | A            | 5,985,214,572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            | 967,030,489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            | 33,666,272,506円  |
| 収益調整金額                                 | C            | 116,834,004,409円 | 収益調整金額                                 | C            | 160,373,788,277円 |
| 分配準備積立金額                               | D            | 15,174,272,465円  | 分配準備積立金額                               | D            | 15,142,888,361円  |
| 当ファンドの分配対象収益額                          | E=A+B+C+D    | 135,731,865,857円 | 当ファンドの分配対象収益額                          | E=A+B+C+D    | 215,168,163,716円 |
| 当ファンドの期末残存口数                           | F            | 106,364,596,803口 | 当ファンドの期末残存口数                           | F            | 131,079,931,086口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額                      | G=E/F×10,000 | 12,760円          | 10,000口当たり収益分配対象額                      | G=E/F×10,000 | 16,415円          |
| 10,000口当たり分配金額                         | H            | 10円              | 10,000口当たり分配金額                         | H            | 10円              |
| 収益分配金金額                                | I=F×H/10,000 | 106,364,596円     | 収益分配金金額                                | I=F×H/10,000 | 131,079,931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13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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、(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>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</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13期<br>2023年 2月20日現在                                                                                                                       | 第14期<br>2024年 2月19日現在    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                | 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>同左 |
| 2. 時価の算定方法<br>親投資信託受益証券<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。<br>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。 | 2. 時価の算定方法<br>同左         |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 期首元本額 73,633,291,800円                  | 期首元本額 106,364,596,803円                 |
| 期中追加設定元本額 42,856,076,867円              | 期中追加設定元本額 50,685,178,559円              |
| 期中一部解約元本額 10,124,771,864円              | 期中一部解約元本額 25,969,844,276円              |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類        | 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
|           | 損益に含まれた評価差額（円）                         | 損益に含まれた評価差額（円）                         |
| 親投資信託受益証券 | 6,686,640,156                          | 44,694,192,766                         |
| 合計        | 6,686,640,156                          | 44,694,192,766                         |

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式(2024年2月19日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2024年2月19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             | 13,364,985,090  | 39,315,776,639            |    |
|           |     | 外国債券マザーファンド             | 32,011,073,163  | 92,255,912,855            |    |
|           |     | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 13,758,871,242  | 87,883,414,171            |    |
|           |     | 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 64,507,192,695  | 81,201,654,164            |    |
|           |     | 世界REITインデックスマザーファンド     | 15,453,826,338  | 41,337,440,071            |    |
|           | 小計  | 銘柄数：5<br>組入時価比率：98.8%   | 139,095,948,528 | 341,994,197,900<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                         |                 | 341,994,197,900           |    |

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【のむラップ・ファンド（やや積極型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第7期<br>(2023年 2月20日現在) | 第8期<br>(2024年 2月19日現在) |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部            |                        |                        |
| 流動資産            |                        |                        |
| コール・ローン         | 258,121,837            | 556,394,841            |
| 親投資信託受益証券       | 13,859,589,450         | 24,895,186,382         |
| 流動資産合計          | 14,117,711,287         | 25,451,581,223         |
| 資産合計            | 14,117,711,287         | 25,451,581,223         |
| 負債の部            |                        |                        |
| 流動負債            |                        |                        |
| 未払収益分配金         | 9,048,896              | 13,460,864             |
| 未払解約金           | 12,792,821             | 55,182,103             |
| 未払受託者報酬         | 2,121,021              | 3,366,503              |
| 未払委託者報酬         | 90,143,288             | 143,076,190            |
| 未払利息            | 53                     | 58                     |
| その他未払費用         | 212,036                | 336,590                |
| 流動負債合計          | 114,318,115            | 215,422,308            |
| 負債合計            | 114,318,115            | 215,422,308            |
| 純資産の部           |                        |                        |
| 元本等             |                        |                        |
| 元本              | 9,048,896,783          | 13,460,864,587         |
| 剰余金             |                        |                        |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 4,954,496,389          | 11,775,294,328         |
| （分配準備積立金）       | 1,042,106,047          | 4,211,473,409          |
| 元本等合計           | 14,003,393,172         | 25,236,158,915         |
| 純資産合計           | 14,003,393,172         | 25,236,158,915         |
| 負債純資産合計         | 14,117,711,287         | 25,451,581,223         |

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-------------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                       |                                       |
| 受取利息                                      | -                                     | 26                                    |
| 有価証券売買等損益                                 | 590,452,370                           | 3,874,914,932                         |
| 営業収益合計                                    | 590,452,370                           | 3,874,914,958                         |
| 営業費用                                      |                                       |                                       |
| 支払利息                                      | 48,959                                | 99,887                                |
| 受託者報酬                                     | 3,725,815                             | 5,883,295                             |
| 委託者報酬                                     | 158,347,039                           | 250,039,740                           |
| その他費用                                     | 372,454                               | 588,211                               |
| 営業費用合計                                    | 162,494,267                           | 256,611,133                           |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 427,958,103                           | 3,618,303,825                         |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 427,958,103                           | 3,618,303,825                         |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 427,958,103                           | 3,618,303,825                         |
| 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（△） | 39,949,312                            | 248,586,406                           |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 2,774,038,325                         | 4,954,496,389                         |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 2,212,532,421                         | 4,666,169,658                         |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 2,212,532,421                         | 4,666,169,658                         |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 411,034,252                           | 1,201,628,274                         |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 411,034,252                           | 1,201,628,274                         |
| 分配金                                       | 9,048,896                             | 13,460,864                            |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 4,954,496,389                         | 11,775,294,328                        |

## (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          | 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る場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4. その他                 | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2023年 2月21日から2024年 2月19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7期<br>2023年 2月20日現在                                                          | 第8期<br>2024年 2月19日現在                                                          |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>9,048,896,783口                                        | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>13,460,864,587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 1.5475円<br>(10,000口当たり純資産額) (15,475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 1.8748円<br>(10,000口当たり純資産額) (18,748円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 |              |                | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |              |                 |
|---------------------------------------|--------------|----------------|---------------------------------------|--------------|-----------------|
| 1. 分配金の計算過程                           |              |                | 1. 分配金の計算過程                           |              |                 |
| 項目                                    |              |                | 項目                                    |              |                 |
| 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 188,860,179円   | 費用控除後の配当等収益額                          | A            | 396,828,167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            | 199,148,612円   | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額             | B            | 2,972,889,252円  |
| 収益調整金額                                | C            | 3,912,390,342円 | 収益調整金額                                | C            | 7,563,820,919円  |
| 分配準備積立金額                              | D            | 663,146,152円   | 分配準備積立金額                              | D            | 855,216,854円    |
| 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 4,963,545,285円 | 当ファンドの分配対象収益額                         | E=A+B+C+D    | 11,788,755,192円 |
| 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 9,048,896,783口 | 当ファンドの期末残存口数                          | F            | 13,460,864,587口 |
| 10,000口当たり収益分配対象額                     | G=E/F×10,000 | 5,485円         | 10,000口当たり収益分配対象額                     | G=E/F×10,000 | 8,757円          |
| 10,000口当たり分配金額                        | H            | 10円            | 10,000口当たり分配金額                        | H            | 10円             |
| 収益分配金金額                               | I=F×H/10,000 | 9,048,896円     | 収益分配金金額                               | I=F×H/10,000 | 13,460,864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7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                                                                  | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針<br>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 | 1. 金融商品に対する取組方針<br>同左                 |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク<br>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。                                          | 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク<br>同左        |
| 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。                                                                         |                                       |
| これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。                                             |                                       |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制<br>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。                                     | 3. 金融商品に係るリスク管理体制<br>同左               |
| ○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っております。                                                    |                                       |
| ○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っております。                                   |                                       |
| ○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っております。                                                     |                                       |

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

| 第7期<br>2023年 2月20日現在                                                                                                                        | 第8期<br>2024年 2月19日現在     |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                | 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>同左 |
| 2. 時価の算定方法<br>親投資信託受益証券<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。<br>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。 | 2. 時価の算定方法<br>同左         |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                 | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 期首元本額 5,718,111,113円                  | 期首元本額 9,048,896,783円                  |
| 期中追加設定元本額 4,165,589,208円              | 期中追加設定元本額 6,537,129,017円              |
| 期中一部解約元本額 834,803,538円                | 期中一部解約元本額 2,125,161,213円              |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類        | 第7期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第8期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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 | 573,907,927                           | 3,811,349,223                         |
| 合計        | 573,907,927                           | 3,811,349,223                         |

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式(2024年2月19日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2024年2月19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              | 1,174,816,480 | 3,455,957,639            |    |
|           |     | 外国債券マザーファンド              | 2,076,051,602 | 5,983,180,716            |    |
|           |     | 外国株式MSCI－KOKUSA Iマザーファンド | 1,551,093,857 | 9,907,456,902            |    |
|           |     | 国内債券NOMURA－BPI 総合マザーファンド | 1,575,039,847 | 1,982,660,159            |    |
|           |     | 世界REITインデックス マザーファンド     | 1,333,108,141 | 3,565,930,966            |    |
|           | 小計  | 銘柄数：5<br>組入時価比率：98.6%    | 7,710,109,927 | 24,895,186,382<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                          |               | 24,895,186,382           |    |

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 【のむラップ・ファンド（積極型）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

|                 | 第13期<br>(2023年 2月20日現在) | 第14期<br>(2024年 2月19日現在) |
|-----------------|-------------------------|-------------------------|
| 資産の部            |                         |                         |
| 流動資産            |                         |                         |
| コール・ローン         | 2,428,847,355           | 4,764,608,113           |
| 親投資信託受益証券       | 118,319,858,246         | 193,967,498,655         |
| 流動資産合計          | 120,748,705,601         | 198,732,106,768         |
| 資産合計            | 120,748,705,601         | 198,732,106,768         |
| 負債の部            |                         |                         |
| 流動負債            |                         |                         |
| 未払収益分配金         | 41,367,573              | 55,043,746              |
| 未払解約金           | 294,865,722             | 545,449,826             |
| 未払受託者報酬         | 18,137,146              | 27,293,822              |
| 未払委託者報酬         | 816,171,881             | 1,228,222,205           |
| 未払利息            | 502                     | 502                     |
| その他未払費用         | 1,813,652               | 2,729,325               |
| 流動負債合計          | 1,172,356,476           | 1,858,739,426           |
| 負債合計            | 1,172,356,476           | 1,858,739,426           |
| 純資産の部           |                         |                         |
| 元本等             |                         |                         |
| 元本              | 41,367,573,209          | 55,043,746,942          |
| 剰余金             |                         |                         |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 78,208,775,916          | 141,829,620,400         |
| （分配準備積立金）       | 11,912,304,478          | 38,171,817,105          |
| 元本等合計           | 119,576,349,125         | 196,873,367,342         |
| 純資産合計           | 119,576,349,125         | 196,873,367,342         |
| 負債純資産合計         | 120,748,705,601         | 198,732,106,768         |



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

|                                           | 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-------------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 営業収益                                      |                                        |                                        |
| 受取利息                                      | -                                      | 183                                    |
| 有価証券売買等損益                                 | 6,351,870,653                          | 34,748,956,409                         |
| 営業収益合計                                    | 6,351,870,653                          | 34,748,956,592                         |
| 営業費用                                      |                                        |                                        |
| 支払利息                                      | 436,086                                | 845,627                                |
| 受託者報酬                                     | 31,978,385                             | 48,177,878                             |
| 委託者報酬                                     | 1,439,027,517                          | 2,168,004,602                          |
| その他費用                                     | 3,197,716                              | 4,817,663                              |
| 営業費用合計                                    | 1,474,639,704                          | 2,221,845,770                          |
| 営業利益又は営業損失（△）                             | 4,877,230,949                          | 32,527,110,822                         |
| 経常利益又は経常損失（△）                             | 4,877,230,949                          | 32,527,110,822                         |
| 当期純利益又は当期純損失（△）                           | 4,877,230,949                          | 32,527,110,822                         |
| 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（△） | 639,183,521                            | 3,197,665,994                          |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△）                           | 46,571,450,575                         | 78,208,775,916                         |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            | 36,869,407,308                         | 60,614,378,242                         |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   | 36,869,407,308                         | 60,614,378,242                         |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            | 9,428,761,822                          | 26,267,934,840                         |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   | 9,428,761,822                          | 26,267,934,840                         |
| 分配金                                       | 41,367,573                             | 55,043,746                             |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）                           | 78,208,775,916                         | 141,829,620,400                        |

## (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              | 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<br>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<br>提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4.その他                     | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2023年 2月21日から2024年 2月<br>19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13期<br>2023年 2月20日現在                                                         | 第14期<br>2024年 2月19日現在                                                         |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>41,367,573,209口                                       | 1. 計算期間の末日における受益権の総数<br>55,043,746,942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 2.8906円<br>(10,000口当たり純資産額) (28,906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 3.5767円<br>(10,000口当たり純資産額) (35,767円) |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 |              |                 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |              |                  |
|----------------------------------------|--------------|-----------------|----------------------------------------|--------------|------------------|
| 1. 分配金の計算過程                            |              |                 | 1. 分配金の計算過程                            |              |                  |
| 項目                                     |              |                 | 項目                                     |              |                  |
| 費用控除後の配当等収益額                           | A            | 1,646,239,180円  | 費用控除後の配当等収益額                           | A            | 3,147,532,125円   |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額              | B            | 2,591,808,248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            | 26,181,912,703円  |
| 収益調整金額                                 | C            | 66,296,471,438円 | 収益調整金額                                 | C            | 103,657,803,295円 |
| 分配準備積立金額                               | D            | 7,715,624,623円  | 分配準備積立金額                               | D            | 8,897,416,023円   |
| 当ファンドの分配対象収益額                          | E=A+B+C+D    | 78,250,143,489円 | 当ファンドの分配対象収益額                          | E=A+B+C+D    | 141,884,664,146円 |
| 当ファンドの期末残存口数                           | F            | 41,367,573,209口 | 当ファンドの期末残存口数                           | F            | 55,043,746,942口  |
| 10,000口当たり収益分配対象額                      | G=E/F×10,000 | 18,915円         | 10,000口当たり収益分配対象額                      | G=E/F×10,000 | 25,776円          |
| 10,000口当たり分配金額                         | H            | 10円             | 10,000口当たり分配金額                         | H            | 10円              |
| 収益分配金金額                                | I=F×H/10,000 | 41,367,573円     | 収益分配金金額                                | I=F×H/10,000 | 55,043,746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13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                                                                            | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------|
| 1.金融商品に対する取組方針<br>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<br>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<br>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<br>て運用することを目的としております。 | 1.金融商品に対する取組方針<br>同左                   |
| 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク<br>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コー<br>ル・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。                                                  | 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク<br>同左          |
| 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<br>2 有価証券関係に記載しております。                                                                                |                                        |
| これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変<br>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<br>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<br>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<br>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<br>なっております。                                        | 3.金融商品に係るリスク管理体制<br>同左                 |
| ○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<br>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<br>す。                                                      |                                        |
| ○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<br>る情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた<br>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<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<br>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

| 第13期<br>2023年 2月20日現在                                                                                                                       | 第14期<br>2024年 2月19日現在    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                                                                | 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br>同左 |
| 2. 時価の算定方法<br>親投資信託受益証券<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。<br>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。 | 2. 時価の算定方法<br>同左         |

（関連当事者との取引に関する注記）

| 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日                                | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|----------------------------------------|----------------------------------------|
| 期首元本額 26,719,669,620円                  | 期首元本額 41,367,573,209円                  |
| 期中追加設定元本額 19,997,678,152円              | 期中追加設定元本額 27,293,740,542円              |
| 期中一部解約元本額 5,349,774,563円               | 期中一部解約元本額 13,617,566,809円              |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類        | 第13期<br>自 2022年 2月19日<br>至 2023年 2月20日 | 第14期<br>自 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日 |
|-----------|----------------------------------------|----------------------------------------|
|           | 損益に含まれた評価差額（円）                         | 損益に含まれた評価差額（円）                         |
| 親投資信託受益証券 | 6,265,587,133                          | 34,034,576,963                         |
| 合計        | 6,265,587,133                          | 34,034,576,963                         |

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式(2024年2月19日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2024年2月19日現在)

(単位:円)

| 種類        | 通貨  | 銘柄                      | 券面総額           | 評価額                       | 備考 |
|-----------|-----|-------------------------|----------------|---------------------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 国内株式マザーファンド             | 6,956,195,630  | 20,463,040,684            |    |
|           |     | 外国債券マザーファンド             | 11,207,841,103 | 32,300,998,058            |    |
|           |     | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 16,426,242,898 | 104,920,983,886           |    |
|           |     | 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 7,149,243,005  | 8,999,467,094             |    |
|           |     | 世界REITインデックスマザーファンド     | 10,199,636,971 | 27,283,008,933            |    |
|           | 小計  | 銘柄数：5<br>組入時価比率：98.5%   | 51,939,159,607 | 193,967,498,655<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                         |                | 193,967,498,655           |    |

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「のむラップ・ファンド」の各ファンドは「国内株式マザーファンド」、「国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド」、「外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」および「世界REITインデックス マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。  
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

| (単位：円)          |                 |
|-----------------|-----------------|
| (2024年 2月19日現在) |                 |
| 資産の部            |                 |
| 流動資産            |                 |
| コール・ローン         | 31,230,242,967  |
| 株式              | 669,607,594,350 |
| 派生商品評価勘定        | 395,616,155     |
| 未収配当金           | 929,703,282     |
| 未収利息            | 81,237          |
| その他未収収益         | 27,716,472      |
| 差入委託証拠金         | 15,138,459      |
| 流動資産合計          | 702,206,092,922 |
| 資産合計            | 702,206,092,922 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 未払解約金           | 747,505,441     |
| 未払利息            | 3,294           |
| 有価証券貸借取引受入金     | 24,036,588,181  |
| 流動負債合計          | 24,784,096,916  |
| 負債合計            | 24,784,096,916  |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 230,281,270,628 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 447,140,725,378 |
| 元本等合計           | 677,421,996,006 |
| 純資産合計           | 677,421,996,006 |
| 負債純資産合計         | 702,206,092,922 |

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。                                                                                                           |
| 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。<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）

| 2024年 2月19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                  | 2,9417円         |
| (10,000口当たり純資産額)           | (29,417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 |                 |
|                            | 23,329,004,070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 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日                                                                      |  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 1.金融商品に対する取組方針                                                                                      |  |
| 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |  |
| 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク                                                                             |  |
| 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。                                          |  |
| 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。                                                                  |  |
| これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。                                                       |  |
| 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。                                                |  |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制                                                                                    |  |
| 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。                                      |  |
| ○市場リスクの管理                                                                                           |  |
| 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。                                             |  |
| ○信用リスクの管理                                                                                           |  |
| 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。                            |  |
| ○流動性リスクの管理                                                                                          |  |
| 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。                                               |  |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 2024年 2月19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

| 2024年 2月19日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2023年 2月21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 | 222,272,766,631円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 37,344,538,399円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 29,336,034,402円  |
| 期末元本額                            | 230,281,270,628円 |
| 期末元本額の内訳＊                        |                  |
| バランスセレクト30                       | 95,332,977円      |
| バランスセレクト50                       | 221,015,312円     |
| バランスセレクト70                       | 373,283,699円     |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース）               | 1,631,944,560円   |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース）               | 2,283,658,886円   |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース）               | 10,560,089,639円  |
| 野村資産設計ファンド2015                   | 24,651,863円      |
| 野村資産設計ファンド2020                   | 27,146,437円      |
| 野村資産設計ファンド2025                   | 41,960,308円      |
| 野村資産設計ファンド2030                   | 72,191,477円      |
| 野村資産設計ファンド2035                   | 73,152,556円      |
| 野村資産設計ファンド2040                   | 131,440,092円     |
| 野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）          | 20,368,814,362円  |
| のむラップ・ファンド（保守型）                  | 1,584,515,212円   |
| のむラップ・ファンド（普通型）                  | 13,364,985,090円  |
| のむラップ・ファンド（積極型）                  | 6,956,195,630円   |
| 野村資産設計ファンド2045                   | 30,061,987円      |
| 野村インデックスファンド・TOPIX               | 2,067,741,173円   |

|                                                |                 |
|------------------------------------------------|-----------------|
| マイ・ロード                                         | 1,886,416,083円  |
| ネクストコア                                         | 21,714,209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                  | 1,026,936,024円  |
| 野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)                      | 2,806,465,530円  |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)                           | 1,222,635,521円  |
| 野村資産設計ファンド2050                                 | 33,693,908円     |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型               | 7,709,631円      |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型               | 5,123,502円      |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型               | 4,388,679円      |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型               | 4,323,402円      |
| のむラップ・ファンド(やや保守型)                              | 319,382,402円    |
| のむラップ・ファンド(やや積極型)                              | 1,174,816,480円  |
| インデックス・ブレンド(タイプI)                              | 3,639,374円      |
| インデックス・ブレンド(タイプII)                             | 3,466,176円      |
| インデックス・ブレンド(タイプIII)                            | 23,286,298円     |
| インデックス・ブレンド(タイプIV)                             | 10,362,074円     |
| インデックス・ブレンド(タイプV)                              | 35,982,686円     |
| 野村6資産均等バランス                                    | 4,243,617,105円  |
| 世界6資産分散ファンド                                    | 87,086,987円     |
| 野村資産設計ファンド2060                                 | 28,623,760円     |
| はじめてのNISA・日本株式インデックス(TOPIX)                    | 66,362,364円     |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式                         | 3,476,796,591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)               | 171,164,952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)               | 104,069,713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)               | 229,207,697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)               | 108,103,039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)               | 1,550,782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)             | 4,533,317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)               | 199,175円        |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)                   | 1,406,070,332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)              | 501,209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)              | 10,481,236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)               | 24,595,667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)                 | 7,465,213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)             | 65,550,339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)             | 117,847,746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)             | 3,337,958,270円  |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)                        | 23,456,616円     |
| ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)                 | 183,922,339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)            | 3,838,219,709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)               | 32,155,227円     |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)             | 124,449,965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) | 1,633,541円      |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け)                           | 4,901,547円      |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け)                           | 25,181,793円     |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け)                           | 33,497,283円     |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)                      | 93,854,545円     |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                             | 7,348,722,334円  |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                             | 23,093,040,056円 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                             | 30,472,462,584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)               | 40,911,935,987円 |
| マイバランスDC30                                     | 3,208,313,458円  |
| マイバランスDC50                                     | 6,111,847,378円  |
| マイバランスDC70                                     | 7,388,245,281円  |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX                       | 13,815,062,876円 |
| 野村DC運用戦略ファンド                                   | 1,078,012,038円  |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド)                             | 82,449,612円     |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け)                          | 2,072,460,342円  |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け)                          | 1,885,566,713円  |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け)                          | 1,716,270,230円  |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース                           | 15,518,594円     |
| 野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース                         | 7,716,249円      |
| 野村世界6資産分散投信(DC)成長コース                           | 144,950,268円    |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030                    | 46,476,272円     |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040                    | 49,876,793円     |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050                    | 37,105,225円     |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け)                          | 1,093,693,337円  |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け)                          | 867,631,126円    |
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け)                          | 672,593,245円    |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け)                          | 944,383,025円    |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060                    | 30,300,715円     |
| マイターゲット2065(確定拠出年金向け)                          | 368,158,470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） | 147,854,750円 |
| みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）   | 210,967,343円 |
| 野村ＤＣバランスファンド（年金運用戦略タイプ）       | 107,907,758円 |
| マイターゲット２０７０（確定拠出年金向け）         | 167,271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(2024年2月19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             | 9,500   | 3,595.00 | 34,152,500    | 貸付有価証券<br>1,900株         |
|    |     | ニッスイ           | 250,700 | 944.10   | 236,685,870   | 貸付有価証券<br>100株           |
|    |     | マルハニチロ         | 37,200  | 2,958.00 | 110,037,600   | 貸付有価証券<br>300株           |
|    |     | 雪国まいたけ         | 21,400  | 952.00   | 20,372,800    | 貸付有価証券<br>1,200株         |
|    |     | カネコ種苗          | 7,100   | 1,436.00 | 10,195,600    |                          |
|    |     | サカタのタネ         | 28,500  | 3,830.00 | 109,155,000   |                          |
|    |     | ホクト            | 20,100  | 1,838.00 | 36,943,800    |                          |
|    |     | ホクリヨウ          | 1,800   | 1,040.00 | 1,872,000     | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株） |
|    |     | 住石ホールディングス     | 28,400  | 2,131.00 | 60,520,400    | 貸付有価証券<br>12,500株（400株）  |
|    |     | 日鉄鉱業           | 10,100  | 5,150.00 | 52,015,000    |                          |
|    |     | 三井松島ホールディングス   | 14,900  | 3,000.00 | 44,700,000    | 貸付有価証券<br>6,000株（1,800株） |
|    |     | I N P E X      | 927,300 | 2,033.50 | 1,885,664,550 | 貸付有価証券<br>40,200株        |
|    |     | 石油資源開発         | 29,000  | 6,200.00 | 179,800,000   |                          |
|    |     | K&Oエナジーグループ    | 11,400  | 2,499.00 | 28,488,600    | 貸付有価証券<br>3,000株         |
|    |     | ショーボンドホールディングス | 34,200  | 6,242.00 | 213,476,400   |                          |
|    |     | ミライト・ワン        | 82,900  | 1,751.00 | 145,157,900   | 貸付有価証券<br>800株           |
|    |     | タマホーム          | 15,800  | 3,965.00 | 62,647,000    | 貸付有価証券<br>4,300株（400株）   |
|    |     | サンヨーホームズ       | 1,400   | 761.00   | 1,065,400     | 貸付有価証券<br>700株           |
|    |     | 日本アクア          | 4,600   | 1,017.00 | 4,678,200     | 貸付有価証券<br>2,100株（1,300株） |
|    |     | ファーストコーポレーション  | 3,200   | 787.00   | 2,518,400     | 貸付有価証券<br>200株           |
|    |     | ベステラ           | 2,600   | 1,097.00 | 2,852,200     | 貸付有価証券<br>1,500株（900株）   |
|    |     | キャンディル         | 2,000   | 581.00   | 1,162,000     | 貸付有価証券<br>1,300株         |
|    |     | ダイセキ環境ソリューション  | 2,300   | 1,026.00 | 2,359,800     | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株） |
|    |     | 第一カッター興業       | 7,200   | 1,361.00 | 9,799,200     |                          |
|    |     | 安藤・間           | 145,300 | 1,239.00 | 180,026,700   |                          |
|    |     | 東急建設           | 78,500  | 808.00   | 63,428,000    |                          |

|                 |         |          |               |                           |
|-----------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| コムシスホールディングス    | 80,000  | 3,339.00 | 267,120,000   |                           |
| ビーアールホールディングス   | 36,700  | 374.00   | 13,725,800    |                           |
| 高松コンストラクショングループ | 18,600  | 2,723.00 | 50,647,800    |                           |
| 東建コーポレーション      | 6,300   | 9,600.00 | 60,480,000    | 貸付有価証券<br>300株            |
| ソネック            | 1,200   | 927.00   | 1,112,400     |                           |
| ヤマウラ            | 12,700  | 1,504.00 | 19,100,800    | 貸付有価証券<br>5,900株          |
| オリエンタル白石        | 92,800  | 390.00   | 36,192,000    | 貸付有価証券<br>400株            |
| 大成建設            | 164,100 | 4,859.00 | 797,361,900   | 貸付有価証券<br>1,900株          |
| 大林組             | 627,200 | 1,440.50 | 903,481,600   |                           |
| 清水建設            | 497,300 | 914.80   | 454,930,040   | 貸付有価証券<br>300株            |
| 飛鳥建設            | 18,100  | 1,482.00 | 26,824,200    |                           |
| 長谷工コーポレーション     | 160,900 | 1,886.00 | 303,457,400   | 貸付有価証券<br>500株（500株）      |
| 松井建設            | 16,400  | 858.00   | 14,071,200    |                           |
| 銭高組             | 1,200   | 4,150.00 | 4,980,000     |                           |
| 鹿島建設            | 388,900 | 2,843.50 | 1,105,837,150 |                           |
| 不動テトラ           | 12,100  | 2,228.00 | 26,958,800    |                           |
| 大木建設            | 3,100   | 1,642.00 | 5,090,200     |                           |
| 鉄建建設            | 12,600  | 2,561.00 | 32,268,600    |                           |
| 西松建設            | 33,500  | 4,587.00 | 153,664,500   |                           |
| 三井住友建設          | 130,500 | 443.00   | 57,811,500    |                           |
| 大豊建設            | 6,000   | 3,140.00 | 18,840,000    | 貸付有価証券<br>300株            |
| 佐田建設            | 5,000   | 709.00   | 3,545,000     |                           |
| ナカノフドー建設        | 5,500   | 634.00   | 3,487,000     |                           |
| 奥村組             | 28,400  | 5,080.00 | 144,272,000   |                           |
| 東鉄工業            | 21,700  | 3,035.00 | 65,859,500    |                           |
| イチケン            | 1,900   | 2,428.00 | 4,613,200     |                           |
| 富士ピー・エス         | 3,500   | 452.00   | 1,582,000     |                           |
| 浅沼組             | 13,000  | 4,150.00 | 53,950,000    |                           |
| 戸田建設            | 237,300 | 958.00   | 227,333,400   |                           |
| 熊谷組             | 28,900  | 3,865.00 | 111,698,500   |                           |
| 北野建設            | 1,500   | 3,095.00 | 4,642,500     |                           |
| 植木組             | 2,200   | 1,798.00 | 3,955,600     | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| 矢作建設工業          | 23,900  | 1,585.00 | 37,881,500    |                           |
| ピーエス三菱          | 22,200  | 1,057.00 | 23,465,400    | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| 日本ハウスホールディングス   | 37,400  | 306.00   | 11,444,400    | 貸付有価証券<br>13,700株（5,000株） |
| 新日本建設           | 24,600  | 1,242.00 | 30,553,200    |                           |
| 東亜道路工業          | 7,000   | 6,420.00 | 44,940,000    |                           |
| 日本道路            | 20,600  | 2,038.00 | 41,982,800    |                           |



|            |         |          |               |                           |
|------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| 東亜建設工業     | 13,500  | 4,675.00 | 63,112,500    |                           |
| 日本国土開発     | 49,900  | 521.00   | 25,997,900    | 貸付有価証券<br>19,900株（4,900株） |
| 若築建設       | 6,100   | 3,140.00 | 19,154,000    |                           |
| 東洋建設       | 44,200  | 1,322.00 | 58,432,400    | 貸付有価証券<br>1,500株（300株）    |
| 五洋建設       | 248,600 | 764.40   | 190,029,840   |                           |
| 世紀東急工業     | 22,500  | 1,938.00 | 43,605,000    | 貸付有価証券<br>400株（400株）      |
| 福田組        | 6,600   | 5,330.00 | 35,178,000    |                           |
| 住友林業       | 151,600 | 4,109.00 | 622,924,400   | 貸付有価証券<br>1,900株          |
| 日本基礎技術     | 4,700   | 453.00   | 2,129,100     | 貸付有価証券<br>300株            |
| 巴コーポレーション  | 9,800   | 655.00   | 6,419,000     |                           |
| 大和ハウス工業    | 485,000 | 4,337.00 | 2,103,445,000 | 貸付有価証券<br>3,800株（3,200株）  |
| ライト工業      | 36,100  | 1,895.00 | 68,409,500    |                           |
| 積水ハウス      | 531,900 | 3,292.00 | 1,751,014,800 | 貸付有価証券<br>4,900株          |
| 日特建設       | 16,700  | 1,152.00 | 19,238,400    |                           |
| 北陸電気工事     | 12,000  | 1,259.00 | 15,108,000    | 貸付有価証券<br>100株            |
| ユアテック      | 38,600  | 1,260.00 | 48,636,000    |                           |
| 日本リーテック    | 13,700  | 1,243.00 | 17,029,100    | 貸付有価証券<br>100株            |
| 四電工        | 7,300   | 4,000.00 | 29,200,000    |                           |
| 中電工        | 27,200  | 2,953.00 | 80,321,600    |                           |
| 関電工        | 109,800 | 1,593.00 | 174,911,400   | 貸付有価証券<br>1,000株（200株）    |
| きんでん       | 123,500 | 2,650.00 | 327,275,000   |                           |
| 東京エネシス     | 17,400  | 1,165.00 | 20,271,000    | 貸付有価証券<br>300株            |
| トーエネック     | 5,800   | 5,190.00 | 30,102,000    |                           |
| 住友電設       | 16,700  | 3,075.00 | 51,352,500    |                           |
| 日本電設工業     | 32,900  | 2,091.00 | 68,793,900    |                           |
| エクシオグループ   | 85,700  | 3,117.00 | 267,126,900   | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株）  |
| 新日本空調      | 11,400  | 2,862.00 | 32,626,800    |                           |
| 九電工        | 37,900  | 5,710.00 | 216,409,000   | 貸付有価証券<br>400株            |
| 三機工業       | 37,900  | 1,913.00 | 72,502,700    |                           |
| 日揮ホールディングス | 173,500 | 1,412.00 | 244,982,000   | 貸付有価証券<br>200株            |
| 中外炉工業      | 5,700   | 2,829.00 | 16,125,300    |                           |
| ヤマト        | 6,500   | 974.00   | 6,331,000     |                           |
| 太平電業       | 10,900  | 4,460.00 | 48,614,000    |                           |
| 高砂熱学工業     | 47,000  | 4,390.00 | 206,330,000   | 貸付有価証券<br>100株            |
| 三晃金属工業     | 1,100   | 4,955.00 | 5,450,500     |                           |
| 朝日工業社      | 8,200   | 2,986.00 | 24,485,200    |                           |
| 明星工業       | 33,900  | 1,230.00 | 41,697,000    |                           |

|                     |         |          |             |                            |
|---------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 大気社                 | 20,200  | 4,885.00 | 98,677,000  | 貸付有価証券<br>300株             |
| ダイダン                | 23,100  | 1,811.00 | 41,834,100  | 貸付有価証券<br>1,900株           |
| 日比谷総合設備             | 12,700  | 2,560.00 | 32,512,000  |                            |
| フィル・カンパニー           | 2,700   | 878.00   | 2,370,600   |                            |
| テスホールディングス          | 37,800  | 448.00   | 16,934,400  | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| インフロニア・ホール<br>ディングス | 202,200 | 1,500.00 | 303,300,000 | 貸付有価証券<br>3,000株           |
| レイズネクスト             | 25,400  | 2,349.00 | 59,664,600  |                            |
| ニッポン                | 52,700  | 2,399.00 | 126,427,300 | 貸付有価証券<br>24,800株（24,800株） |
| 日清製粉グループ本社          | 162,800 | 2,137.00 | 347,903,600 |                            |
| 日東富士製粉              | 3,100   | 5,370.00 | 16,647,000  |                            |
| 昭和産業                | 17,000  | 3,455.00 | 58,735,000  |                            |
| 鳥越製粉                | 7,000   | 730.00   | 5,110,000   | 貸付有価証券<br>1,400株           |
| 中部飼料                | 24,400  | 1,280.00 | 31,232,000  |                            |
| フィード・ワン             | 25,700  | 1,015.00 | 26,085,500  | 貸付有価証券<br>100株             |
| 東洋精糖                | 1,500   | 2,686.00 | 4,029,000   | 貸付有価証券<br>100株             |
| 日本甜菜製糖              | 10,200  | 2,120.00 | 21,624,000  |                            |
| DM三井製糖ホールディ<br>ングス  | 17,500  | 3,280.00 | 57,400,000  |                            |
| 塩水港精糖               | 10,300  | 314.00   | 3,234,200   | 貸付有価証券<br>4,700株           |
| ウェルネオシュガー           | 8,800   | 2,282.00 | 20,081,600  |                            |
| 森永製菓                | 75,400  | 2,748.00 | 207,199,200 |                            |
| 中村屋                 | 4,400   | 3,130.00 | 13,772,000  | 貸付有価証券<br>300株             |
| 江崎グリコ               | 50,400  | 4,697.00 | 236,728,800 | 貸付有価証券<br>3,500株           |
| 名糖産業                | 6,900   | 1,849.00 | 12,758,100  | 貸付有価証券<br>2,200株           |
| 井村屋グループ             | 10,500  | 2,459.00 | 25,819,500  |                            |
| 不二家                 | 12,100  | 2,507.00 | 30,334,700  | 貸付有価証券<br>5,600株           |
| 山崎製パン               | 117,800 | 3,907.00 | 460,244,600 | 貸付有価証券<br>9,400株           |
| 第一屋製パン              | 1,500   | 675.00   | 1,012,500   |                            |
| モロゾフ                | 5,700   | 4,150.00 | 23,655,000  |                            |
| 亀田製菓                | 10,100  | 4,430.00 | 44,743,000  | 貸付有価証券<br>1,300株           |
| 寿スピリッツ              | 83,200  | 1,928.00 | 160,409,600 |                            |
| カルビー                | 80,600  | 3,155.00 | 254,293,000 | 貸付有価証券<br>700株             |
| 森永乳業                | 61,500  | 3,156.00 | 194,094,000 |                            |
| 六甲バター               | 12,900  | 1,379.00 | 17,789,100  | 貸付有価証券<br>600株             |
| ヤクルト本社              | 251,600 | 3,158.00 | 794,552,800 | 貸付有価証券<br>2,500株           |
| 明治ホールディングス          | 215,900 | 3,461.00 | 747,229,900 |                            |

|                          |         |          |               |                          |
|--------------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 雪印メグミルク                  | 42,600  | 2,219.00 | 94,529,400    | 貸付有価証券<br>200株           |
| プリマハム                    | 23,700  | 2,283.00 | 54,107,100    | 貸付有価証券<br>200株           |
| 日本ハム                     | 75,700  | 5,284.00 | 399,998,800   |                          |
| 林兼産業                     | 2,600   | 577.00   | 1,500,200     |                          |
| 丸大食品                     | 17,700  | 1,652.00 | 29,240,400    |                          |
| S Foods                  | 19,400  | 3,195.00 | 61,983,000    | 貸付有価証券<br>2,200株         |
| 柿安本店                     | 6,900   | 2,592.00 | 17,884,800    | 貸付有価証券<br>2,900株         |
| 伊藤ハム米久ホールディングス           | 26,900  | 4,150.00 | 111,635,000   |                          |
| サッポロホールディングス             | 58,000  | 7,051.00 | 408,958,000   | 貸付有価証券<br>6,400株         |
| アサヒグループホールディングス          | 406,800 | 5,327.00 | 2,167,023,600 | 貸付有価証券<br>48,400株        |
| 麒麟ホールディングス               | 733,400 | 2,148.50 | 1,575,709,900 |                          |
| 宝ホールディングス                | 120,200 | 1,187.00 | 142,677,400   | 貸付有価証券<br>11,500株（300株）  |
| オエノンホールディングス             | 52,600  | 351.00   | 18,462,600    |                          |
| 養命酒製造                    | 5,800   | 1,872.00 | 10,857,600    |                          |
| コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス | 137,900 | 1,907.50 | 263,044,250   | 貸付有価証券<br>64,200株        |
| ライフドリンクカンパニー             | 2,600   | 5,110.00 | 13,286,000    |                          |
| サントリー食品インターナショナル         | 124,000 | 4,737.00 | 587,388,000   | 貸付有価証券<br>11,900株        |
| ダイドーグループホールディングス         | 19,900  | 3,030.00 | 60,297,000    |                          |
| 伊藤園                      | 59,700  | 4,254.00 | 253,963,800   | 貸付有価証券<br>100株           |
| キーコーヒー                   | 19,700  | 2,047.00 | 40,325,900    | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| ユニカフェ                    | 2,600   | 904.00   | 2,350,400     | 貸付有価証券<br>900株（100株）     |
| ジャパンフーズ                  | 1,200   | 1,403.00 | 1,683,600     | 貸付有価証券<br>800株           |
| 日清オイリオグループ               | 24,800  | 5,100.00 | 126,480,000   |                          |
| 不二製油グループ本社               | 41,000  | 2,399.00 | 98,359,000    | 貸付有価証券<br>600株           |
| かどや製油                    | 900     | 3,810.00 | 3,429,000     |                          |
| J-オイルミルズ                 | 20,200  | 1,942.00 | 39,228,400    |                          |
| キッコーマン                   | 116,700 | 9,336.00 | 1,089,511,200 |                          |
| 味の素                      | 418,400 | 5,670.00 | 2,372,328,000 | 貸付有価証券<br>6,600株（1,300株） |
| ブルドックソース                 | 9,300   | 2,123.00 | 19,743,900    |                          |
| キューピー                    | 94,600  | 2,726.50 | 257,926,900   |                          |
| ハウス食品グループ本社              | 60,600  | 3,146.00 | 190,647,600   | 貸付有価証券<br>300株（200株）     |
| カゴメ                      | 75,700  | 3,604.00 | 272,822,800   | 貸付有価証券<br>7,600株         |
| 焼津水産化学工業                 | 3,400   | 1,350.00 | 4,590,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| アリアケジャパン                 | 17,600  | 5,700.00 | 100,320,000   | 貸付有価証券                   |

|                   |           |          |               |                            |
|-------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
|                   |           |          |               | 700株                       |
| ピエトロ              | 1,100     | 1,825.00 | 2,007,500     | 貸付有価証券<br>400株（300株）       |
| エバラ食品工業           | 4,200     | 2,921.00 | 12,268,200    |                            |
| やまみ               | 1,100     | 4,400.00 | 4,840,000     |                            |
| ニチレイ              | 80,700    | 3,747.00 | 302,382,900   |                            |
| 東洋水産              | 89,000    | 8,549.00 | 760,861,000   | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）   |
| イートアンドホールディングス    | 8,300     | 2,132.00 | 17,695,600    | 貸付有価証券<br>3,900株           |
| 大冷                | 1,100     | 1,936.00 | 2,129,600     |                            |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 8,000     | 1,268.00 | 10,144,000    | 貸付有価証券<br>3,700株（2,600株）   |
| 日清食品ホールディングス      | 185,700   | 4,442.00 | 824,879,400   |                            |
| 永谷園ホールディングス       | 8,600     | 2,205.00 | 18,963,000    |                            |
| 一正蒲鉾              | 3,400     | 741.00   | 2,519,400     |                            |
| フジッコ              | 18,100    | 1,945.00 | 35,204,500    |                            |
| ロック・フィールド         | 21,500    | 1,675.00 | 36,012,500    |                            |
| 日本たばこ産業           | 1,069,900 | 3,912.00 | 4,185,448,800 | 貸付有価証券<br>93,400株          |
| ケンコーマヨネーズ         | 12,100    | 2,120.00 | 25,652,000    |                            |
| わらべや日洋ホールディングス    | 11,800    | 2,832.00 | 33,417,600    | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| なとり               | 11,100    | 2,153.00 | 23,898,300    |                            |
| イフジ産業             | 1,500     | 1,458.00 | 2,187,000     |                            |
| ファーマフーズ           | 25,300    | 989.00   | 25,021,700    | 貸付有価証券<br>11,900株（200株）    |
| ユーグレナ             | 109,600   | 640.00   | 70,144,000    | 貸付有価証券<br>51,500株（9,900株）  |
| 紀文食品              | 15,300    | 1,191.00 | 18,222,300    |                            |
| ピクルスホールディングス      | 10,300    | 1,258.00 | 12,957,400    | 貸付有価証券<br>4,800株           |
| ミヨシ油脂             | 3,000     | 1,250.00 | 3,750,000     |                            |
| 理研ビタミン            | 15,200    | 2,430.00 | 36,936,000    |                            |
| 片倉工業              | 16,500    | 1,800.00 | 29,700,000    |                            |
| グンゼ               | 12,700    | 5,650.00 | 71,755,000    |                            |
| 東洋紡               | 77,400    | 1,081.00 | 83,669,400    | 貸付有価証券<br>100株             |
| ユニチカ              | 57,900    | 158.00   | 9,148,200     | 貸付有価証券<br>17,400株（10,800株） |
| 富士紡ホールディングス       | 7,800     | 4,465.00 | 34,827,000    |                            |
| 倉敷紡績              | 12,700    | 3,100.00 | 39,370,000    |                            |
| シキボウ              | 9,500     | 1,200.00 | 11,400,000    |                            |
| 日本毛織              | 45,900    | 1,371.00 | 62,928,900    |                            |
| ダイトウボウ            | 13,000    | 91.00    | 1,183,000     | 貸付有価証券<br>7,600株（2,500株）   |
| トーア紡コーポレーション      | 3,100     | 421.00   | 1,305,100     | 貸付有価証券<br>100株             |
| ダイドーリミテッド         | 11,500    | 602.00   | 6,923,000     | 貸付有価証券<br>5,400株           |
| 帝国繊維              | 20,200    | 2,137.00 | 43,167,400    | 貸付有価証券                     |

|                |           |          |             |                            |
|----------------|-----------|----------|-------------|----------------------------|
|                |           |          |             | 700株                       |
| 帝人             | 172,100   | 1,259.50 | 216,759,950 | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| 東レ             | 1,200,100 | 695.10   | 834,189,510 | 貸付有価証券<br>700株             |
| 住江織物           | 1,600     | 2,367.00 | 3,787,200   | 貸付有価証券<br>600株             |
| 日本フェルト         | 4,400     | 437.00   | 1,922,800   |                            |
| イチカワ           | 1,000     | 1,752.00 | 1,752,000   |                            |
| 日東製網           | 800       | 1,650.00 | 1,320,000   |                            |
| アツギ            | 5,600     | 611.00   | 3,421,600   | 貸付有価証券<br>200株             |
| ダイニツク          | 2,500     | 761.00   | 1,902,500   |                            |
| セーレン           | 34,600    | 2,429.00 | 84,043,400  | 貸付有価証券<br>16,300株（15,000株） |
| ソトー            | 2,500     | 695.00   | 1,737,500   |                            |
| 東海染工           | 800       | 820.00   | 656,000     |                            |
| 小松マテーレ         | 26,000    | 781.00   | 20,306,000  |                            |
| ワコールホールディングス   | 36,700    | 3,639.00 | 133,551,300 | 貸付有価証券<br>200株             |
| ホギメディカル        | 23,600    | 3,555.00 | 83,898,000  |                            |
| クラウディアホールディングス | 1,800     | 411.00   | 739,800     | 貸付有価証券<br>1,200株（800株）     |
| T S I ホールディングス | 58,200    | 702.00   | 40,856,400  | 貸付有価証券<br>27,300株          |
| マツオカコーポレーション   | 2,400     | 1,570.00 | 3,768,000   | 貸付有価証券<br>200株             |
| ワールド           | 25,300    | 1,970.00 | 49,841,000  | 貸付有価証券<br>11,800株          |
| 三陽商会           | 6,800     | 2,736.00 | 18,604,800  | 貸付有価証券<br>400株（100株）       |
| ナイガイ           | 2,600     | 254.00   | 660,400     | 貸付有価証券<br>1,600株           |
| オンワードホールディングス  | 105,600   | 527.00   | 55,651,200  | 貸付有価証券<br>24,300株          |
| ルックホールディングス    | 5,000     | 2,455.00 | 12,275,000  | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| ゴールドウイン        | 31,700    | 9,057.00 | 287,106,900 | 貸付有価証券<br>1,300株           |
| デサント           | 30,900    | 3,200.00 | 98,880,000  | 貸付有価証券<br>200株             |
| キング            | 3,000     | 703.00   | 2,109,000   |                            |
| ヤマトインターナショナル   | 6,300     | 300.00   | 1,890,000   |                            |
| 特種東海製紙         | 9,800     | 3,835.00 | 37,583,000  | 貸付有価証券<br>700株             |
| 王子ホールディングス     | 746,200   | 570.00   | 425,334,000 | 貸付有価証券<br>83,900株（12,100株） |
| 日本製紙           | 101,100   | 1,165.00 | 117,781,500 | 貸付有価証券<br>6,900株（1,300株）   |
| 三菱製紙           | 10,800    | 549.00   | 5,929,200   | 貸付有価証券<br>4,100株           |
| 北越コーポレーション     | 88,000    | 1,322.00 | 116,336,000 | 貸付有価証券<br>41,400株（200株）    |
| 中越パルプ工業        | 3,200     | 1,800.00 | 5,760,000   | 貸付有価証券<br>300株             |
| 大王製紙           | 79,100    | 1,091.50 | 86,337,650  | 貸付有価証券                     |

|                    |           |           |                                             |
|--------------------|-----------|-----------|---------------------------------------------|
|                    |           |           | 5,400株                                      |
| 阿波製紙               | 2,200     | 500.00    | 1,100,000 貸付有価証券<br>1,400株                  |
| レンゴー               | 163,100   | 1,015.50  | 165,628,050                                 |
| トーモク               | 10,300    | 2,297.00  | 23,659,100 貸付有価証券<br>200株                   |
| ザ・パック              | 13,300    | 3,815.00  | 50,739,500                                  |
| 北の達人コーポレーショ<br>ン   | 75,500    | 229.00    | 17,289,500 貸付有価証券<br>35,500株（100株）          |
| クラレ                | 261,000   | 1,519.50  | 396,589,500 貸付有価証券<br>14,100株               |
| 旭化成                | 1,211,800 | 1,049.50  | 1,271,784,100                               |
| 共和レザー              | 4,600     | 823.00    | 3,785,800                                   |
| 巴川コーポレーション         | 2,200     | 814.00    | 1,790,800 貸付有価証券<br>1,200株                  |
| レゾナック・ホールディ<br>ングス | 173,100   | 3,260.00  | 564,306,000 貸付有価証券<br>2,000株                |
| 住友化学               | 1,329,200 | 313.60    | 416,837,120 貸付有価証券<br>382,000株（16,100<br>株） |
| 住友精化               | 8,400     | 5,070.00  | 42,588,000                                  |
| 日産化学               | 84,100    | 6,237.00  | 524,531,700 貸付有価証券<br>1,700株（200株）          |
| ラサ工業               | 6,900     | 2,321.00  | 16,014,900 貸付有価証券<br>100株                   |
| クレハ                | 39,200    | 2,677.00  | 104,938,400                                 |
| 多木化学               | 7,000     | 3,755.00  | 26,285,000 貸付有価証券<br>1,800株                 |
| テイカ                | 15,500    | 1,386.00  | 21,483,000                                  |
| 石原産業               | 29,700    | 1,513.00  | 44,936,100                                  |
| 片倉コープアグリ           | 1,900     | 1,086.00  | 2,063,400 貸付有価証券<br>1,000株（500株）            |
| 日本曹達               | 21,100    | 5,960.00  | 125,756,000                                 |
| 東ソー                | 239,100   | 1,999.00  | 477,960,900 貸付有価証券<br>2,100株（1,100株）        |
| トクヤマ               | 57,800    | 2,339.50  | 135,223,100 貸付有価証券<br>600株                  |
| セントラル硝子            | 19,100    | 2,905.00  | 55,485,500 貸付有価証券<br>200株                   |
| 東亜合成               | 86,100    | 1,520.00  | 130,872,000 貸付有価証券<br>100株                  |
| 大阪ソーダ              | 12,500    | 11,480.00 | 143,500,000 貸付有価証券<br>5,800株（200株）          |
| 関東電化工業             | 34,600    | 943.00    | 32,627,800 貸付有価証券<br>1,300株                 |
| デンカ                | 65,100    | 2,528.00  | 164,572,800 貸付有価証券<br>2,200株                |
| 信越化学工業             | 1,624,300 | 6,178.00  | 10,034,925,400                              |
| 日本カーバイド工業          | 7,600     | 1,845.00  | 14,022,000                                  |
| 堺化学工業              | 13,600    | 1,994.00  | 27,118,400                                  |
| 第一稀元素化学工業          | 19,600    | 927.00    | 18,169,200 貸付有価証券<br>200株                   |
| エア・ウォーター           | 169,000   | 2,202.00  | 372,138,000 貸付有価証券<br>6,200株                |
| 日本酸素ホールディング<br>ス   | 173,800   | 4,159.00  | 722,834,200 貸付有価証券<br>100株                  |

|              |           |          |               |                          |
|--------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| 日本化学工業       | 6,600     | 2,150.00 | 14,190,000    |                          |
| 東邦アセチレン      | 8,400     | 410.00   | 3,444,000     |                          |
| 日本パーカライジング   | 79,800    | 1,270.00 | 101,346,000   |                          |
| 高圧ガス工業       | 26,000    | 878.00   | 22,828,000    |                          |
| チタン工業        | 1,100     | 1,072.00 | 1,179,200     |                          |
| 四国化成ホールディングス | 22,900    | 1,760.00 | 40,304,000    |                          |
| 戸田工業         | 4,100     | 1,640.00 | 6,724,000     | 貸付有価証券<br>1,900株（800株）   |
| ステラ ケミファ     | 9,700     | 3,890.00 | 37,733,000    |                          |
| 保土谷化学工業      | 5,600     | 3,540.00 | 19,824,000    |                          |
| 日本触媒         | 26,100    | 5,702.00 | 148,822,200   | 貸付有価証券<br>300株           |
| 大日精化工業       | 12,400    | 2,757.00 | 34,186,800    |                          |
| カネカ          | 45,500    | 3,718.00 | 169,169,000   | 貸付有価証券<br>300株           |
| 三菱瓦斯化学       | 133,800   | 2,642.50 | 353,566,500   |                          |
| 三井化学         | 147,700   | 4,067.00 | 600,695,900   | 貸付有価証券<br>4,800株         |
| J S R        | 195,100   | 4,060.00 | 792,106,000   |                          |
| 東京応化工業       | 85,500    | 4,140.00 | 353,970,000   | 貸付有価証券<br>39,400株        |
| 大阪有機化学工業     | 15,000    | 3,005.00 | 45,075,000    | 貸付有価証券<br>3,000株（500株）   |
| 三菱ケミカルグループ   | 1,309,500 | 862.00   | 1,128,789,000 |                          |
| KHネオケム       | 27,300    | 2,279.00 | 62,216,700    | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| ダイセル         | 230,300   | 1,438.00 | 331,171,400   | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| 住友ベークライト     | 25,100    | 8,136.00 | 204,213,600   |                          |
| 積水化学工業       | 359,900   | 2,092.00 | 752,910,800   |                          |
| 日本ゼオン        | 122,800   | 1,284.50 | 157,736,600   | 貸付有価証券<br>9,200株         |
| アイカ工業        | 45,200    | 3,535.00 | 159,782,000   |                          |
| U B E        | 85,200    | 2,582.00 | 219,986,400   |                          |
| 積水樹脂         | 26,700    | 2,518.00 | 67,230,600    | 貸付有価証券<br>100株           |
| タキロンシーアイ     | 45,700    | 639.00   | 29,202,300    | 貸付有価証券<br>200株           |
| 旭有機材         | 11,900    | 3,965.00 | 47,183,500    | 貸付有価証券<br>300株           |
| ニチバン         | 9,700     | 1,871.00 | 18,148,700    | 貸付有価証券<br>400株           |
| リケンテクノス      | 38,600    | 960.00   | 37,056,000    |                          |
| 大倉工業         | 8,300     | 3,135.00 | 26,020,500    |                          |
| 積水化成品工業      | 25,100    | 460.00   | 11,546,000    |                          |
| 群栄化学工業       | 4,200     | 3,660.00 | 15,372,000    |                          |
| タイガースポリマー    | 3,600     | 1,069.00 | 3,848,400     |                          |
| ミライアル        | 2,700     | 1,462.00 | 3,947,400     | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株） |
| ダイキアクシス      | 3,300     | 703.00   | 2,319,900     | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| ダイキョーニシカワ    | 39,500    | 733.00   | 28,953,500    |                          |

|                 |         |          |               | 貸付有価証券<br>100株             |
|-----------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| 竹本容器            | 3,000   | 775.00   | 2,325,000     |                            |
| 森六ホールディングス      | 9,300   | 2,782.00 | 25,872,600    |                            |
| 恵和              | 12,900  | 1,209.00 | 15,596,100    | 貸付有価証券<br>2,700株（400株）     |
| 日本化薬            | 136,800 | 1,306.50 | 178,729,200   | 貸付有価証券<br>500株             |
| カーリットホールディングス   | 19,300  | 993.00   | 19,164,900    |                            |
| 日本精化            | 11,900  | 2,647.00 | 31,499,300    | 貸付有価証券<br>200株             |
| 扶桑化学工業          | 19,000  | 4,665.00 | 88,635,000    | 貸付有価証券<br>500株             |
| トリケミカル研究所       | 21,700  | 4,180.00 | 90,706,000    | 貸付有価証券<br>4,000株           |
| A D E K A       | 62,500  | 3,004.00 | 187,750,000   |                            |
| 日油              | 54,100  | 7,160.00 | 387,356,000   |                            |
| 新日本理化           | 11,000  | 206.00   | 2,266,000     | 貸付有価証券<br>5,400株（4,300株）   |
| ハリマ化成グループ       | 11,200  | 899.00   | 10,068,800    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 花王              | 405,000 | 5,651.00 | 2,288,655,000 | 貸付有価証券<br>68,600株          |
| 第一工業製薬          | 7,100   | 3,170.00 | 22,507,000    |                            |
| 石原ケミカル          | 8,000   | 1,882.00 | 15,056,000    |                            |
| 日華化学            | 3,200   | 882.00   | 2,822,400     | 貸付有価証券<br>1,700株           |
| ニイタカ            | 1,600   | 1,904.00 | 3,046,400     | 貸付有価証券<br>800株（700株）       |
| 三洋化成工業          | 11,000  | 4,185.00 | 46,035,000    |                            |
| 有機合成薬品工業        | 6,500   | 298.00   | 1,937,000     | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| 大日本塗料           | 19,900  | 1,087.00 | 21,631,300    |                            |
| 日本ペイントホールディングス  | 951,100 | 1,105.00 | 1,050,965,500 | 貸付有価証券<br>37,400株（14,100株） |
| 関西ペイント          | 175,500 | 2,296.50 | 403,035,750   | 貸付有価証券<br>2,100株（2,100株）   |
| 神東塗料            | 6,600   | 128.00   | 844,800       | 貸付有価証券<br>100株             |
| 中国塗料            | 36,800  | 2,100.00 | 77,280,000    |                            |
| 日本特殊塗料          | 5,700   | 1,368.00 | 7,797,600     |                            |
| 藤倉化成            | 20,600  | 453.00   | 9,331,800     |                            |
| 太陽ホールディングス      | 31,200  | 3,205.00 | 99,996,000    | 貸付有価証券<br>100株             |
| D I C           | 70,000  | 3,020.00 | 211,400,000   | 貸付有価証券<br>32,800株          |
| サカタインクス         | 39,800  | 1,390.00 | 55,322,000    | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| a r t i e n c e | 39,000  | 2,904.00 | 113,256,000   | 貸付有価証券<br>18,300株          |
| T & K T O K A   | 17,200  | 1,411.00 | 24,269,200    | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| 富士フイルムホールディングス  | 332,700 | 9,441.00 | 3,141,020,700 |                            |
| 資生堂             | 374,500 | 4,175.00 | 1,563,537,500 | 貸付有価証券                     |



|                  |         |           |               |                            |
|------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
|                  |         |           |               | 12,800株                    |
| ライオン             | 234,700 | 1,317.00  | 309,099,900   | 貸付有価証券<br>2,000株           |
| 高砂香料工業           | 13,500  | 3,430.00  | 46,305,000    |                            |
| マンダム             | 38,700  | 1,311.00  | 50,735,700    |                            |
| ミルボン             | 24,400  | 3,499.00  | 85,375,600    | 貸付有価証券<br>3,100株           |
| ファンケル            | 78,500  | 2,125.00  | 166,812,500   | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| コーセー             | 36,500  | 8,436.00  | 307,914,000   | 貸付有価証券<br>17,100株（11,500株） |
| コタ               | 16,500  | 1,584.00  | 26,136,000    |                            |
| シーボン             | 1,100   | 1,484.00  | 1,632,400     |                            |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 91,900  | 1,464.00  | 134,541,600   | 貸付有価証券<br>26,500株          |
| ノエビアホールディングス     | 16,000  | 5,240.00  | 83,840,000    |                            |
| アジュバンホールディングス    | 1,900   | 939.00    | 1,784,100     |                            |
| 新日本製薬            | 10,200  | 1,723.00  | 17,574,600    |                            |
| I－n－e            | 3,600   | 2,093.00  | 7,534,800     | 貸付有価証券<br>600株             |
| アクシージア           | 8,800   | 851.00    | 7,488,800     | 貸付有価証券<br>100株             |
| エステー             | 13,800  | 1,549.00  | 21,376,200    |                            |
| アグロ カネショウ        | 7,200   | 1,267.00  | 9,122,400     |                            |
| コニシ              | 51,800  | 1,386.00  | 71,794,800    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 長谷川香料            | 34,300  | 3,190.00  | 109,417,000   | 貸付有価証券<br>1,300株           |
| 小林製薬             | 52,200  | 6,099.00  | 318,367,800   |                            |
| 荒川化学工業           | 15,200  | 1,121.00  | 17,039,200    |                            |
| メック              | 14,800  | 4,180.00  | 61,864,000    | 貸付有価証券<br>400株             |
| 日本高純度化学          | 4,100   | 2,741.00  | 11,238,100    |                            |
| タカラバイオ           | 48,300  | 1,069.00  | 51,632,700    | 貸付有価証券<br>1,400株           |
| J C U            | 20,000  | 4,040.00  | 80,800,000    |                            |
| 新田ゼラチン           | 5,400   | 678.00    | 3,661,200     | 貸付有価証券<br>500株（200株）       |
| O A Tアグリオ        | 5,900   | 1,690.00  | 9,971,000     | 貸付有価証券<br>900株（600株）       |
| デクセリアルズ          | 45,000  | 5,976.00  | 268,920,000   |                            |
| アース製薬            | 16,300  | 4,175.00  | 68,052,500    | 貸付有価証券<br>5,800株（1,900株）   |
| 北興化学工業           | 18,000  | 1,074.00  | 19,332,000    |                            |
| 大成ラミック           | 5,200   | 3,075.00  | 15,990,000    |                            |
| クミアイ化学工業         | 71,200  | 831.00    | 59,167,200    | 貸付有価証券<br>4,100株           |
| 日本農薬             | 32,900  | 715.00    | 23,523,500    | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| アキレス             | 11,300  | 1,483.00  | 16,757,900    |                            |
| 有沢製作所            | 31,400  | 1,158.00  | 36,361,200    | 貸付有価証券<br>300株             |
| 日東電工             | 115,200 | 14,045.00 | 1,617,984,000 | 貸付有価証券                     |

|                     |           |          |               |                            |
|---------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
|                     |           |          |               | 6,800株                     |
| レック                 | 23,000    | 1,097.00 | 25,231,000    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 三光合成                | 22,600    | 642.00   | 14,509,200    |                            |
| きもと                 | 13,200    | 207.00   | 2,732,400     | 貸付有価証券<br>500株             |
| 藤森工業                | 14,200    | 3,870.00 | 54,954,000    |                            |
| 前澤化成工業              | 11,600    | 1,574.00 | 18,258,400    | 貸付有価証券<br>5,300株           |
| 未来工業                | 6,400     | 5,260.00 | 33,664,000    |                            |
| ウェーブロックホール<br>ディングス | 3,000     | 679.00   | 2,037,000     |                            |
| J S P               | 12,600    | 2,182.00 | 27,493,200    | 貸付有価証券<br>5,900株           |
| エフピコ                | 33,900    | 2,870.00 | 97,293,000    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 天馬                  | 13,000    | 2,414.00 | 31,382,000    |                            |
| 信越ポリマー              | 38,700    | 1,619.00 | 62,655,300    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 東リ                  | 17,700    | 400.00   | 7,080,000     | 貸付有価証券<br>900株             |
| ニフコ                 | 53,600    | 3,749.00 | 200,946,400   |                            |
| バルカー                | 15,000    | 4,450.00 | 66,750,000    | 貸付有価証券<br>400株             |
| ユニ・チャーム             | 373,600   | 5,174.00 | 1,933,006,400 | 貸付有価証券<br>19,500株（1,200株）  |
| ショーエイコーポレー<br>ション   | 2,500     | 616.00   | 1,540,000     |                            |
| 協和キリン               | 216,700   | 2,858.00 | 619,328,600   | 貸付有価証券<br>19,300株          |
| 武田薬品工業              | 1,587,300 | 4,435.00 | 7,039,675,500 | 貸付有価証券<br>74,900株          |
| アステラス製薬             | 1,573,200 | 1,682.50 | 2,646,909,000 | 貸付有価証券<br>3,000株           |
| 住友ファーマ              | 133,000   | 368.00   | 48,944,000    | 貸付有価証券<br>60,900株（34,200株） |
| 塩野義製薬               | 226,100   | 7,135.00 | 1,613,223,500 | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| わかもと製薬              | 8,400     | 208.00   | 1,747,200     | 貸付有価証券<br>4,900株（4,700株）   |
| 日本新薬                | 47,000    | 4,962.00 | 233,214,000   |                            |
| 中外製薬                | 561,400   | 5,779.00 | 3,244,330,600 | 貸付有価証券<br>37,200株          |
| 科研製薬                | 30,700    | 3,588.00 | 110,151,600   |                            |
| エーザイ                | 218,200   | 6,297.00 | 1,374,005,400 | 貸付有価証券<br>100株             |
| ロート製薬               | 173,700   | 2,944.50 | 511,459,650   |                            |
| 小野薬品工業              | 380,600   | 2,418.00 | 920,290,800   | 貸付有価証券<br>1,700株           |
| 久光製薬                | 39,900    | 4,030.00 | 160,797,000   | 貸付有価証券<br>7,600株           |
| 持田製薬                | 20,600    | 3,175.00 | 65,405,000    |                            |
| 参天製薬                | 326,900   | 1,539.00 | 503,099,100   | 貸付有価証券<br>1,300株（1,300株）   |
| 扶桑薬品工業              | 6,300     | 2,212.00 | 13,935,600    |                            |
| 日本ケミファ              | 900       | 1,615.00 | 1,453,500     |                            |

|                  |           |          |               |                           |
|------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| ツムラ              | 56,500    | 2,766.50 | 156,307,250   |                           |
| キッセイ薬品工業         | 29,700    | 3,320.00 | 98,604,000    | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| 生化学工業            | 30,400    | 760.00   | 23,104,000    | 貸付有価証券<br>2,900株          |
| 栄研化学             | 32,900    | 1,896.00 | 62,378,400    | 貸付有価証券<br>2,000株          |
| 鳥居薬品             | 9,600     | 4,030.00 | 38,688,000    |                           |
| J C R ファーマ       | 60,700    | 928.00   | 56,329,600    | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| 東和薬品             | 27,600    | 3,065.00 | 84,594,000    | 貸付有価証券<br>100株            |
| 富士製薬工業           | 13,200    | 1,796.00 | 23,707,200    | 貸付有価証券<br>2,600株          |
| ゼリア新薬工業          | 24,900    | 2,173.00 | 54,107,700    |                           |
| ソーせいグループ         | 58,900    | 1,382.00 | 81,399,800    | 貸付有価証券<br>27,200株（200株）   |
| 第一三共             | 1,562,400 | 4,873.00 | 7,613,575,200 | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| 杏林製薬             | 38,900    | 1,772.00 | 68,930,800    |                           |
| 大幸薬品             | 37,100    | 336.00   | 12,465,600    | 貸付有価証券<br>16,200株（4,500株） |
| ダイト              | 13,800    | 1,987.00 | 27,420,600    |                           |
| 大塚ホールディングス       | 373,000   | 5,512.00 | 2,055,976,000 | 貸付有価証券<br>26,900株         |
| 大正製薬ホールディングス     | 39,900    | 8,593.00 | 342,860,700   |                           |
| ペプチドリーム          | 86,900    | 1,550.00 | 134,695,000   | 貸付有価証券<br>11,900株         |
| セルソース            | 5,000     | 1,312.00 | 6,560,000     | 貸付有価証券<br>2,300株（2,200株）  |
| あすか製薬ホールディングス    | 18,400    | 2,045.00 | 37,628,000    |                           |
| サワイグループホールディングス  | 41,000    | 5,900.00 | 241,900,000   | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| 日本コークス工業         | 182,000   | 118.00   | 21,476,000    | 貸付有価証券<br>22,600株         |
| ニチレキ             | 23,300    | 2,439.00 | 56,828,700    | 貸付有価証券<br>100株            |
| ユシロ化学工業          | 9,300     | 2,168.00 | 20,162,400    |                           |
| ビーピー・カストロール      | 3,100     | 911.00   | 2,824,100     | 貸付有価証券<br>1,400株          |
| 富士石油             | 52,300    | 339.00   | 17,729,700    | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| MORESCO          | 2,900     | 1,445.00 | 4,190,500     | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| 出光興産             | 995,900   | 927.50   | 923,697,250   |                           |
| ENEOSホールディングス    | 2,839,400 | 653.90   | 1,856,683,660 | 貸付有価証券<br>10,100株         |
| コスモエネルギーホールディングス | 53,200    | 6,552.00 | 348,566,400   |                           |
| 横浜ゴム             | 90,700    | 4,052.00 | 367,516,400   | 貸付有価証券<br>9,900株          |
| TOYO TIRE        | 103,100   | 2,872.00 | 296,103,200   | 貸付有価証券<br>48,200株         |
| ブリヂストン           | 525,000   | 6,288.00 | 3,301,200,000 | 貸付有価証券<br>14,400株         |
| 住友ゴム工業           | 175,900   | 1,754.00 | 308,528,600   | 貸付有価証券                    |

|                    |         |           |             |                          |
|--------------------|---------|-----------|-------------|--------------------------|
|                    |         |           |             | 20,600株                  |
| 藤倉コンポジット           | 13,800  | 1,448.00  | 19,982,400  |                          |
| オカモト               | 8,500   | 4,855.00  | 41,267,500  |                          |
| フコク                | 9,400   | 1,550.00  | 14,570,000  |                          |
| ニッタ                | 18,200  | 3,740.00  | 68,068,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| 住友理工               | 27,800  | 1,115.00  | 30,997,000  |                          |
| 三ツ星ベルト             | 21,800  | 4,920.00  | 107,256,000 | 貸付有価証券<br>1,400株（900株）   |
| バンドー化学             | 26,600  | 1,717.00  | 45,672,200  |                          |
| 日東紡績               | 22,700  | 4,905.00  | 111,343,500 | 貸付有価証券<br>8,400株         |
| A G C              | 159,900 | 5,420.00  | 866,658,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日本板硝子              | 85,600  | 541.00    | 46,309,600  | 貸付有価証券<br>7,600株         |
| 石塚硝子               | 1,400   | 3,275.00  | 4,585,000   | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 日本山村硝子             | 3,000   | 1,480.00  | 4,440,000   | 貸付有価証券<br>1,400株（500株）   |
| 日本電気硝子             | 73,200  | 3,589.00  | 262,714,800 | 貸付有価証券<br>5,500株         |
| オハラ                | 8,500   | 1,176.00  | 9,996,000   | 貸付有価証券<br>3,900株（2,000株） |
| 住友大阪セメント           | 29,800  | 3,665.00  | 109,217,000 | 貸付有価証券<br>300株           |
| 太平洋セメント            | 106,000 | 3,254.00  | 344,924,000 | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 日本ヒューム             | 15,700  | 878.00    | 13,784,600  |                          |
| 日本コンクリート工業         | 34,800  | 456.00    | 15,868,800  | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| 三谷セキサン             | 7,500   | 5,680.00  | 42,600,000  |                          |
| アジアパイルホールディ<br>ングス | 25,500  | 791.00    | 20,170,500  |                          |
| 東海カーボン             | 165,500 | 1,030.50  | 170,547,750 | 貸付有価証券<br>30,400株        |
| 日本カーボン             | 9,500   | 5,440.00  | 51,680,000  | 貸付有価証券<br>100株           |
| 東洋炭素               | 12,600  | 6,820.00  | 85,932,000  | 貸付有価証券<br>700株           |
| ノリタケカンパニーリミ<br>テド  | 9,900   | 7,990.00  | 79,101,000  | 貸付有価証券<br>300株           |
| T O T O            | 118,300 | 3,747.00  | 443,270,100 | 貸付有価証券<br>1,800株         |
| 日本碍子               | 208,600 | 1,923.50  | 401,242,100 | 貸付有価証券<br>3,800株         |
| 日本特殊陶業             | 150,200 | 4,319.00  | 648,713,800 |                          |
| ダントーホールディング<br>ス   | 5,300   | 949.00    | 5,029,700   | 貸付有価証券<br>3,500株         |
| M A R U W A        | 6,600   | 31,500.00 | 207,900,000 | 貸付有価証券<br>300株           |
| 品川リフラクトリーズ         | 22,100  | 2,103.00  | 46,476,300  |                          |
| 黒崎播磨               | 3,700   | 13,760.00 | 50,912,000  | 貸付有価証券<br>100株           |
| ヨータイ               | 11,100  | 1,445.00  | 16,039,500  |                          |
| 東京窯業               | 8,500   | 472.00    | 4,012,000   | 貸付有価証券<br>100株           |

|               |         |          |               |                              |
|---------------|---------|----------|---------------|------------------------------|
| ニッカトー         | 3,600   | 580.00   | 2,088,000     |                              |
| フジミインコーポレーテッド | 48,200  | 3,270.00 | 157,614,000   |                              |
| クニミネ工業        | 2,300   | 1,019.00 | 2,343,700     |                              |
| エーアンドエーマテリアル  | 1,700   | 1,341.00 | 2,279,700     |                              |
| ニチアス          | 45,300  | 3,745.00 | 169,648,500   |                              |
| ニチハ           | 22,500  | 3,500.00 | 78,750,000    |                              |
| 日本製鉄          | 826,100 | 3,585.00 | 2,961,568,500 | 貸付有価証券<br>218,800株（218,800株） |
| 神戸製鋼所         | 371,100 | 2,035.50 | 755,374,050   |                              |
| 中山製鋼所         | 42,200  | 933.00   | 39,372,600    | 貸付有価証券<br>3,900株             |
| 合同製鐵          | 10,300  | 6,020.00 | 62,006,000    |                              |
| J F Eホールディングス | 513,100 | 2,332.50 | 1,196,805,750 | 貸付有価証券<br>3,700株（3,700株）     |
| 東京製鐵          | 51,800  | 1,720.00 | 89,096,000    | 貸付有価証券<br>4,100株             |
| 共英製鋼          | 21,000  | 2,292.00 | 48,132,000    | 貸付有価証券<br>100株               |
| 大和工業          | 34,800  | 8,533.00 | 296,948,400   |                              |
| 東京鐵鋼          | 8,100   | 5,370.00 | 43,497,000    | 貸付有価証券<br>1,700株             |
| 大阪製鐵          | 8,500   | 2,369.00 | 20,136,500    | 貸付有価証券<br>900株               |
| 淀川製鋼所         | 21,000  | 4,280.00 | 89,880,000    |                              |
| 中部鋼鈑          | 12,100  | 2,524.00 | 30,540,400    | 貸付有価証券<br>100株               |
| 丸一鋼管          | 56,200  | 3,994.00 | 224,462,800   |                              |
| モリ工業          | 3,700   | 4,785.00 | 17,704,500    |                              |
| 大同特殊鋼         | 116,200 | 1,770.50 | 205,732,100   | 貸付有価証券<br>3,600株             |
| 日本高周波鋼業       | 3,100   | 604.00   | 1,872,400     | 貸付有価証券<br>1,800株（1,600株）     |
| 日本冶金工業        | 13,500  | 4,550.00 | 61,425,000    | 貸付有価証券<br>2,300株             |
| 山陽特殊製鋼        | 18,200  | 2,230.00 | 40,586,000    |                              |
| 愛知製鋼          | 10,600  | 3,530.00 | 37,418,000    | 貸付有価証券<br>100株               |
| 日本金属          | 2,200   | 857.00   | 1,885,400     | 貸付有価証券<br>700株               |
| 大平洋金属         | 15,700  | 1,404.00 | 22,042,800    | 貸付有価証券<br>7,300株（400株）       |
| 新日本電工         | 91,800  | 304.00   | 27,907,200    | 貸付有価証券<br>1,300株             |
| 栗本鐵工所         | 8,600   | 3,300.00 | 28,380,000    |                              |
| 虹技            | 1,100   | 1,535.00 | 1,688,500     |                              |
| 日本鑄鉄管         | 900     | 1,151.00 | 1,035,900     |                              |
| 三菱製鋼          | 13,700  | 1,436.00 | 19,673,200    | 貸付有価証券<br>800株               |
| 日亜鋼業          | 8,300   | 345.00   | 2,863,500     |                              |
| 日本精線          | 2,900   | 5,720.00 | 16,588,000    |                              |
| エンビプロ・ホールディ   | 14,500  | 504.00   | 7,308,000     | 貸付有価証券                       |

|                             |         |          |               |                           |
|-----------------------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| ングス                         |         |          |               | 800株（100株）                |
| シンニッタン                      | 10,300  | 275.00   | 2,832,500     | 貸付有価証券<br>100株            |
| 新家工業                        | 1,800   | 3,530.00 | 6,354,000     |                           |
| 大紀アルミニウム工業所                 | 23,300  | 1,240.00 | 28,892,000    | 貸付有価証券<br>7,200株（100株）    |
| 日本軽金属ホールディングス               | 53,900  | 1,737.00 | 93,624,300    | 貸付有価証券<br>700株（600株）      |
| 三井金属鉱業                      | 53,700  | 4,385.00 | 235,474,500   | 貸付有価証券<br>400株            |
| 東邦亜鉛                        | 11,800  | 1,073.00 | 12,661,400    | 貸付有価証券<br>4,700株（2,400株）  |
| 三菱マテリアル                     | 131,900 | 2,622.00 | 345,841,800   | 貸付有価証券<br>700株            |
| 住友金属鉱山                      | 213,900 | 4,105.00 | 878,059,500   |                           |
| DOWAホールディングス                | 45,600  | 5,616.00 | 256,089,600   | 貸付有価証券<br>700株            |
| 古河機械金属                      | 24,300  | 1,777.00 | 43,181,100    |                           |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ              | 32,000  | 2,756.00 | 88,192,000    | 貸付有価証券<br>15,000株         |
| 東邦チタニウム                     | 38,100  | 1,756.00 | 66,903,600    | 貸付有価証券<br>10,800株         |
| U A C J                     | 25,900  | 4,175.00 | 108,132,500   |                           |
| C Kサンエツ                     | 4,400   | 3,840.00 | 16,896,000    |                           |
| 古河電気工業                      | 61,400  | 2,899.50 | 178,029,300   | 貸付有価証券<br>9,100株（900株）    |
| 住友電気工業                      | 690,200 | 2,151.50 | 1,484,965,300 |                           |
| フジクラ                        | 217,600 | 1,759.50 | 382,867,200   | 貸付有価証券<br>800株            |
| SWC C                       | 20,600  | 3,340.00 | 68,804,000    |                           |
| タツタ電線                       | 32,800  | 692.00   | 22,697,600    | 貸付有価証券<br>15,400株（9,400株） |
| カナレ電気                       | 1,400   | 1,730.00 | 2,422,000     |                           |
| 平河ヒューテック                    | 11,800  | 1,358.00 | 16,024,400    | 貸付有価証券<br>4,100株          |
| リョービ                        | 19,600  | 2,660.00 | 52,136,000    | 貸付有価証券<br>8,700株          |
| アーレスティ                      | 9,100   | 786.00   | 7,152,600     | 貸付有価証券<br>2,200株（1,300株）  |
| A R Eホールディングス               | 69,300  | 1,958.00 | 135,689,400   | 貸付有価証券<br>500株            |
| 稲葉製作所                       | 9,100   | 1,515.00 | 13,786,500    | 貸付有価証券<br>4,200株          |
| 宮地エンジニアリンググループ              | 9,300   | 3,965.00 | 36,874,500    |                           |
| トーカロ                        | 53,200  | 1,618.00 | 86,077,600    | 貸付有価証券<br>300株（100株）      |
| アルファC o                     | 3,000   | 1,643.00 | 4,929,000     |                           |
| SUMCO                       | 327,800 | 2,210.00 | 724,438,000   | 貸付有価証券<br>73,800株         |
| 川田テクノロジーズ                   | 4,400   | 9,110.00 | 40,084,000    |                           |
| R S T e c h n o l o g i e s | 12,300  | 2,591.00 | 31,869,300    | 貸付有価証券<br>200株            |
| ジェイテックコーポレーション              | 1,400   | 2,089.00 | 2,924,600     | 貸付有価証券<br>600株（300株）      |
| 信和                          | 5,300   | 745.00   | 3,948,500     |                           |

|                  |         |          |             |                          |
|------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 東洋製罐グループホールディングス | 105,800 | 2,495.50 | 264,023,900 |                          |
| ホッカンホールディングス     | 9,000   | 1,850.00 | 16,650,000  |                          |
| コロナ              | 10,300  | 969.00   | 9,980,700   |                          |
| 横河ブリッジホールディングス   | 28,900  | 2,766.00 | 79,937,400  | 貸付有価証券<br>200株           |
| 駒井ハルテック          | 1,500   | 2,139.00 | 3,208,500   |                          |
| 高田機工             | 600     | 3,455.00 | 2,073,000   |                          |
| 三和ホールディングス       | 185,400 | 2,656.00 | 492,422,400 | 貸付有価証券<br>1,800株（800株）   |
| 文化シャッター          | 48,300  | 1,606.00 | 77,569,800  |                          |
| 三協立山             | 23,200  | 886.00   | 20,555,200  | 貸付有価証券<br>1,000株（700株）   |
| アルインコ            | 14,100  | 1,046.00 | 14,748,600  | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 東洋シャッター          | 1,900   | 728.00   | 1,383,200   |                          |
| L I X I L        | 288,100 | 1,961.00 | 564,964,100 |                          |
| 日本ファイルコン         | 5,300   | 550.00   | 2,915,000   |                          |
| ノーリツ             | 30,600  | 1,654.00 | 50,612,400  | 貸付有価証券<br>900株           |
| 長府製作所            | 18,300  | 2,103.00 | 38,484,900  | 貸付有価証券<br>200株           |
| リンナイ             | 88,300  | 3,527.00 | 311,434,100 | 貸付有価証券<br>3,800株（1,600株） |
| ダイニチ工業           | 4,100   | 703.00   | 2,882,300   |                          |
| 日東精工             | 26,700  | 580.00   | 15,486,000  | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 三洋工業             | 900     | 3,625.00 | 3,262,500   |                          |
| 岡部               | 33,000  | 826.00   | 27,258,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| ジーテクト            | 23,500  | 2,007.00 | 47,164,500  |                          |
| 東プレ              | 32,500  | 2,295.00 | 74,587,500  | 貸付有価証券<br>300株           |
| 高周波熱錬            | 28,500  | 1,080.00 | 30,780,000  |                          |
| 東京製綱             | 12,000  | 1,555.00 | 18,660,000  |                          |
| サンコール            | 16,400  | 470.00   | 7,708,000   |                          |
| モリテック スチール       | 7,200   | 265.00   | 1,908,000   | 貸付有価証券<br>400株           |
| パイオラックス          | 22,900  | 2,685.00 | 61,486,500  | 貸付有価証券<br>400株           |
| エイチワン            | 19,000  | 690.00   | 13,110,000  |                          |
| 日本発條             | 163,200 | 1,472.50 | 240,312,000 | 貸付有価証券<br>9,500株         |
| 中央発條             | 13,700  | 740.00   | 10,138,000  | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| アドバネクス           | 1,000   | 1,086.00 | 1,086,000   | 貸付有価証券<br>400株           |
| 立川ブラインド工業        | 8,300   | 1,466.00 | 12,167,800  |                          |
| 三益半導体工業          | 16,600  | 3,160.00 | 52,456,000  |                          |
| 日本ドライケミカル        | 1,900   | 2,618.00 | 4,974,200   |                          |
| 日本製鋼所            | 49,800  | 2,497.00 | 124,350,600 |                          |
| 三浦工業             | 75,400  | 2,961.00 | 223,259,400 | 貸付有価証券                   |

|              |         |           |               |                            |
|--------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
|              |         |           |               | 200株                       |
| タクマ          | 61,100  | 1,911.00  | 116,762,100   | 貸付有価証券<br>2,900株           |
| ツガミ          | 40,100  | 1,149.00  | 46,074,900    | 貸付有価証券<br>2,400株           |
| オークマ         | 15,800  | 7,060.00  | 111,548,000   | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| 芝浦機械         | 18,000  | 3,400.00  | 61,200,000    |                            |
| アマダ          | 288,200 | 1,605.00  | 462,561,000   |                            |
| アイダエンジニアリング  | 41,800  | 846.00    | 35,362,800    | 貸付有価証券<br>600株             |
| F U J I      | 85,000  | 2,616.50  | 222,402,500   | 貸付有価証券<br>200株             |
| 牧野フライス製作所    | 20,000  | 5,770.00  | 115,400,000   |                            |
| オーエスジー       | 79,600  | 2,105.50  | 167,597,800   | 貸付有価証券<br>20,600株          |
| ダイジェット工業     | 800     | 833.00    | 666,400       |                            |
| 旭ダイヤモンド工業    | 41,600  | 865.00    | 35,984,000    | 貸付有価証券<br>200株             |
| DMG森精機       | 109,500 | 3,377.00  | 369,781,500   | 貸付有価証券<br>51,500株（38,100株） |
| ソディック        | 44,000  | 723.00    | 31,812,000    | 貸付有価証券<br>500株             |
| ディスコ         | 87,000  | 43,540.00 | 3,787,980,000 |                            |
| 日東工器         | 8,700   | 1,915.00  | 16,660,500    |                            |
| 日進工具         | 16,700  | 1,000.00  | 16,700,000    |                            |
| パンチ工業        | 7,900   | 422.00    | 3,333,800     | 貸付有価証券<br>3,200株（2,300株）   |
| 富士ダイス        | 10,700  | 679.00    | 7,265,300     |                            |
| 豊和工業         | 4,400   | 765.00    | 3,366,000     | 貸付有価証券<br>400株（200株）       |
| リケンNPR       | 19,600  | 2,998.00  | 58,760,800    | 貸付有価証券<br>2,400株           |
| 東洋機械金属       | 6,600   | 707.00    | 4,666,200     | 貸付有価証券<br>300株             |
| 津田駒工業        | 1,500   | 374.00    | 561,000       | 貸付有価証券<br>900株             |
| エンシュウ        | 1,900   | 687.00    | 1,305,300     |                            |
| 島精機製作所       | 28,700  | 1,405.00  | 40,323,500    | 貸付有価証券<br>700株（400株）       |
| オプトラン        | 29,700  | 1,790.00  | 53,163,000    | 貸付有価証券<br>300株             |
| NCホールディングス   | 1,900   | 1,512.00  | 2,872,800     |                            |
| イワキポンプ       | 12,000  | 2,343.00  | 28,116,000    |                            |
| フリーー         | 17,000  | 1,234.00  | 20,978,000    |                            |
| ヤマシンフィルタ     | 43,400  | 361.00    | 15,667,400    | 貸付有価証券<br>300株             |
| 日阪製作所        | 19,700  | 985.00    | 19,404,500    |                            |
| やまびこ         | 29,500  | 1,830.00  | 53,985,000    | 貸付有価証券<br>400株             |
| 野村マイクロ・サイエンス | 6,100   | 14,280.00 | 87,108,000    | 貸付有価証券<br>2,800株（100株）     |
| 平田機工         | 8,600   | 7,520.00  | 64,672,000    | 貸付有価証券<br>200株             |
| PEGASUS      | 19,900  | 464.00    | 9,233,600     | 貸付有価証券                     |



|                    |         |           |               |                          |
|--------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
|                    |         |           |               | 8,600株（8,500株）           |
| マルマエ               | 7,900   | 1,930.00  | 15,247,000    | 貸付有価証券<br>3,700株（100株）   |
| タツモ                | 10,900  | 3,845.00  | 41,910,500    | 貸付有価証券<br>5,100株（5,000株） |
| ナブテスコ              | 113,300 | 2,442.50  | 276,735,250   | 貸付有価証券<br>53,600株        |
| 三井海洋開発             | 22,900  | 3,035.00  | 69,501,500    | 貸付有価証券<br>100株           |
| レオン自動機             | 20,900  | 1,398.00  | 29,218,200    |                          |
| SMC                | 54,100  | 82,860.00 | 4,482,726,000 | 貸付有価証券<br>1,500株         |
| ホソカワミクロン           | 11,600  | 4,250.00  | 49,300,000    |                          |
| ユニオンツール            | 7,900   | 3,785.00  | 29,901,500    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 瑞光                 | 13,000  | 1,827.00  | 23,751,000    | 貸付有価証券<br>6,100株         |
| オイレス工業             | 24,500  | 2,054.00  | 50,323,000    | 貸付有価証券<br>5,100株         |
| 日精エー・エス・ビー機<br>械   | 7,200   | 4,360.00  | 31,392,000    |                          |
| サトーホールディングス        | 25,700  | 2,243.00  | 57,645,100    |                          |
| 技研製作所              | 17,000  | 2,098.00  | 35,666,000    | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 日本エアーテック           | 8,400   | 1,157.00  | 9,718,800     | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| カワタ                | 2,500   | 1,048.00  | 2,620,000     |                          |
| 日精樹脂工業             | 13,400  | 1,132.00  | 15,168,800    |                          |
| オカダアイヨン            | 2,700   | 2,809.00  | 7,584,300     |                          |
| ワイエイシイホールディ<br>ングス | 6,800   | 2,294.00  | 15,599,200    | 貸付有価証券<br>3,100株（1,000株） |
| 小松製作所              | 846,600 | 4,319.00  | 3,656,465,400 |                          |
| 住友重機械工業            | 106,800 | 4,489.00  | 479,425,200   |                          |
| 日立建機               | 71,900  | 4,219.00  | 303,346,100   |                          |
| 日工                 | 26,700  | 761.00    | 20,318,700    |                          |
| 巴工業                | 7,000   | 3,730.00  | 26,110,000    |                          |
| 井関農機               | 16,900  | 1,009.00  | 17,052,100    | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| TOWA               | 20,100  | 7,830.00  | 157,383,000   |                          |
| 丸山製作所              | 1,300   | 2,352.00  | 3,057,600     |                          |
| 北川鉄工所              | 7,100   | 1,580.00  | 11,218,000    |                          |
| ローツェ               | 9,400   | 19,860.00 | 186,684,000   |                          |
| タカキタ               | 2,600   | 481.00    | 1,250,600     |                          |
| クボタ                | 944,200 | 2,182.50  | 2,060,716,500 | 貸付有価証券<br>93,300株        |
| 荏原実業               | 9,500   | 3,170.00  | 30,115,000    |                          |
| 三菱化工機              | 6,400   | 3,850.00  | 24,640,000    |                          |
| 月島ホールディングス         | 24,400  | 1,327.00  | 32,378,800    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 帝国電機製作所            | 12,700  | 2,704.00  | 34,340,800    |                          |
| 東京機械製作所            | 2,100   | 443.00    | 930,300       | 貸付有価証券<br>100株           |
| 新東工業               | 36,500  | 1,150.00  | 41,975,000    |                          |

|                     |         |           |               |                   |
|---------------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 澁谷工業                | 16,900  | 3,135.00  | 52,981,500    |                   |
| アイチ コーポレーショ<br>ン    | 25,100  | 1,113.00  | 27,936,300    |                   |
| 小森コーポレーション          | 44,500  | 1,305.00  | 58,072,500    |                   |
| 鶴見製作所               | 13,800  | 3,315.00  | 45,747,000    | 貸付有価証券<br>100株    |
| 日本ギア工業              | 3,100   | 634.00    | 1,965,400     | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| 酒井重工業               | 2,800   | 6,480.00  | 18,144,000    |                   |
| 荏原製作所               | 74,100  | 11,000.00 | 815,100,000   | 貸付有価証券<br>18,800株 |
| 石井鐵工所               | 900     | 2,760.00  | 2,484,000     | 貸付有価証券<br>500株    |
| 西島製作所               | 15,500  | 2,500.00  | 38,750,000    | 貸付有価証券<br>100株    |
| 北越工業                | 18,200  | 2,493.00  | 45,372,600    |                   |
| ダイキン工業              | 215,600 | 21,420.00 | 4,618,152,000 | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| オルガノ                | 21,700  | 6,760.00  | 146,692,000   |                   |
| トーヨーカネツ             | 6,100   | 4,500.00  | 27,450,000    |                   |
| 栗田工業                | 101,000 | 5,881.00  | 593,981,000   | 貸付有価証券<br>100株    |
| 椿本チエイン              | 25,600  | 4,695.00  | 120,192,000   |                   |
| 大同工業                | 3,500   | 753.00    | 2,635,500     |                   |
| 木村化工機               | 13,800  | 721.00    | 9,949,800     |                   |
| アネスト岩田              | 27,900  | 1,331.00  | 37,134,900    |                   |
| ダイフク                | 304,800 | 3,332.00  | 1,015,593,600 | 貸付有価証券<br>900株    |
| サムコ                 | 4,800   | 5,020.00  | 24,096,000    | 貸付有価証券<br>1,200株  |
| 加藤製作所               | 4,100   | 1,425.00  | 5,842,500     | 貸付有価証券<br>200株    |
| 油研工業                | 1,300   | 2,390.00  | 3,107,000     |                   |
| タダノ                 | 103,900 | 1,300.50  | 135,121,950   |                   |
| フジテック               | 42,200  | 3,699.00  | 156,097,800   |                   |
| C K D               | 50,000  | 2,767.00  | 138,350,000   | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| 平和                  | 53,400  | 2,070.00  | 110,538,000   |                   |
| 理想科学工業              | 14,400  | 3,275.00  | 47,160,000    |                   |
| S A N K Y O         | 41,500  | 9,089.00  | 377,193,500   |                   |
| 日本金銭機械              | 21,800  | 1,424.00  | 31,043,200    | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| マースグループホール<br>ディングス | 9,100   | 2,826.00  | 25,716,600    | 貸付有価証券<br>2,300株  |
| フクシマガリレイ            | 11,800  | 5,780.00  | 68,204,000    |                   |
| オーイズミ               | 3,000   | 415.00    | 1,245,000     |                   |
| ダイコク電機              | 8,900   | 4,390.00  | 39,071,000    | 貸付有価証券<br>4,500株  |
| 竹内製作所               | 32,800  | 5,120.00  | 167,936,000   | 貸付有価証券<br>4,400株  |
| アマノ                 | 51,300  | 3,732.00  | 191,451,600   |                   |
| J U K I             | 28,000  | 502.00    | 14,056,000    | 貸付有価証券<br>5,200株  |

|               |           |           |                |                            |
|---------------|-----------|-----------|----------------|----------------------------|
| ジャノメ          | 18,300    | 683.00    | 12,498,900     |                            |
| マックス          | 25,400    | 3,100.00  | 78,740,000     |                            |
| グローリー         | 43,400    | 2,905.00  | 126,077,000    |                            |
| 新晃工業          | 18,200    | 3,085.00  | 56,147,000     |                            |
| 大和冷機工業        | 27,700    | 1,470.00  | 40,719,000     |                            |
| セガサミーホールディングス | 161,300   | 1,795.50  | 289,614,150    |                            |
| T P R         | 22,900    | 2,121.00  | 48,570,900     | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| ツバキ・ナカシマ      | 36,200    | 765.00    | 27,693,000     | 貸付有価証券<br>8,100株（4,400株）   |
| ホシザキ          | 106,600   | 5,436.00  | 579,477,600    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 大豊工業          | 15,600    | 832.00    | 12,979,200     |                            |
| 日本精工          | 334,400   | 790.90    | 264,476,960    |                            |
| NTN           | 391,700   | 289.00    | 113,201,300    | 貸付有価証券<br>39,100株（39,100株） |
| ジェイテクト        | 160,700   | 1,350.00  | 216,945,000    | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| 不二越           | 13,300    | 3,325.00  | 44,222,500     | 貸付有価証券<br>3,600株（700株）     |
| 日本トムソン        | 49,200    | 607.00    | 29,864,400     | 貸付有価証券<br>600株（100株）       |
| THK           | 104,200   | 3,092.00  | 322,186,400    | 貸付有価証券<br>18,900株          |
| ユーシン精機        | 14,300    | 674.00    | 9,638,200      |                            |
| 前澤給装工業        | 13,800    | 1,299.00  | 17,926,200     |                            |
| イーグル工業        | 20,000    | 1,806.00  | 36,120,000     |                            |
| 前澤工業          | 5,100     | 1,063.00  | 5,421,300      |                            |
| 日本ピラー工業       | 16,700    | 5,530.00  | 92,351,000     |                            |
| キット           | 60,400    | 1,288.00  | 77,795,200     | 貸付有価証券<br>1,800株（100株）     |
| マキタ           | 206,000   | 3,857.00  | 794,542,000    |                            |
| 三井E & S       | 89,600    | 1,241.00  | 111,193,600    | 貸付有価証券<br>17,300株          |
| 日立造船          | 159,400   | 1,039.00  | 165,616,600    | 貸付有価証券<br>1,900株（200株）     |
| 三菱重工業         | 315,800   | 11,270.00 | 3,559,066,000  |                            |
| I H I         | 134,500   | 3,138.00  | 422,061,000    | 貸付有価証券<br>15,100株          |
| サノヤスホールディングス  | 11,700    | 147.00    | 1,719,900      |                            |
| スター精密         | 33,600    | 1,646.00  | 55,305,600     |                            |
| 日清紡ホールディングス   | 135,800   | 1,257.50  | 170,768,500    | 貸付有価証券<br>9,500株（200株）     |
| イビデン          | 94,200    | 7,157.00  | 674,189,400    | 貸付有価証券<br>9,400株（1,600株）   |
| コニカミノルタ       | 403,400   | 473.60    | 191,050,240    |                            |
| ブラザー工業        | 241,300   | 2,502.50  | 603,853,250    | 貸付有価証券<br>9,100株（200株）     |
| ミネベアミツミ       | 314,200   | 3,039.00  | 954,853,800    | 貸付有価証券<br>24,500株（2,600株）  |
| 日立製作所         | 868,000   | 12,185.00 | 10,576,580,000 |                            |
| 三菱電機          | 2,010,200 | 2,276.00  | 4,575,215,200  | 貸付有価証券                     |

|                   |         |          |               |                            |
|-------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
|                   |         |          |               | 7,900株                     |
| 富士電機              | 109,800 | 9,064.00 | 995,227,200   | 貸付有価証券<br>600株             |
| 東洋電機製造            | 2,900   | 1,062.00 | 3,079,800     |                            |
| 安川電機              | 196,200 | 5,439.00 | 1,067,131,800 | 貸付有価証券<br>10,700株          |
| シンフォニアテクノロジー      | 19,900  | 2,510.00 | 49,949,000    |                            |
| 明電舎               | 33,500  | 2,730.00 | 91,455,000    | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| オリジン              | 1,800   | 1,223.00 | 2,201,400     |                            |
| 山洋電気              | 7,800   | 6,070.00 | 47,346,000    |                            |
| デンヨー              | 13,800  | 2,342.00 | 32,319,600    |                            |
| PHCホールディングス       | 33,700  | 1,327.00 | 44,719,900    | 貸付有価証券<br>9,600株（200株）     |
| KOKUSAI ELECTRIC  | 69,800  | 4,710.00 | 328,758,000   | 貸付有価証券<br>10,200株（10,200株） |
| ソシオネクスト           | 131,100 | 3,842.00 | 503,686,200   | 貸付有価証券<br>31,300株          |
| 東芝テック             | 23,100  | 3,040.00 | 70,224,000    |                            |
| 芝浦メカトロニクス         | 10,300  | 6,710.00 | 69,113,000    | 貸付有価証券<br>3,300株           |
| マブチモーター           | 88,800  | 2,831.50 | 251,437,200   |                            |
| ニデック              | 398,700 | 5,724.00 | 2,282,158,800 | 貸付有価証券<br>3,400株           |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 11,300  | 374.00   | 4,226,200     |                            |
| トレックス・セミコンダクター    | 9,300   | 1,836.00 | 17,074,800    | 貸付有価証券<br>300株             |
| 東光高岳              | 10,900  | 2,393.00 | 26,083,700    | 貸付有価証券<br>100株             |
| ダブル・スコープ          | 51,700  | 756.00   | 39,085,200    | 貸付有価証券<br>24,200株（14,600株） |
| ダイヘン              | 18,100  | 7,070.00 | 127,967,000   | 貸付有価証券<br>100株             |
| ヤーマン              | 35,100  | 1,019.00 | 35,766,900    | 貸付有価証券<br>14,600株（3,900株）  |
| JVCケンウッド          | 142,600 | 715.00   | 101,959,000   | 貸付有価証券<br>1,800株（500株）     |
| ミマキエンジニアリング       | 17,100  | 1,003.00 | 17,151,300    |                            |
| IPEX              | 12,500  | 1,785.00 | 22,312,500    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,300株）   |
| 大崎電気工業            | 39,500  | 673.00   | 26,583,500    | 貸付有価証券<br>100株             |
| オムロン              | 137,900 | 5,535.00 | 763,276,500   | 貸付有価証券<br>800株             |
| 日東工業              | 24,300  | 4,250.00 | 103,275,000   |                            |
| IDEC              | 26,700  | 2,807.00 | 74,946,900    |                            |
| 正興電機製作所           | 2,700   | 1,164.00 | 3,142,800     |                            |
| 不二電機工業            | 1,600   | 1,139.00 | 1,822,400     | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| ジーエス・ユアサコーポレーション  | 70,500  | 2,722.50 | 191,936,250   |                            |
| サクサホールディングス       | 1,800   | 3,170.00 | 5,706,000     |                            |
| メルコホールディングス       | 5,700   | 3,220.00 | 18,354,000    |                            |
| テクノメディカ           | 4,400   | 1,804.00 | 7,937,600     |                            |

|                      |           |           |                |                           |
|----------------------|-----------|-----------|----------------|---------------------------|
| ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 6,700     | 687.00    | 4,602,900      | 貸付有価証券<br>300株（300株）      |
| 日本電気                 | 237,200   | 9,958.00  | 2,362,037,600  | 貸付有価証券<br>400株            |
| 富士通                  | 166,200   | 23,455.00 | 3,898,221,000  |                           |
| 沖電気工業                | 81,700    | 1,112.00  | 90,850,400     | 貸付有価証券<br>200株            |
| 岩崎通信機                | 3,800     | 632.00    | 2,401,600      |                           |
| 電気興業                 | 8,100     | 2,114.00  | 17,123,400     |                           |
| サンケン電気               | 16,800    | 7,872.00  | 132,249,600    |                           |
| ナカヨ                  | 1,300     | 1,161.00  | 1,509,300      |                           |
| アイホン                 | 9,700     | 2,810.00  | 27,257,000     |                           |
| ルネサスエレクトロニクス         | 1,178,700 | 2,402.00  | 2,831,237,400  | 貸付有価証券<br>214,700株        |
| セイコーエプソン             | 231,700   | 2,420.00  | 560,714,000    | 貸付有価証券<br>6,600株（6,000株）  |
| ワコム                  | 137,400   | 631.00    | 86,699,400     | 貸付有価証券<br>300株            |
| アルバック                | 39,600    | 8,742.00  | 346,183,200    | 貸付有価証券<br>6,200株          |
| アクセル                 | 7,200     | 1,968.00  | 14,169,600     | 貸付有価証券<br>300株            |
| E I Z O              | 13,200    | 5,110.00  | 67,452,000     |                           |
| 日本信号                 | 41,100    | 965.00    | 39,661,500     |                           |
| 京三製作所                | 37,800    | 458.00    | 17,312,400     |                           |
| 能美防災                 | 24,400    | 2,280.00  | 55,632,000     |                           |
| ホーチキ                 | 13,500    | 2,239.00  | 30,226,500     |                           |
| 星和電機                 | 3,500     | 520.00    | 1,820,000      |                           |
| エレコム                 | 43,200    | 1,613.00  | 69,681,600     |                           |
| パナソニック ホールディングス      | 2,133,600 | 1,419.50  | 3,028,645,200  |                           |
| シャープ                 | 304,500   | 820.00    | 249,690,000    | 貸付有価証券<br>94,700株（8,400株） |
| アンリツ                 | 127,200   | 1,161.50  | 147,742,800    |                           |
| 富士通ゼネラル              | 51,200    | 1,986.50  | 101,708,800    |                           |
| ソニーグループ              | 1,264,900 | 13,475.00 | 17,044,527,500 | 貸付有価証券<br>200株            |
| TDK                  | 286,000   | 7,779.00  | 2,224,794,000  | 貸付有価証券<br>6,100株          |
| 帝国通信工業               | 7,900     | 1,876.00  | 14,820,400     |                           |
| タムラ製作所               | 72,000    | 570.00    | 41,040,000     | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| アルプスアルパイン            | 161,300   | 1,032.00  | 166,461,600    | 貸付有価証券<br>17,900株（3,100株） |
| 池上通信機                | 2,500     | 850.00    | 2,125,000      |                           |
| 日本電波工業               | 21,700    | 1,374.00  | 29,815,800     |                           |
| 鈴木                   | 9,600     | 1,155.00  | 11,088,000     |                           |
| メイコー                 | 17,900    | 4,410.00  | 78,939,000     |                           |
| 日本トリム                | 4,100     | 3,230.00  | 13,243,000     |                           |
| ローランド ディー. ジー.       | 9,900     | 5,020.00  | 49,698,000     | 貸付有価証券<br>100株            |
| フォスター電機              | 13,400    | 1,126.00  | 15,088,400     |                           |

|             |         |           |                |                          |
|-------------|---------|-----------|----------------|--------------------------|
| SMK         | 4,800   | 2,443.00  | 11,726,400     |                          |
| ヨコオ         | 15,900  | 1,556.00  | 24,740,400     |                          |
| ティアック       | 13,200  | 95.00     | 1,254,000      | 貸付有価証券<br>7,500株（7,400株） |
| ホシデン        | 41,100  | 1,988.00  | 81,706,800     | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| ヒロセ電機       | 26,700  | 16,075.00 | 429,202,500    | 貸付有価証券<br>300株           |
| 日本航空電子工業    | 43,200  | 2,750.00  | 118,800,000    | 貸付有価証券<br>20,300株        |
| T O A       | 20,500  | 1,128.00  | 23,124,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| マクセル        | 39,900  | 1,565.00  | 62,443,500     | 貸付有価証券<br>200株           |
| 古野電気        | 23,500  | 2,181.00  | 51,253,500     |                          |
| スミダコーポレーション | 24,200  | 1,194.00  | 28,894,800     | 貸付有価証券<br>2,500株         |
| アイコム        | 7,000   | 3,455.00  | 24,185,000     |                          |
| リオン         | 7,400   | 2,653.00  | 19,632,200     |                          |
| 横河電機        | 197,600 | 3,070.00  | 606,632,000    | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 新電元工業       | 6,900   | 3,090.00  | 21,321,000     |                          |
| アズビル        | 123,000 | 4,578.00  | 563,094,000    | 貸付有価証券<br>1,200株（600株）   |
| 東亜ディーケーケー   | 3,700   | 987.00    | 3,651,900      |                          |
| 日本光電工業      | 76,700  | 4,182.00  | 320,759,400    | 貸付有価証券<br>100株           |
| チノー         | 7,400   | 2,305.00  | 17,057,000     | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 共和電業        | 7,400   | 421.00    | 3,115,400      |                          |
| 日本電子材料      | 11,000  | 2,055.00  | 22,605,000     | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| 堀場製作所       | 34,100  | 14,130.00 | 481,833,000    | 貸付有価証券<br>3,400株         |
| アドバンテスト     | 512,300 | 6,796.00  | 3,481,590,800  |                          |
| 小野測器        | 3,300   | 579.00    | 1,910,700      |                          |
| エスベック       | 14,300  | 2,662.00  | 38,066,600     |                          |
| キーエンス       | 178,900 | 68,780.00 | 12,304,742,000 | 貸付有価証券<br>17,900株        |
| 日置電機        | 8,400   | 6,820.00  | 57,288,000     | 貸付有価証券<br>400株           |
| シスメックス      | 154,300 | 8,170.00  | 1,260,631,000  | 貸付有価証券<br>300株           |
| 日本マイクロニクス   | 32,100  | 6,000.00  | 192,600,000    | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| メガチップス      | 14,100  | 4,265.00  | 60,136,500     | 貸付有価証券<br>500株           |
| OBARA GROUP | 9,800   | 3,705.00  | 36,309,000     | 貸付有価証券<br>400株           |
| 澤藤電機        | 900     | 1,300.00  | 1,170,000      | 貸付有価証券<br>100株           |
| 原田工業        | 3,500   | 762.00    | 2,667,000      | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| コーセル        | 19,100  | 1,535.00  | 29,318,500     | 貸付有価証券<br>200株           |
| イリソ電子工業     | 16,400  | 3,070.00  | 50,348,000     |                          |

|                  |           |           |               |                          |
|------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| オブテックスグループ       | 32,800    | 1,820.00  | 59,696,000    | 貸付有価証券<br>2,800株         |
| 千代田インテグレ         | 7,000     | 2,650.00  | 18,550,000    | 貸付有価証券<br>300株           |
| レーザーテック          | 82,000    | 40,440.00 | 3,316,080,000 | 貸付有価証券<br>900株           |
| スタンレー電気          | 114,500   | 2,553.50  | 292,375,750   | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| ウシオ電機            | 90,800    | 2,027.50  | 184,097,000   | 貸付有価証券<br>3,400株         |
| 岡谷電機産業           | 6,100     | 273.00    | 1,665,300     | 貸付有価証券<br>2,800株         |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 7,900     | 554.00    | 4,376,600     | 貸付有価証券<br>5,000株         |
| エノモト             | 2,200     | 1,584.00  | 3,484,800     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日本セラミック          | 14,600    | 2,545.00  | 37,157,000    |                          |
| 遠藤照明             | 3,600     | 1,560.00  | 5,616,000     |                          |
| 古河電池             | 13,200    | 974.00    | 12,856,800    | 貸付有価証券<br>600株           |
| 双信電機             | 3,200     | 295.00    | 944,000       |                          |
| 山一電機             | 16,100    | 2,213.00  | 35,629,300    |                          |
| 図研               | 15,600    | 4,265.00  | 66,534,000    |                          |
| 日本電子             | 44,800    | 6,519.00  | 292,051,200   |                          |
| カシオ計算機           | 129,200   | 1,199.50  | 154,975,400   | 貸付有価証券<br>8,200株         |
| ファナック            | 872,000   | 4,085.00  | 3,562,120,000 | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| 日本シイエムケイ         | 38,000    | 607.00    | 23,066,000    | 貸付有価証券<br>100株           |
| エンプラス            | 5,200     | 8,790.00  | 45,708,000    | 貸付有価証券<br>2,500株（700株）   |
| 大真空              | 26,600    | 887.00    | 23,594,200    |                          |
| ローム              | 330,600   | 2,623.00  | 867,163,800   | 貸付有価証券<br>5,800株         |
| 浜松ホトニクス          | 143,500   | 5,270.00  | 756,245,000   |                          |
| 三井ハイテック          | 15,800    | 7,839.00  | 123,856,200   | 貸付有価証券<br>1,600株（700株）   |
| 新光電気工業           | 63,300    | 5,475.00  | 346,567,500   | 貸付有価証券<br>800株           |
| 京セラ              | 1,111,100 | 2,205.50  | 2,450,531,050 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 太陽誘電             | 87,100    | 3,365.00  | 293,091,500   | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| 村田製作所            | 1,626,900 | 2,981.00  | 4,849,788,900 | 貸付有価証券<br>3,800株（2,900株） |
| 双葉電子工業           | 34,000    | 516.00    | 17,544,000    |                          |
| 北陸電気工業           | 3,000     | 1,400.00  | 4,200,000     |                          |
| ニチコン             | 46,900    | 1,206.00  | 56,561,400    | 貸付有価証券<br>500株           |
| 日本ケミコン           | 19,000    | 1,339.00  | 25,441,000    | 貸付有価証券<br>700株           |
| KOA              | 27,100    | 1,508.00  | 40,866,800    | 貸付有価証券<br>4,100株（3,900株） |
| 市光工業             | 32,200    | 539.00    | 17,355,800    | 貸付有価証券<br>500株           |

|                     |           |           |                |                             |
|---------------------|-----------|-----------|----------------|-----------------------------|
| 小糸製作所               | 185,300   | 1,962.50  | 363,651,250    |                             |
| ミツバ                 | 33,500    | 1,348.00  | 45,158,000     |                             |
| S C R E E Nホールディングス | 61,100    | 18,350.00 | 1,121,185,000  | 貸付有価証券<br>800株（800株）        |
| キャノン電子              | 19,800    | 2,275.00  | 45,045,000     |                             |
| キャノン                | 891,900   | 4,196.00  | 3,742,412,400  |                             |
| リコー                 | 448,400   | 1,278.50  | 573,279,400    | 貸付有価証券<br>15,400株（2,500株）   |
| 象印マホービン             | 48,500    | 1,417.00  | 68,724,500     | 貸付有価証券<br>4,000株            |
| MUTOHホールディングス       | 1,100     | 2,342.00  | 2,576,200      |                             |
| 東京エレクトロン            | 378,500   | 34,800.00 | 13,171,800,000 | 貸付有価証券<br>3,100株            |
| イノテック               | 11,900    | 1,860.00  | 22,134,000     |                             |
| トヨタ紡織               | 75,300    | 2,439.00  | 183,656,700    | 貸付有価証券<br>800株              |
| 芦森工業                | 1,600     | 2,766.00  | 4,425,600      |                             |
| ユニプレス               | 32,100    | 1,066.00  | 34,218,600     | 貸付有価証券<br>1,400株            |
| 豊田自動織機              | 152,500   | 14,715.00 | 2,244,037,500  | 貸付有価証券<br>3,700株            |
| モリタホールディングス         | 31,400    | 1,628.00  | 51,119,200     |                             |
| 三桜工業                | 27,300    | 1,007.00  | 27,491,100     | 貸付有価証券<br>300株              |
| デンソー                | 1,475,300 | 2,683.50  | 3,958,967,550  |                             |
| 東海理化電機製作所           | 50,400    | 2,358.00  | 118,843,200    | 貸付有価証券<br>100株              |
| 川崎重工業               | 146,000   | 3,794.00  | 553,924,000    | 貸付有価証券<br>2,200株            |
| 名村造船所               | 44,500    | 1,863.00  | 82,903,500     | 貸付有価証券<br>20,300株           |
| 日本車輛製造              | 5,900     | 2,299.00  | 13,564,100     |                             |
| 三菱ロジスネクスト           | 28,500    | 1,463.00  | 41,695,500     | 貸付有価証券<br>100株              |
| 近畿車輛                | 1,100     | 2,361.00  | 2,597,100      |                             |
| 日産自動車               | 2,413,200 | 564.30    | 1,361,768,760  | 貸付有価証券<br>595,300株          |
| いすゞ自動車              | 519,900   | 2,147.50  | 1,116,485,250  | 貸付有価証券<br>1,800株            |
| トヨタ自動車              | 9,819,100 | 3,430.00  | 33,679,513,000 | 貸付有価証券<br>10,200株           |
| 日野自動車               | 269,000   | 472.70    | 127,156,300    | 貸付有価証券<br>1,400株            |
| 三菱自動車工業             | 697,600   | 454.60    | 317,128,960    | 貸付有価証券<br>166,500株（67,000株） |
| エフテック               | 5,500     | 701.00    | 3,855,500      | 貸付有価証券<br>1,900株（800株）      |
| レシップホールディングス        | 3,400     | 647.00    | 2,199,800      |                             |
| GMB                 | 1,600     | 1,181.00  | 1,889,600      | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株）    |
| ファルテック              | 1,500     | 530.00    | 795,000        |                             |
| 武蔵精密工業              | 43,700    | 1,639.00  | 71,624,300     | 貸付有価証券<br>1,500株            |
| 日産車体                | 18,100    | 977.00    | 17,683,700     |                             |



|             |           |           |               |                           |
|-------------|-----------|-----------|---------------|---------------------------|
|             |           |           |               | 貸付有価証券<br>7,800株          |
| 新明和工業       | 51,500    | 1,185.00  | 61,027,500    |                           |
| 極東開発工業      | 29,500    | 2,426.00  | 71,567,000    | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| トピー工業       | 14,500    | 2,910.00  | 42,195,000    |                           |
| ティラド        | 4,000     | 3,855.00  | 15,420,000    |                           |
| タチエス        | 33,000    | 2,020.00  | 66,660,000    |                           |
| NOK         | 69,500    | 2,089.50  | 145,220,250   | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| フタバ産業       | 47,900    | 998.00    | 47,804,200    | 貸付有価証券<br>300株            |
| カヤバ         | 17,200    | 4,880.00  | 83,936,000    | 貸付有価証券<br>200株            |
| 大同メタル工業     | 35,000    | 550.00    | 19,250,000    |                           |
| プレス工業       | 71,400    | 654.00    | 46,695,600    | 貸付有価証券<br>300株            |
| ミクニ         | 10,000    | 465.00    | 4,650,000     | 貸付有価証券<br>400株            |
| 太平洋工業       | 41,000    | 1,457.00  | 59,737,000    | 貸付有価証券<br>100株            |
| アイシン        | 137,900   | 5,266.00  | 726,181,400   | 貸付有価証券<br>4,700株          |
| マツダ         | 591,500   | 1,741.50  | 1,030,097,250 | 貸付有価証券<br>17,700株（8,400株） |
| 今仙電機製作所     | 5,000     | 687.00    | 3,435,000     | 貸付有価証券<br>200株（200株）      |
| 本田技研工業      | 4,360,800 | 1,744.00  | 7,605,235,200 | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| スズキ         | 328,400   | 6,712.00  | 2,204,220,800 | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| S U B A R U | 554,600   | 3,358.00  | 1,862,346,800 | 貸付有価証券<br>11,400株         |
| 安永          | 3,500     | 748.00    | 2,618,000     | 貸付有価証券<br>2,300株（2,300株）  |
| ヤマハ発動機      | 772,800   | 1,362.50  | 1,052,940,000 | 貸付有価証券<br>9,700株          |
| T B K       | 8,700     | 398.00    | 3,462,600     | 貸付有価証券<br>200株            |
| エクセディ       | 29,200    | 2,852.00  | 83,278,400    |                           |
| 豊田合成        | 51,200    | 2,932.00  | 150,118,400   | 貸付有価証券<br>400株            |
| 愛三工業        | 29,600    | 1,434.00  | 42,446,400    |                           |
| 盟和産業        | 1,100     | 1,029.00  | 1,131,900     |                           |
| 日本プラスト      | 6,700     | 519.00    | 3,477,300     |                           |
| ヨロズ         | 16,800    | 918.00    | 15,422,400    | 貸付有価証券<br>1,700株          |
| エフ・シー・シー    | 31,700    | 2,100.00  | 66,570,000    | 貸付有価証券<br>100株            |
| シマノ         | 72,200    | 20,175.00 | 1,456,635,000 | 貸付有価証券<br>400株            |
| テイ・エス テック   | 63,700    | 1,949.50  | 124,183,150   |                           |
| ジャムコ        | 8,600     | 1,352.00  | 11,627,200    | 貸付有価証券<br>2,700株（100株）    |
| テルモ         | 500,000   | 5,633.00  | 2,816,500,000 | 貸付有価証券<br>22,300株（300株）   |
| クリエートメディック  | 2,600     | 957.00    | 2,488,200     |                           |

|                    |           |           |               |                            |
|--------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| 日機装                | 41,600    | 1,176.00  | 48,921,600    |                            |
| 日本エム・ディ・エム         | 14,200    | 720.00    | 10,224,000    |                            |
| 島津製作所              | 237,600   | 3,828.00  | 909,532,800   | 貸付有価証券<br>300株             |
| JMS                | 16,500    | 518.00    | 8,547,000     |                            |
| クボテック              | 2,200     | 228.00    | 501,600       | 貸付有価証券<br>1,300株           |
| 長野計器               | 13,000    | 2,181.00  | 28,353,000    | 貸付有価証券<br>3,100株（2,900株）   |
| ブイ・テクノロジー          | 9,400     | 2,650.00  | 24,910,000    |                            |
| 東京計器               | 13,700    | 2,326.00  | 31,866,200    | 貸付有価証券<br>4,200株           |
| 愛知時計電機             | 7,700     | 2,510.00  | 19,327,000    | 貸付有価証券<br>100株             |
| インターアクション          | 10,800    | 1,152.00  | 12,441,600    |                            |
| オーバル               | 7,000     | 510.00    | 3,570,000     |                            |
| 東京精密               | 36,600    | 9,696.00  | 354,873,600   |                            |
| マニー                | 71,500    | 2,086.00  | 149,149,000   |                            |
| ニコン                | 258,500   | 1,553.00  | 401,450,500   | 貸付有価証券<br>10,500株          |
| トプコン               | 86,900    | 1,753.00  | 152,335,700   | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| オリンパス              | 1,100,700 | 2,195.00  | 2,416,036,500 | 貸付有価証券<br>54,100株          |
| 理研計器               | 12,700    | 7,900.00  | 100,330,000   | 貸付有価証券<br>500株             |
| タムロン               | 11,000    | 6,410.00  | 70,510,000    | 貸付有価証券<br>200株             |
| HOYA               | 352,000   | 18,445.00 | 6,492,640,000 |                            |
| シード                | 4,000     | 748.00    | 2,992,000     |                            |
| ノーリツ銅機             | 16,900    | 3,050.00  | 51,545,000    | 貸付有価証券<br>100株             |
| A&Dホロンホールディ<br>ングス | 26,100    | 2,134.00  | 55,697,400    |                            |
| 朝日インテック            | 218,000   | 2,880.00  | 627,840,000   | 貸付有価証券<br>8,300株（500株）     |
| シチズン時計             | 164,500   | 1,066.00  | 175,357,000   | 貸付有価証券<br>37,900株（17,500株） |
| リズム                | 1,800     | 3,640.00  | 6,552,000     | 貸付有価証券<br>100株             |
| 大研医器               | 6,800     | 529.00    | 3,597,200     |                            |
| メニコン               | 61,500    | 1,714.00  | 105,411,000   | 貸付有価証券<br>4,300株（200株）     |
| シンシア               | 900       | 524.00    | 471,600       | 貸付有価証券<br>300株（300株）       |
| 松風                 | 8,100     | 2,690.00  | 21,789,000    |                            |
| セイコーグループ           | 24,900    | 3,135.00  | 78,061,500    |                            |
| ニプロ                | 149,100   | 1,265.50  | 188,686,050   | 貸付有価証券<br>23,600株（1,100株）  |
| KYORITSU           | 11,900    | 195.00    | 2,320,500     |                            |
| 中本パックス             | 2,600     | 1,734.00  | 4,508,400     | 貸付有価証券<br>1,200株           |
| スノーピーク             | 25,500    | 988.00    | 25,194,000    | 貸付有価証券<br>11,900株（1,300株）  |
| パラマウントベッドホー        | 37,200    | 2,490.00  | 92,628,000    |                            |

|                  |         |          |               |                          |
|------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| ルディングス           |         |          |               |                          |
| トランザクション         | 11,800  | 2,557.00 | 30,172,600    | 貸付有価証券<br>1,600株         |
| 粧美堂              | 2,200   | 677.00   | 1,489,400     | 貸付有価証券<br>100株           |
| ニホンフラッシュ         | 16,800  | 960.00   | 16,128,000    |                          |
| 前田工織             | 15,100  | 3,355.00 | 50,660,500    | 貸付有価証券<br>4,900株（4,300株） |
| 永大産業             | 9,400   | 281.00   | 2,641,400     | 貸付有価証券<br>1,500株（800株）   |
| アートネイチャー         | 16,100  | 790.00   | 12,719,000    |                          |
| フルヤ金属            | 4,200   | 9,740.00 | 40,908,000    | 貸付有価証券<br>500株           |
| バンダイナムコホールディングス  | 489,900 | 2,910.00 | 1,425,609,000 | 貸付有価証券<br>2,000株（2,000株） |
| アイフィスジャパン        | 2,200   | 610.00   | 1,342,000     |                          |
| SHOEI            | 40,400  | 2,057.00 | 83,102,800    | 貸付有価証券<br>8,900株（200株）   |
| フランスベッドホールディングス  | 23,100  | 1,312.00 | 30,307,200    |                          |
| パイロットコーポレーション    | 25,200  | 3,845.00 | 96,894,000    | 貸付有価証券<br>300株（300株）     |
| 萩原工業             | 12,000  | 1,500.00 | 18,000,000    |                          |
| フジシールインターナショナル   | 36,200  | 1,985.00 | 71,857,000    | 貸付有価証券<br>300株           |
| タカラトミー           | 81,400  | 2,331.00 | 189,743,400   |                          |
| 広済堂ホールディングス      | 46,000  | 671.00   | 30,866,000    | 貸付有価証券<br>11,400株        |
| エステールホールディングス    | 1,800   | 648.00   | 1,166,400     |                          |
| タカノ              | 2,900   | 1,048.00 | 3,039,200     | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| プロネクサス           | 18,500  | 1,221.00 | 22,588,500    |                          |
| ホクシン             | 6,100   | 115.00   | 701,500       | 貸付有価証券<br>4,000株（600株）   |
| ウッドワン            | 2,900   | 1,041.00 | 3,018,900     | 貸付有価証券<br>1,600株（1,300株） |
| TOPPANホールディングス   | 219,800 | 3,518.00 | 773,256,400   |                          |
| 大日本印刷            | 195,400 | 4,556.00 | 890,242,400   | 貸付有価証券<br>5,000株         |
| 共同印刷             | 5,000   | 3,180.00 | 15,900,000    |                          |
| NISSHA           | 30,600  | 1,530.00 | 46,818,000    | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| 光村印刷             | 700     | 1,739.00 | 1,217,300     |                          |
| TAKARA & COMPANY | 10,600  | 2,818.00 | 29,870,800    |                          |
| アシックス            | 152,400 | 5,758.00 | 877,519,200   | 貸付有価証券<br>70,700株        |
| ツツミ              | 4,200   | 2,119.00 | 8,899,800     |                          |
| ローランド            | 13,200  | 4,810.00 | 63,492,000    | 貸付有価証券<br>1,600株（300株）   |
| 小松ウオール工業         | 7,300   | 3,395.00 | 24,783,500    |                          |
| ヤマハ              | 112,700 | 3,325.00 | 374,727,500   | 貸付有価証券<br>2,500株         |
| 河合楽器製作所          | 5,400   | 3,405.00 | 18,387,000    |                          |

|              |           |          |               |                           |
|--------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| クリナップ        | 17,500    | 761.00   | 13,317,500    |                           |
| ビジョン         | 113,900   | 1,573.50 | 179,221,650   | 貸付有価証券<br>3,600株（1,400株）  |
| キングジム        | 15,800    | 879.00   | 13,888,200    | 貸付有価証券<br>4,400株（100株）    |
| リンテック        | 35,900    | 3,085.00 | 110,751,500   | 貸付有価証券<br>400株            |
| イトーキ         | 36,600    | 2,070.00 | 75,762,000    | 貸付有価証券<br>800株            |
| 任天堂          | 1,129,000 | 8,356.00 | 9,433,924,000 | 貸付有価証券<br>700株            |
| 三菱鉛筆         | 25,400    | 2,474.00 | 62,839,600    | 貸付有価証券<br>100株            |
| タカスタンダード     | 37,600    | 1,868.00 | 70,236,800    |                           |
| コクヨ          | 73,100    | 2,466.00 | 180,264,600   | 貸付有価証券<br>3,300株          |
| ナカバヤシ        | 19,300    | 534.00   | 10,306,200    |                           |
| グローブライド      | 16,000    | 2,020.00 | 32,320,000    | 貸付有価証券<br>100株            |
| オカムラ         | 53,800    | 2,173.00 | 116,907,400   | 貸付有価証券<br>300株            |
| 美津濃          | 17,800    | 5,170.00 | 92,026,000    |                           |
| 東京電力ホールディングス | 1,612,000 | 789.00   | 1,271,868,000 | 貸付有価証券<br>197,400株        |
| 中部電力         | 659,000   | 1,917.50 | 1,263,632,500 | 貸付有価証券<br>22,100株         |
| 関西電力         | 690,500   | 1,943.00 | 1,341,641,500 | 貸付有価証券<br>5,500株          |
| 中国電力         | 310,700   | 990.00   | 307,593,000   | 貸付有価証券<br>4,200株          |
| 北陸電力         | 182,800   | 730.00   | 133,444,000   | 貸付有価証券<br>17,400株         |
| 東北電力         | 470,800   | 1,004.00 | 472,683,200   | 貸付有価証券<br>600株            |
| 四国電力         | 166,500   | 1,042.50 | 173,576,250   |                           |
| 九州電力         | 412,200   | 1,140.00 | 469,908,000   |                           |
| 北海道電力        | 172,800   | 635.10   | 109,745,280   |                           |
| 沖縄電力         | 45,700    | 1,093.00 | 49,950,100    | 貸付有価証券<br>3,100株          |
| 電源開発         | 146,900   | 2,489.00 | 365,634,100   | 貸付有価証券<br>8,300株（8,300株）  |
| エフオン         | 13,000    | 413.00   | 5,369,000     |                           |
| イーレックス       | 31,800    | 761.00   | 24,199,800    | 貸付有価証券<br>15,000株（5,800株） |
| レノバ          | 47,700    | 1,241.00 | 59,195,700    | 貸付有価証券<br>12,000株（3,100株） |
| 東京瓦斯         | 378,000   | 3,216.00 | 1,215,648,000 | 貸付有価証券<br>12,800株（700株）   |
| 大阪瓦斯         | 362,200   | 3,064.00 | 1,109,780,800 | 貸付有価証券<br>14,900株         |
| 東邦瓦斯         | 77,400    | 2,944.50 | 227,904,300   | 貸付有価証券<br>500株            |
| 北海道瓦斯        | 10,700    | 2,281.00 | 24,406,700    |                           |
| 広島ガス         | 37,800    | 385.00   | 14,553,000    |                           |
| 西部ガスホールディングス | 18,700    | 1,887.00 | 35,286,900    | 貸付有価証券<br>100株            |
| 静岡ガス         | 35,700    | 964.00   | 34,414,800    | 貸付有価証券                    |

|                  |         |          |               |                          |
|------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
|                  |         |          |               | 700株                     |
| メタウォーター          | 21,400  | 2,219.00 | 47,486,600    |                          |
| SBSホールディングス      | 15,900  | 2,325.00 | 36,967,500    | 貸付有価証券<br>200株           |
| 東武鉄道             | 196,400 | 3,881.00 | 762,228,400   | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| 相鉄ホールディングス       | 64,000  | 2,732.50 | 174,880,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 東急               | 501,400 | 1,773.50 | 889,232,900   | 貸付有価証券<br>1,500株（1,100株） |
| 京浜急行電鉄           | 221,300 | 1,285.00 | 284,370,500   |                          |
| 小田急電鉄            | 295,700 | 2,129.00 | 629,545,300   | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| 京王電鉄             | 86,000  | 4,227.00 | 363,522,000   |                          |
| 京成電鉄             | 115,300 | 7,580.00 | 873,974,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 富士急行             | 22,000  | 3,960.00 | 87,120,000    | 貸付有価証券<br>2,400株（900株）   |
| 東日本旅客鉄道          | 328,500 | 9,051.00 | 2,973,253,500 | 貸付有価証券<br>500株           |
| 西日本旅客鉄道          | 212,100 | 6,283.00 | 1,332,624,300 |                          |
| 東海旅客鉄道           | 688,800 | 3,786.00 | 2,607,796,800 |                          |
| 西武ホールディングス       | 216,300 | 2,169.50 | 469,262,850   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 鴻池運輸             | 30,500  | 1,822.00 | 55,571,000    |                          |
| 西日本鉄道            | 47,800  | 2,438.00 | 116,536,400   | 貸付有価証券<br>300株（200株）     |
| ハマキョウレックス        | 15,300  | 3,900.00 | 59,670,000    |                          |
| サカイ引越センター        | 19,800  | 2,576.00 | 51,004,800    | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| 近鉄グループホールディングス   | 178,500 | 4,476.00 | 798,966,000   | 貸付有価証券<br>19,600株（200株）  |
| 阪急阪神ホールディングス     | 238,100 | 4,378.00 | 1,042,401,800 | 貸付有価証券<br>7,000株         |
| 南海電気鉄道           | 79,600  | 2,932.00 | 233,387,200   |                          |
| 京阪ホールディングス       | 98,400  | 3,504.00 | 344,793,600   | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| 神戸電鉄             | 4,900   | 2,855.00 | 13,989,500    | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| 名古屋鉄道            | 184,200 | 2,182.50 | 402,016,500   |                          |
| 山陽電気鉄道           | 13,400  | 2,128.00 | 28,515,200    | 貸付有価証券<br>5,900株         |
| アルプス物流           | 14,200  | 1,911.00 | 27,136,200    |                          |
| ヤマトホールディングス      | 228,600 | 2,419.50 | 553,097,700   | 貸付有価証券<br>5,700株（1,800株） |
| 山九               | 45,400  | 5,381.00 | 244,297,400   |                          |
| 丸運               | 4,600   | 272.00   | 1,251,200     | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| 丸全昭和運輸           | 11,000  | 4,465.00 | 49,115,000    |                          |
| センコーグループホールディングス | 94,500  | 1,129.00 | 106,690,500   | 貸付有価証券<br>7,700株         |
| トナミホールディングス      | 3,900   | 4,440.00 | 17,316,000    |                          |
| ニッコンホールディングス     | 57,100  | 3,229.00 | 184,375,900   |                          |
| 日本石油輸送           | 800     | 2,831.00 | 2,264,800     |                          |

|                                  |         |          |               |                          |
|----------------------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 福山通運                             | 20,400  | 4,250.00 | 86,700,000    | 貸付有価証券<br>200株           |
| セイノーホールディングス                     | 100,400 | 2,316.00 | 232,526,400   | 貸付有価証券<br>29,900株        |
| エスライングループ本社                      | 2,200   | 875.00   | 1,925,000     |                          |
| 神奈川中央交通                          | 5,100   | 3,015.00 | 15,376,500    |                          |
| A Z - COM丸和ホールディングス              | 45,600  | 1,423.00 | 64,888,800    | 貸付有価証券<br>400株           |
| C & F ロジホールディングス                 | 17,200  | 1,777.00 | 30,564,400    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 九州旅客鉄道                           | 126,200 | 3,363.00 | 424,410,600   |                          |
| S Gホールディングス                      | 299,800 | 1,907.00 | 571,718,600   | 貸付有価証券<br>3,600株         |
| N I P P O N E X P R E S Sホールディング | 60,600  | 8,068.00 | 488,920,800   | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| 日本郵船                             | 511,700 | 4,772.00 | 2,441,832,400 |                          |
| 商船三井                             | 387,400 | 5,262.00 | 2,038,498,800 |                          |
| 川崎汽船                             | 143,400 | 7,035.00 | 1,008,819,000 | 貸付有価証券<br>53,600株        |
| N S ユナイテッド海運                     | 9,600   | 5,210.00 | 50,016,000    | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| 明海グループ                           | 8,700   | 795.00   | 6,916,500     | 貸付有価証券<br>3,000株（1,000株） |
| 飯野海運                             | 65,500  | 1,334.00 | 87,377,000    | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| 共栄タンカー                           | 1,400   | 1,106.00 | 1,548,400     | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 乾汽船                              | 20,900  | 1,049.00 | 21,924,100    | 貸付有価証券<br>5,500株（200株）   |
| 日本航空                             | 438,500 | 2,787.00 | 1,222,099,500 |                          |
| A N Aホールディングス                    | 485,800 | 3,232.00 | 1,570,105,600 | 貸付有価証券<br>5,600株         |
| パスコ                              | 1,500   | 1,842.00 | 2,763,000     |                          |
| トランコム                            | 5,200   | 6,390.00 | 33,228,000    |                          |
| 日新                               | 13,600  | 2,911.00 | 39,589,600    |                          |
| 三菱倉庫                             | 43,800  | 4,581.00 | 200,647,800   | 貸付有価証券<br>200株           |
| 三井倉庫ホールディングス                     | 16,700  | 4,665.00 | 77,905,500    |                          |
| 住友倉庫                             | 48,100  | 2,610.00 | 125,541,000   |                          |
| 澁澤倉庫                             | 8,100   | 3,065.00 | 24,826,500    |                          |
| 東陽倉庫                             | 2,100   | 1,524.00 | 3,200,400     |                          |
| 日本トランスシティ                        | 35,900  | 616.00   | 22,114,400    |                          |
| ケイヒン                             | 1,400   | 1,949.00 | 2,728,600     |                          |
| 中央倉庫                             | 9,600   | 1,139.00 | 10,934,400    |                          |
| 川西倉庫                             | 1,500   | 1,152.00 | 1,728,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 安田倉庫                             | 12,200  | 1,189.00 | 14,505,800    | 貸付有価証券<br>200株           |
| ファイズホールディングス                     | 1,200   | 1,300.00 | 1,560,000     | 貸付有価証券<br>600株（600株）     |
| 東洋埠頭                             | 2,300   | 1,381.00 | 3,176,300     |                          |
| 上組                               | 82,400  | 3,444.00 | 283,785,600   | 貸付有価証券<br>100株           |

|                   |         |          |               |                          |
|-------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| サンリツ              | 1,900   | 767.00   | 1,457,300     |                          |
| キムラユニティー          | 3,800   | 1,554.00 | 5,905,200     |                          |
| キューソー流通システム       | 8,100   | 933.00   | 7,557,300     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 東海運               | 4,600   | 293.00   | 1,347,800     |                          |
| エーアイティー           | 11,200  | 1,844.00 | 20,652,800    | 貸付有価証券<br>400株（300株）     |
| 内外トランスライン         | 7,200   | 2,411.00 | 17,359,200    |                          |
| 日本コンセプト           | 6,500   | 1,914.00 | 12,441,000    | 貸付有価証券<br>200株           |
| NEC ネットエスアイ       | 69,900  | 2,358.00 | 164,824,200   | 貸付有価証券<br>100株           |
| クロスキャット           | 11,400  | 1,194.00 | 13,611,600    |                          |
| システナ              | 271,400 | 280.00   | 75,992,000    |                          |
| デジタルアーツ           | 11,300  | 4,555.00 | 51,471,500    |                          |
| 日鉄ソリューションズ        | 30,600  | 4,950.00 | 151,470,000   |                          |
| キューブシステム          | 9,500   | 1,108.00 | 10,526,000    |                          |
| コア                | 7,900   | 1,817.00 | 14,354,300    |                          |
| 手間いらず             | 3,000   | 2,774.00 | 8,322,000     |                          |
| ラクーンホールディングス      | 13,400  | 694.00   | 9,299,600     | 貸付有価証券<br>1,700株（400株）   |
| ソリトンシステムズ         | 9,200   | 1,384.00 | 12,732,800    |                          |
| ソフトクリエイイトホールディングス | 14,700  | 1,909.00 | 28,062,300    |                          |
| T I S             | 196,200 | 3,396.00 | 666,295,200   |                          |
| テクミラホールディングス      | 3,700   | 462.00   | 1,709,400     | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| グリー               | 60,100  | 528.00   | 31,732,800    | 貸付有価証券<br>3,300株（2,800株） |
| GMOペパボ            | 2,200   | 1,340.00 | 2,948,000     |                          |
| コーエーテクモホールディングス   | 112,400 | 1,856.00 | 208,614,400   | 貸付有価証券<br>25,400株（100株）  |
| 三菱総合研究所           | 8,800   | 4,865.00 | 42,812,000    | 貸付有価証券<br>100株           |
| ボルテージ             | 2,300   | 267.00   | 614,100       | 貸付有価証券<br>100株           |
| 電算                | 900     | 1,500.00 | 1,350,000     | 貸付有価証券<br>400株           |
| A G S             | 3,300   | 905.00   | 2,986,500     |                          |
| ファインデックス          | 14,200  | 1,169.00 | 16,599,800    |                          |
| ブレインパッド           | 14,900  | 1,435.00 | 21,381,500    | 貸付有価証券<br>4,900株         |
| K L a b           | 33,000  | 379.00   | 12,507,000    | 貸付有価証券<br>12,700株（400株）  |
| ポールトゥウィンホールディングス  | 30,600  | 526.00   | 16,095,600    | 貸付有価証券<br>4,700株         |
| ネクソン              | 401,400 | 2,550.00 | 1,023,570,000 | 貸付有価証券<br>52,700株        |
| アイスタイル            | 58,500  | 435.00   | 25,447,500    | 貸付有価証券<br>18,800株        |
| エムアップホールディングス     | 22,000  | 1,029.00 | 22,638,000    |                          |
| エイチーム             | 10,600  | 584.00   | 6,190,400     | 貸付有価証券<br>100株           |

|                          |        |           |             |                          |
|--------------------------|--------|-----------|-------------|--------------------------|
| エニグモ                     | 22,800 | 355.00    | 8,094,000   | 貸付有価証券<br>5,800株         |
| テクノスジャパン                 | 7,100  | 601.00    | 4,267,100   | 貸付有価証券<br>900株           |
| e n i s h                | 8,100  | 223.00    | 1,806,300   | 貸付有価証券<br>3,800株（700株）   |
| コロプラ                     | 69,600 | 598.00    | 41,620,800  | 貸付有価証券<br>11,400株（400株）  |
| オルトプラス                   | 7,200  | 143.00    | 1,029,600   | 貸付有価証券<br>1,300株         |
| ブロードリーフ                  | 85,100 | 576.00    | 49,017,600  | 貸付有価証券<br>1,900株         |
| クロス・マーケティング<br>グループ      | 3,700  | 603.00    | 2,231,100   |                          |
| デジタルハーツホール<br>ディングス      | 11,200 | 1,091.00  | 12,219,200  | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| メディアドゥ                   | 8,100  | 1,247.00  | 10,100,700  | 貸付有価証券<br>3,600株（700株）   |
| じげん                      | 52,300 | 507.00    | 26,516,100  | 貸付有価証券<br>7,300株（7,000株） |
| ブイキューブ                   | 21,500 | 308.00    | 6,622,000   | 貸付有価証券<br>9,000株（3,000株） |
| エンカレッジ・テクノロ<br>ジ         | 1,900  | 578.00    | 1,098,200   |                          |
| サイバーリンクス                 | 3,000  | 816.00    | 2,448,000   | 貸付有価証券<br>200株           |
| ディー・エル・イー                | 5,700  | 189.00    | 1,077,300   | 貸付有価証券<br>2,600株         |
| フィックスターズ                 | 20,200 | 1,836.00  | 37,087,200  | 貸付有価証券<br>6,300株（400株）   |
| CARTA HOLD I<br>NGS      | 8,400  | 1,461.00  | 12,272,400  | 貸付有価証券<br>3,900株         |
| オブティム                    | 18,400 | 1,093.00  | 20,111,200  | 貸付有価証券<br>5,600株（3,100株） |
| セレス                      | 7,200  | 1,625.00  | 11,700,000  | 貸付有価証券<br>1,000株         |
| SHIFT                    | 11,900 | 26,900.00 | 320,110,000 | 貸付有価証券<br>4,000株         |
| ティーガイア                   | 18,700 | 2,136.00  | 39,943,200  | 貸付有価証券<br>200株           |
| セック                      | 2,200  | 5,490.00  | 12,078,000  |                          |
| テクマトリックス                 | 32,700 | 2,050.00  | 67,035,000  |                          |
| プロシップ                    | 8,600  | 1,475.00  | 12,685,000  |                          |
| ガンホー・オンライン・<br>エンターテイメント | 46,700 | 2,320.50  | 108,367,350 | 貸付有価証券<br>900株           |
| GMOペイメントゲート<br>ウェイ       | 35,800 | 8,467.00  | 303,118,600 | 貸付有価証券<br>4,700株（100株）   |
| ザッパラス                    | 1,800  | 433.00    | 779,400     | 貸付有価証券<br>1,200株（700株）   |
| システムリサーチ                 | 6,100  | 3,410.00  | 20,801,000  |                          |
| インターネットイニシア<br>ティブ       | 85,700 | 2,851.00  | 244,330,700 | 貸付有価証券<br>100株           |
| さくらインターネット               | 20,100 | 5,240.00  | 105,324,000 | 貸付有価証券<br>9,400株（1,900株） |
| GMOグローバルサイ<br>ン・ホールディングス | 5,500  | 2,750.00  | 15,125,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| SRAホールディングス              | 9,200  | 3,940.00  | 36,248,000  |                          |
| システムインテグレータ              | 2,400  | 430.00    | 1,032,000   | 貸付有価証券<br>1,100株         |



|                          |        |          |             |                           |
|--------------------------|--------|----------|-------------|---------------------------|
| 朝日ネット                    | 19,300 | 632.00   | 12,197,600  |                           |
| e B A S E                | 25,200 | 735.00   | 18,522,000  | 貸付有価証券<br>200株            |
| アバントグループ                 | 22,700 | 1,331.00 | 30,213,700  | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| アドソル日進                   | 7,500  | 1,684.00 | 12,630,000  |                           |
| ODKソリューションズ              | 1,500  | 607.00   | 910,500     |                           |
| フリービット                   | 7,800  | 1,658.00 | 12,932,400  | 貸付有価証券<br>2,400株          |
| コムチュア                    | 25,900 | 1,898.00 | 49,158,200  |                           |
| アステリア                    | 14,000 | 656.00   | 9,184,000   | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| アイル                      | 8,400  | 3,535.00 | 29,694,000  |                           |
| マークラインズ                  | 9,700  | 3,200.00 | 31,040,000  |                           |
| メディカル・データ・ビ<br>ジョン       | 21,400 | 580.00   | 12,412,000  | 貸付有価証券<br>3,700株（900株）    |
| g u m i                  | 29,100 | 406.00   | 11,814,600  | 貸付有価証券<br>13,700株（1,200株） |
| ショーケース                   | 1,800  | 328.00   | 590,400     | 貸付有価証券<br>700株（600株）      |
| モバイルファクトリー               | 1,700  | 745.00   | 1,266,500   |                           |
| テラスカイ                    | 7,700  | 1,545.00 | 11,896,500  | 貸付有価証券<br>3,600株（200株）    |
| デジタル・インフォメー<br>ション・テクノロジ | 9,300  | 1,900.00 | 17,670,000  |                           |
| P C I ホールディングス           | 3,000  | 943.00   | 2,829,000   | 貸付有価証券<br>400株（400株）      |
| アイビーシー                   | 1,200  | 431.00   | 517,200     | 貸付有価証券<br>100株            |
| ネオジャパン                   | 6,000  | 1,109.00 | 6,654,000   |                           |
| P R T I M E S            | 3,600  | 2,064.00 | 7,430,400   | 貸付有価証券<br>100株            |
| ラクス                      | 84,800 | 2,199.50 | 186,517,600 |                           |
| ランドコンピュータ                | 3,800  | 893.00   | 3,393,400   |                           |
| ダブルスタンダード                | 5,400  | 1,901.00 | 10,265,400  | 貸付有価証券<br>2,300株（800株）    |
| オーブンドア                   | 10,500 | 821.00   | 8,620,500   | 貸付有価証券<br>4,900株（700株）    |
| マイネット                    | 2,600  | 461.00   | 1,198,600   | 貸付有価証券<br>700株（700株）      |
| アカツキ                     | 8,500  | 2,494.00 | 21,199,000  |                           |
| ベネフィットジャパン               | 500    | 1,242.00 | 621,000     |                           |
| U b i c o mホールディ<br>ングス  | 5,600  | 1,428.00 | 7,996,800   | 貸付有価証券<br>2,600株          |
| カナミックネットワーク              | 19,300 | 525.00   | 10,132,500  |                           |
| ノムラシステムコーポ<br>レーション      | 8,700  | 112.00   | 974,400     | 貸付有価証券<br>600株（600株）      |
| チェンジホールディング<br>ス         | 39,000 | 1,554.00 | 60,606,000  | 貸付有価証券<br>17,500株（1,000株） |
| シンクロ・フード                 | 5,000  | 697.00   | 3,485,000   | 貸付有価証券<br>2,900株（2,900株）  |
| オークネット                   | 6,600  | 1,981.00 | 13,074,600  |                           |
| キャピタル・アセット・<br>プランニング    | 1,500  | 761.00   | 1,141,500   |                           |
| セグエグループ                  | 2,500  | 1,993.00 | 4,982,500   | 貸付有価証券                    |

|                  |         |          |               |                          |
|------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
|                  |         |          |               | 900株                     |
| エイトレッド           | 1,200   | 1,426.00 | 1,711,200     | 貸付有価証券<br>200株（200株）     |
| マクロミル            | 35,200  | 784.00   | 27,596,800    | 貸付有価証券<br>100株           |
| ビーグリー            | 1,700   | 1,167.00 | 1,983,900     |                          |
| オロ               | 6,500   | 2,805.00 | 18,232,500    |                          |
| ユーザーローカル         | 7,600   | 2,382.00 | 18,103,200    | 貸付有価証券<br>2,700株（1,200株） |
| テモナ              | 1,800   | 239.00   | 430,200       | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株） |
| ニーズウェル           | 4,400   | 856.00   | 3,766,400     | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| マネーフォワード         | 40,000  | 5,816.00 | 232,640,000   | 貸付有価証券<br>4,400株         |
| サインポスト           | 3,100   | 581.00   | 1,801,100     | 貸付有価証券<br>1,400株（900株）   |
| Sun Asterisk     | 12,700  | 997.00   | 12,661,900    | 貸付有価証券<br>2,200株（700株）   |
| プラスアルファ・コンサルティング | 10,600  | 2,462.00 | 26,097,200    |                          |
| 電算システムホールディングス   | 7,900   | 2,672.00 | 21,108,800    |                          |
| Appier Group     | 61,300  | 1,844.00 | 113,037,200   | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| ビジョナル            | 13,800  | 9,440.00 | 130,272,000   | 貸付有価証券<br>2,300株         |
| ソルクシーズ           | 6,500   | 342.00   | 2,223,000     | 貸付有価証券<br>200株           |
| フェイス             | 2,200   | 461.00   | 1,014,200     |                          |
| プロトコーポレーション      | 19,600  | 1,292.00 | 25,323,200    |                          |
| ハイマックス           | 5,600   | 1,402.00 | 7,851,200     |                          |
| 野村総合研究所          | 397,300 | 4,088.00 | 1,624,162,400 | 貸付有価証券<br>8,500株         |
| CEホールディングス       | 4,100   | 546.00   | 2,238,600     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 日本システム技術         | 6,600   | 3,240.00 | 21,384,000    |                          |
| インテージホールディングス    | 20,300  | 1,776.00 | 36,052,800    |                          |
| 東邦システムサイエンス      | 6,700   | 1,278.00 | 8,562,600     |                          |
| ソースネクスト          | 82,100  | 142.00   | 11,658,200    | 貸付有価証券<br>38,600株（200株）  |
| インフォコム           | 23,100  | 2,258.00 | 52,159,800    |                          |
| シンプレクス・ホールディングス  | 27,000  | 2,550.00 | 68,850,000    |                          |
| HEROZ            | 7,000   | 1,935.00 | 13,545,000    | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| ラクスル             | 43,200  | 1,075.00 | 46,440,000    | 貸付有価証券<br>16,600株        |
| メルカリ             | 87,300  | 2,192.00 | 191,361,600   | 貸付有価証券<br>26,900株        |
| I P S            | 5,200   | 2,280.00 | 11,856,000    | 貸付有価証券<br>800株（800株）     |
| F I G            | 9,200   | 319.00   | 2,934,800     | 貸付有価証券<br>4,300株         |
| システムサポート         | 6,900   | 1,885.00 | 13,006,500    |                          |
| イーソル             | 12,900  | 1,007.00 | 12,990,300    | 貸付有価証券                   |

|                       |           |           |               |                           |
|-----------------------|-----------|-----------|---------------|---------------------------|
|                       |           |           |               | 300株                      |
| 東海ソフト                 | 1,300     | 1,161.00  | 1,509,300     |                           |
| ウイングアーク1st            | 18,600    | 3,030.00  | 56,358,000    |                           |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング | 4,800     | 1,178.00  | 5,654,400     |                           |
| サーバーワークス              | 3,700     | 4,105.00  | 15,188,500    | 貸付有価証券<br>300株（200株）      |
| 東名                    | 600       | 2,400.00  | 1,440,000     | 貸付有価証券<br>300株            |
| ヴィッツ                  | 800       | 765.00    | 612,000       |                           |
| トピラシステムズ              | 2,300     | 839.00    | 1,929,700     |                           |
| Sansan                | 58,800    | 1,512.00  | 88,905,600    | 貸付有価証券<br>7,900株          |
| Link-U                | 1,900     | 681.00    | 1,293,900     |                           |
| ギフトィ                  | 15,700    | 1,460.00  | 22,922,000    | 貸付有価証券<br>5,900株（200株）    |
| メドレー                  | 24,100    | 4,765.00  | 114,836,500   | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| ベース                   | 6,300     | 3,560.00  | 22,428,000    | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| JMDC                  | 30,600    | 3,734.00  | 114,260,400   | 貸付有価証券<br>1,400株          |
| フォーカスシステムズ            | 12,000    | 1,065.00  | 12,780,000    |                           |
| クレスコ                  | 14,700    | 1,898.00  | 27,900,600    |                           |
| フジ・メディア・ホールディングス      | 172,300   | 1,950.50  | 336,071,150   | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| オービック                 | 59,900    | 22,185.00 | 1,328,881,500 |                           |
| ジャストシステム              | 25,800    | 2,558.00  | 65,996,400    | 貸付有価証券<br>100株            |
| TDCソフト                | 16,800    | 2,238.00  | 37,598,400    |                           |
| LINEヤフー               | 2,553,200 | 423.20    | 1,080,514,240 | 貸付有価証券<br>621,400株        |
| トレンドマイクロ              | 84,800    | 7,183.00  | 609,118,400   | 貸付有価証券<br>10,600株         |
| IDホールディングス            | 12,100    | 1,640.00  | 19,844,000    |                           |
| 日本オラクル                | 34,300    | 11,585.00 | 397,365,500   |                           |
| アルファシステムズ             | 4,700     | 3,475.00  | 16,332,500    |                           |
| フューチャー                | 38,200    | 1,674.00  | 63,946,800    | 貸付有価証券<br>2,100株          |
| CAC Holdings          | 9,600     | 1,799.00  | 17,270,400    | 貸付有価証券<br>300株            |
| SBテクノロジー              | 7,600     | 2,128.00  | 16,172,800    |                           |
| トーセ                   | 2,300     | 711.00    | 1,635,300     |                           |
| オービックビジネスコンサルティング     | 25,200    | 7,010.00  | 176,652,000   |                           |
| アイティフォー               | 23,000    | 1,395.00  | 32,085,000    |                           |
| 東計電算                  | 5,000     | 3,495.00  | 17,475,000    |                           |
| エクスネット                | 1,100     | 1,107.00  | 1,217,700     |                           |
| 大塚商会                  | 88,900    | 6,303.00  | 560,336,700   | 貸付有価証券<br>21,800株         |
| サイボウズ                 | 24,700    | 2,046.00  | 50,536,200    | 貸付有価証券<br>3,100株（800株）    |
| 電通総研                  | 21,800    | 5,450.00  | 118,810,000   | 貸付有価証券<br>10,200株（6,900株） |

|                            |            |          |               |                            |
|----------------------------|------------|----------|---------------|----------------------------|
| ACCESS                     | 18,600     | 940.00   | 17,484,000    | 貸付有価証券<br>3,400株（300株）     |
| デジタルガレージ                   | 28,700     | 3,325.00 | 95,427,500    |                            |
| EMシステムズ                    | 29,900     | 740.00   | 22,126,000    | 貸付有価証券<br>2,200株           |
| ウェザーニューズ                   | 5,500      | 5,110.00 | 28,105,000    | 貸付有価証券<br>100株             |
| C I J                      | 29,800     | 712.00   | 21,217,600    | 貸付有価証券<br>100株             |
| ビジネスエンジニアリン<br>グ           | 3,400      | 3,930.00 | 13,362,000    |                            |
| 日本エンタープライズ                 | 8,200      | 122.00   | 1,000,400     | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| WOWOW                      | 13,500     | 1,134.00 | 15,309,000    |                            |
| スカラ                        | 16,600     | 717.00   | 11,902,200    |                            |
| インテリジェント ウェ<br>イブ          | 4,200      | 1,177.00 | 4,943,400     |                            |
| ANYCOLOR                   | 19,000     | 3,150.00 | 59,850,000    | 貸付有価証券<br>5,400株（1,500株）   |
| I M A G I C A G R O<br>U P | 18,000     | 732.00   | 13,176,000    |                            |
| ネットワンシステムズ                 | 72,400     | 2,580.00 | 186,792,000   |                            |
| システムソフト                    | 62,400     | 57.00    | 3,556,800     | 貸付有価証券<br>1,400株           |
| アルゴグラフィックス                 | 16,400     | 4,225.00 | 69,290,000    |                            |
| マーベラス                      | 29,100     | 746.00   | 21,708,600    |                            |
| エイベックス                     | 30,500     | 1,293.00 | 39,436,500    |                            |
| B I P R O G Y              | 58,700     | 4,599.00 | 269,961,300   |                            |
| 都築電気                       | 9,400      | 2,365.00 | 22,231,000    |                            |
| T B S ホールディングス             | 90,200     | 4,300.00 | 387,860,000   | 貸付有価証券<br>10,400株          |
| 日本テレビホールディン<br>グス          | 158,800    | 2,221.00 | 352,694,800   | 貸付有価証券<br>3,200株           |
| 朝日放送グループホール<br>ディングス       | 16,800     | 691.00   | 11,608,800    | 貸付有価証券<br>7,800株           |
| テレビ朝日ホールディン<br>グス          | 43,500     | 2,106.00 | 91,611,000    |                            |
| スカパーJ S A T ホール<br>ディングス   | 139,300    | 914.00   | 127,320,200   | 貸付有価証券<br>2,600株           |
| テレビ東京ホールディン<br>グス          | 12,900     | 3,030.00 | 39,087,000    | 貸付有価証券<br>2,700株           |
| 日本BS放送                     | 2,900      | 898.00   | 2,604,200     |                            |
| ビジョン                       | 27,000     | 1,114.00 | 30,078,000    |                            |
| スマートバリュー                   | 2,300      | 430.00   | 989,000       | 貸付有価証券<br>500株             |
| USEN-NEXT H<br>OLDINGS     | 20,100     | 4,495.00 | 90,349,500    | 貸付有価証券<br>9,400株           |
| ワイヤレスゲート                   | 3,500      | 226.00   | 791,000       | 貸付有価証券<br>1,500株           |
| 日本通信                       | 176,600    | 218.00   | 38,498,800    | 貸付有価証券<br>17,400株（12,500株） |
| クロップス                      | 1,000      | 1,038.00 | 1,038,000     |                            |
| 日本電信電話                     | 53,348,000 | 181.30   | 9,671,992,400 | 貸付有価証券<br>1,399,200株       |
| K D D I                    | 1,385,900  | 4,601.00 | 6,376,525,900 |                            |

|                          |           |           |               |                         |
|--------------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------------|
| ソフトバンク                   | 2,886,300 | 1,958.00  | 5,651,375,400 | 貸付有価証券<br>303,200株      |
| 光通信                      | 18,100    | 25,210.00 | 456,301,000   | 貸付有価証券<br>300株          |
| エムティーアイ                  | 12,300    | 763.00    | 9,384,900     | 貸付有価証券<br>700株          |
| GMOインターネットグループ           | 66,300    | 2,657.50  | 176,192,250   | 貸付有価証券<br>100株          |
| ファイバーゲート                 | 9,600     | 1,032.00  | 9,907,200     | 貸付有価証券<br>100株          |
| アイドママーケティング<br>コミュニケーション | 2,200     | 234.00    | 514,800       |                         |
| KADOKAWA                 | 94,800    | 3,024.00  | 286,675,200   | 貸付有価証券<br>1,400株        |
| 学研ホールディングス               | 29,800    | 992.00    | 29,561,600    |                         |
| ゼンリン                     | 30,700    | 858.00    | 26,340,600    | 貸付有価証券<br>100株          |
| 昭文社ホールディングス              | 3,400     | 365.00    | 1,241,000     | 貸付有価証券<br>500株          |
| インプレスホールディングス            | 8,000     | 175.00    | 1,400,000     |                         |
| アイネット                    | 10,900    | 2,277.00  | 24,819,300    |                         |
| 松竹                       | 9,300     | 9,956.00  | 92,590,800    | 貸付有価証券<br>4,300株        |
| 東宝                       | 99,800    | 4,795.00  | 478,541,000   |                         |
| 東映                       | 5,900     | 19,850.00 | 117,115,000   |                         |
| NTTデータグループ               | 468,900   | 2,364.00  | 1,108,479,600 | 貸付有価証券<br>25,500株       |
| ピー・シー・エー                 | 10,300    | 1,626.00  | 16,747,800    |                         |
| ビジネスブレイン太田昭和             | 7,000     | 2,296.00  | 16,072,000    |                         |
| D T S                    | 37,800    | 3,905.00  | 147,609,000   | 貸付有価証券<br>800株          |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス     | 81,900    | 6,670.00  | 546,273,000   | 貸付有価証券<br>1,100株        |
| シーイーシー                   | 22,600    | 1,792.00  | 40,499,200    | 貸付有価証券<br>3,200株        |
| カブコン                     | 160,400   | 5,830.00  | 935,132,000   | 貸付有価証券<br>100株          |
| アイ・エス・ビー                 | 9,200     | 1,371.00  | 12,613,200    |                         |
| ジャステック                   | 11,000    | 1,358.00  | 14,938,000    | 貸付有価証券<br>400株          |
| S C S K                  | 125,500   | 2,697.50  | 338,536,250   | 貸付有価証券<br>100株          |
| N S W                    | 8,000     | 2,962.00  | 23,696,000    |                         |
| アイネス                     | 14,000    | 1,492.00  | 20,888,000    |                         |
| T K C                    | 28,400    | 3,685.00  | 104,654,000   |                         |
| 富士ソフト                    | 36,100    | 6,210.00  | 224,181,000   | 貸付有価証券<br>17,000株（400株） |
| N S D                    | 64,000    | 2,723.00  | 174,272,000   |                         |
| コナミグループ                  | 67,200    | 9,795.00  | 658,224,000   |                         |
| 福井コンピュータホールディングス         | 11,100    | 2,623.00  | 29,115,300    |                         |
| J B C Cホールディングス          | 11,900    | 3,890.00  | 46,291,000    |                         |
| ミロク情報サービス                | 16,300    | 1,979.00  | 32,257,700    |                         |

|                         |         |          |               |                          |
|-------------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| ソフトバンクグループ              | 884,700 | 8,548.00 | 7,562,415,600 | 貸付有価証券<br>800株           |
| 高千穂交易                   | 6,000   | 3,915.00 | 23,490,000    | 貸付有価証券<br>2,800株         |
| オルバヘルスケアホール<br>ディングス    | 1,400   | 1,827.00 | 2,557,800     |                          |
| 伊藤忠食品                   | 4,300   | 7,750.00 | 33,325,000    |                          |
| エレマテック                  | 17,000  | 1,789.00 | 30,413,000    |                          |
| あらた                     | 28,900  | 3,190.00 | 92,191,000    | 貸付有価証券<br>400株           |
| トーメンデバイス                | 2,700   | 5,120.00 | 13,824,000    |                          |
| 東京エレクトロン デバ<br>イス       | 18,900  | 6,740.00 | 127,386,000   |                          |
| 円谷フィールズホール<br>ディングス     | 32,500  | 1,621.00 | 52,682,500    | 貸付有価証券<br>15,300株        |
| 双日                      | 210,600 | 3,812.00 | 802,807,200   |                          |
| アルフレッサ ホール<br>ディングス     | 189,900 | 2,323.50 | 441,232,650   | 貸付有価証券<br>300株           |
| 横浜冷凍                    | 51,500  | 1,089.00 | 56,083,500    | 貸付有価証券<br>700株           |
| 神栄                      | 1,200   | 1,645.00 | 1,974,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| ラサ商事                    | 7,700   | 1,648.00 | 12,689,600    |                          |
| アルコニックス                 | 24,900  | 1,393.00 | 34,685,700    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 神戸物産                    | 146,400 | 3,759.00 | 550,317,600   | 貸付有価証券<br>300株           |
| ハイパー                    | 1,800   | 308.00   | 554,400       |                          |
| あい ホールディングス             | 30,300  | 2,442.00 | 73,992,600    | 貸付有価証券<br>14,200株        |
| ディーブイエックス               | 2,300   | 1,066.00 | 2,451,800     |                          |
| ダイワボウホールディン<br>グス       | 83,800  | 2,708.00 | 226,930,400   | 貸付有価証券<br>600株           |
| マクニカホールディン<br>グス        | 44,800  | 8,168.00 | 365,926,400   | 貸付有価証券<br>5,500株（5,500株） |
| ラクト・ジャパン                | 7,300   | 2,214.00 | 16,162,200    | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| グリムス                    | 8,000   | 1,929.00 | 15,432,000    |                          |
| バイタルケーエスケー・<br>ホールディングス | 28,600  | 1,295.00 | 37,037,000    |                          |
| 八洲電機                    | 15,300  | 1,330.00 | 20,349,000    |                          |
| メディアスホールディン<br>グス       | 11,000  | 742.00   | 8,162,000     |                          |
| レスターホールディン<br>グス        | 16,100  | 2,990.00 | 48,139,000    |                          |
| ジオリーブグループ               | 1,900   | 1,320.00 | 2,508,000     |                          |
| 大光                      | 4,400   | 626.00   | 2,754,400     | 貸付有価証券<br>2,000株         |
| OCHIホールディング<br>ス        | 1,900   | 1,587.00 | 3,015,300     |                          |
| TOKAIホールディン<br>グス       | 102,700 | 1,003.00 | 103,008,100   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 黒谷                      | 2,300   | 607.00   | 1,396,100     |                          |
| C o m i n i x           | 1,700   | 855.00   | 1,453,500     |                          |
| 三洋貿易                    | 21,300  | 1,335.00 | 28,435,500    |                          |
| ビューティガレージ               | 6,000   | 2,251.00 | 13,506,000    | 貸付有価証券                   |

|                  |         |          |             |                          |
|------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
|                  |         |          |             | 400株（400株）               |
| ウイン・パートナーズ       | 12,200  | 1,282.00 | 15,640,400  | 貸付有価証券<br>300株           |
| ミタチ産業            | 2,300   | 1,156.00 | 2,658,800   | 貸付有価証券<br>800株（800株）     |
| シップヘルスケアホールディングス | 68,000  | 2,149.50 | 146,166,000 |                          |
| 明治電機工業           | 7,000   | 1,485.00 | 10,395,000  |                          |
| デリカフーズホールディングス   | 3,600   | 587.00   | 2,113,200   |                          |
| スターティアホールディングス   | 2,200   | 1,586.00 | 3,489,200   | 貸付有価証券<br>900株（600株）     |
| コメダホールディングス      | 46,400  | 2,762.00 | 128,156,800 | 貸付有価証券<br>3,500株（100株）   |
| ピーバンドットコム        | 1,100   | 382.00   | 420,200     |                          |
| アセンテック           | 7,200   | 643.00   | 4,629,600   | 貸付有価証券<br>600株（500株）     |
| 富士興産             | 2,300   | 2,108.00 | 4,848,400   |                          |
| 協栄産業             | 900     | 3,035.00 | 2,731,500   |                          |
| フルサト・マルカホールディングス | 16,800  | 2,267.00 | 38,085,600  | 貸付有価証券<br>200株           |
| ヤマエグループホールディングス  | 12,500  | 2,583.00 | 32,287,500  | 貸付有価証券<br>2,800株         |
| 小野建              | 18,600  | 1,753.00 | 32,605,800  |                          |
| 南陽               | 1,700   | 2,429.00 | 4,129,300   |                          |
| 佐島電機             | 10,600  | 2,266.00 | 24,019,600  |                          |
| エコートレーディング       | 1,600   | 1,270.00 | 2,032,000   | 貸付有価証券<br>1,000株（1,000株） |
| 伯東               | 10,800  | 5,900.00 | 63,720,000  | 貸付有価証券<br>400株           |
| コンドーテック          | 14,500  | 1,216.00 | 17,632,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| 中山福              | 4,500   | 366.00   | 1,647,000   | 貸付有価証券<br>200株           |
| ナガイレーベン          | 23,900  | 2,332.00 | 55,734,800  |                          |
| 三菱食品             | 17,500  | 5,080.00 | 88,900,000  | 貸付有価証券<br>400株           |
| 松田産業             | 14,400  | 2,423.00 | 34,891,200  | 貸付有価証券<br>300株           |
| 第一興商             | 73,200  | 1,921.00 | 140,617,200 | 貸付有価証券<br>1,100株         |
| メディパルホールディングス    | 192,400 | 2,380.00 | 457,912,000 |                          |
| S P K            | 8,400   | 2,049.00 | 17,211,600  |                          |
| 萩原電気ホールディングス     | 8,100   | 4,700.00 | 38,070,000  | 貸付有価証券<br>200株           |
| アズワン             | 29,600  | 5,239.00 | 155,074,400 |                          |
| スズデン             | 6,600   | 2,210.00 | 14,586,000  | 貸付有価証券<br>2,700株         |
| 尾家産業             | 2,000   | 1,707.00 | 3,414,000   |                          |
| シモジマ             | 12,700  | 1,275.00 | 16,192,500  |                          |
| ドウシシャ            | 17,500  | 2,127.00 | 37,222,500  | 貸付有価証券<br>300株           |
| 小津産業             | 1,900   | 1,662.00 | 3,157,800   | 貸付有価証券<br>800株（700株）     |
| 高速               | 11,200  | 2,373.00 | 26,577,600  |                          |

|                  |           |          |                |                          |
|------------------|-----------|----------|----------------|--------------------------|
| たけびし             | 7,200     | 1,969.00 | 14,176,800     |                          |
| リックス             | 3,800     | 3,695.00 | 14,041,000     |                          |
| 丸文               | 16,900    | 1,530.00 | 25,857,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| ハビネット            | 16,100    | 3,200.00 | 51,520,000     |                          |
| 橋本総業ホールディングス     | 7,500     | 1,315.00 | 9,862,500      |                          |
| 日本ライフライン         | 55,400    | 1,267.00 | 70,191,800     |                          |
| タカショー            | 16,500    | 515.00   | 8,497,500      | 貸付有価証券<br>7,700株（900株）   |
| I DOM            | 50,000    | 883.00   | 44,150,000     |                          |
| 進和               | 11,600    | 2,433.00 | 28,222,800     | 貸付有価証券<br>600株           |
| エスケイジャパン         | 2,000     | 708.00   | 1,416,000      |                          |
| ダイترون           | 7,500     | 2,896.00 | 21,720,000     |                          |
| シークス             | 27,000    | 1,550.00 | 41,850,000     | 貸付有価証券<br>300株           |
| 田中商事             | 2,400     | 810.00   | 1,944,000      |                          |
| オーハシテクニカ         | 9,900     | 1,761.00 | 17,433,900     |                          |
| 白銅               | 5,300     | 2,479.00 | 13,138,700     | 貸付有価証券<br>3,100株         |
| ダイコー通産           | 900       | 1,241.00 | 1,116,900      |                          |
| 伊藤忠商事            | 1,271,800 | 6,620.00 | 8,419,316,000  |                          |
| 丸紅               | 1,577,400 | 2,458.50 | 3,878,037,900  | 貸付有価証券<br>54,700株        |
| 高島               | 5,700     | 1,349.00 | 7,689,300      | 貸付有価証券<br>900株（900株）     |
| 長瀬産業             | 86,700    | 2,466.00 | 213,802,200    | 貸付有価証券<br>300株           |
| 蝶理               | 11,800    | 2,996.00 | 35,352,800     |                          |
| 豊田通商             | 165,700   | 9,342.00 | 1,547,969,400  | 貸付有価証券<br>900株           |
| 三共生興             | 26,200    | 771.00   | 20,200,200     |                          |
| 兼松               | 79,100    | 2,375.00 | 187,862,500    |                          |
| ツカモトコーポレーショ<br>ン | 1,200     | 1,282.00 | 1,538,400      |                          |
| 三井物産             | 1,425,500 | 6,512.00 | 9,282,856,000  |                          |
| 日本紙パルプ商事         | 9,000     | 4,975.00 | 44,775,000     |                          |
| カメイ              | 20,100    | 1,884.00 | 37,868,400     |                          |
| 東都水産             | 400       | 6,260.00 | 2,504,000      | 貸付有価証券<br>200株           |
| OUGホールディングス      | 1,200     | 2,620.00 | 3,144,000      |                          |
| スターゼン            | 13,100    | 2,758.00 | 36,129,800     |                          |
| 山善               | 57,400    | 1,290.00 | 74,046,000     | 貸付有価証券<br>5,700株（5,700株） |
| 椿本興業             | 3,900     | 6,810.00 | 26,559,000     |                          |
| 住友商事             | 1,145,100 | 3,605.00 | 4,128,085,500  | 貸付有価証券<br>10,600株        |
| 内田洋行             | 7,700     | 7,930.00 | 61,061,000     |                          |
| 三菱商事             | 3,749,000 | 3,196.00 | 11,981,804,000 | 貸付有価証券<br>100株           |
| 第一実業             | 17,800    | 1,967.00 | 35,012,600     |                          |



|                       |        |          |             |                   |
|-----------------------|--------|----------|-------------|-------------------|
| キヤノンマーケティング<br>ジャパン   | 43,800 | 4,251.00 | 186,193,800 | 貸付有価証券<br>20,500株 |
| 西華産業                  | 7,400  | 2,992.00 | 22,140,800  |                   |
| 佐藤商事                  | 13,100 | 1,771.00 | 23,200,100  |                   |
| 菱洋エレクトロ               | 17,900 | 3,900.00 | 69,810,000  | 貸付有価証券<br>600株    |
| 東京産業                  | 17,300 | 740.00   | 12,802,000  | 貸付有価証券<br>300株    |
| ユアサ商事                 | 14,800 | 5,050.00 | 74,740,000  |                   |
| 神鋼商事                  | 4,700  | 7,290.00 | 34,263,000  | 貸付有価証券<br>100株    |
| トルク                   | 4,500  | 284.00   | 1,278,000   |                   |
| 阪和興業                  | 34,000 | 5,790.00 | 196,860,000 | 貸付有価証券<br>700株    |
| 正栄食品工業                | 12,600 | 4,675.00 | 58,905,000  | 貸付有価証券<br>3,400株  |
| カナデン                  | 14,200 | 1,570.00 | 22,294,000  |                   |
| RYODEN                | 15,300 | 2,625.00 | 40,162,500  | 貸付有価証券<br>6,600株  |
| 岩谷産業                  | 43,100 | 7,383.00 | 318,207,300 | 貸付有価証券<br>2,200株  |
| ナイス                   | 2,600  | 1,601.00 | 4,162,600   |                   |
| ニチモウ                  | 2,700  | 2,146.00 | 5,794,200   | 貸付有価証券<br>100株    |
| 極東貿易                  | 11,300 | 2,130.00 | 24,069,000  | 貸付有価証券<br>100株    |
| アステナホールディング<br>ス      | 35,500 | 475.00   | 16,862,500  |                   |
| 三愛オブリ                 | 45,500 | 1,925.00 | 87,587,500  | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| 稲畑産業                  | 37,400 | 3,185.00 | 119,119,000 | 貸付有価証券<br>1,000株  |
| G S I クレオス            | 10,100 | 2,417.00 | 24,411,700  |                   |
| 明和産業                  | 22,400 | 707.00   | 15,836,800  | 貸付有価証券<br>200株    |
| クワザワホールディング<br>ス      | 3,000  | 795.00   | 2,385,000   | 貸付有価証券<br>100株    |
| ワキタ                   | 31,300 | 1,594.00 | 49,892,200  | 貸付有価証券<br>6,500株  |
| 東邦ホールディングス            | 52,300 | 3,268.00 | 170,916,400 | 貸付有価証券<br>700株    |
| サンゲツ                  | 43,500 | 3,610.00 | 157,035,000 | 貸付有価証券<br>700株    |
| ミツウロコグループホー<br>ルディングス | 24,100 | 1,535.00 | 36,993,500  | 貸付有価証券<br>300株    |
| シナネンホールディング<br>ス      | 5,200  | 4,175.00 | 21,710,000  |                   |
| 伊藤忠エネクス               | 46,900 | 1,532.00 | 71,850,800  | 貸付有価証券<br>100株    |
| サンリオ                  | 53,600 | 7,433.00 | 398,408,800 | 貸付有価証券<br>2,500株  |
| サンワテクノス               | 9,700  | 2,265.00 | 21,970,500  |                   |
| リョーサン                 | 13,400 | 5,080.00 | 68,072,000  | 貸付有価証券<br>100株    |
| 新光商事                  | 25,400 | 1,224.00 | 31,089,600  |                   |
| トーヨー                  | 7,400  | 2,905.00 | 21,497,000  |                   |

|                         |         |          |             |                        |
|-------------------------|---------|----------|-------------|------------------------|
| 三信電気                    | 7,600   | 2,293.00 | 17,426,800  |                        |
| 東陽テクニカ                  | 19,200  | 1,493.00 | 28,665,600  |                        |
| モスフードサービス               | 27,800  | 3,480.00 | 96,744,000  | 貸付有価証券<br>100株         |
| 加賀電子                    | 17,300  | 6,400.00 | 110,720,000 | 貸付有価証券<br>200株         |
| ソーダニッカ                  | 16,000  | 1,185.00 | 18,960,000  | 貸付有価証券<br>200株         |
| 立花エレテック                 | 12,600  | 3,085.00 | 38,871,000  |                        |
| フォーバル                   | 7,400   | 1,367.00 | 10,115,800  | 貸付有価証券<br>3,200株       |
| PAL TAC                 | 25,500  | 4,333.00 | 110,491,500 |                        |
| 三谷産業                    | 33,000  | 392.00   | 12,936,000  | 貸付有価証券<br>900株         |
| 太平洋興発                   | 3,100   | 836.00   | 2,591,600   |                        |
| 西本Wismettac<br>ホールディングス | 4,800   | 6,970.00 | 33,456,000  |                        |
| ヤマシタヘルスケアホー<br>ルディングス   | 700     | 2,409.00 | 1,686,300   |                        |
| コア商事ホールディン<br>グス        | 13,200  | 714.00   | 9,424,800   |                        |
| KPPグループホール<br>ディングス     | 49,000  | 632.00   | 30,968,000  | 貸付有価証券<br>2,200株       |
| ヤマタネ                    | 8,300   | 2,549.00 | 21,156,700  |                        |
| 丸紅建材リース                 | 600     | 2,788.00 | 1,672,800   |                        |
| 泉州電業                    | 8,800   | 3,700.00 | 32,560,000  |                        |
| トラスコ中山                  | 39,700  | 2,380.00 | 94,486,000  | 貸付有価証券<br>1,400株（200株） |
| オートボックスセブン              | 65,800  | 1,649.50 | 108,537,100 | 貸付有価証券<br>400株（300株）   |
| モリト                     | 13,500  | 1,419.00 | 19,156,500  | 貸付有価証券<br>100株         |
| 加藤産業                    | 23,400  | 4,810.00 | 112,554,000 | 貸付有価証券<br>100株         |
| 北恵                      | 2,100   | 847.00   | 1,778,700   |                        |
| イエローハット                 | 30,000  | 1,909.00 | 57,270,000  | 貸付有価証券<br>4,500株       |
| JKホールディングス              | 14,500  | 1,020.00 | 14,790,000  |                        |
| 日伝                      | 12,800  | 2,888.00 | 36,966,400  | 貸付有価証券<br>400株         |
| 北沢産業                    | 5,100   | 325.00   | 1,657,500   | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| 杉本商事                    | 9,100   | 2,244.00 | 20,420,400  |                        |
| 因幡電機産業                  | 49,000  | 3,510.00 | 171,990,000 | 貸付有価証券<br>500株         |
| 東テク                     | 6,300   | 6,820.00 | 42,966,000  |                        |
| ミスミグループ本社               | 285,700 | 2,094.50 | 598,398,650 | 貸付有価証券<br>1,800株       |
| アルテック                   | 4,500   | 256.00   | 1,152,000   |                        |
| タキヒヨー                   | 2,000   | 1,206.00 | 2,412,000   | 貸付有価証券<br>900株（100株）   |
| 蔵王産業                    | 1,500   | 2,630.00 | 3,945,000   |                        |
| スズケン                    | 72,000  | 4,929.00 | 354,888,000 | 貸付有価証券<br>300株         |
| ジェコス                    | 11,300  | 1,161.00 | 13,119,300  |                        |

|                    |         |           |             |                           |
|--------------------|---------|-----------|-------------|---------------------------|
| グローセル              | 22,100  | 748.00    | 16,530,800  | 貸付有価証券<br>2,200株（2,100株）  |
| ローソン               | 40,200  | 10,250.00 | 412,050,000 |                           |
| サンエー               | 14,400  | 4,550.00  | 65,520,000  | 貸付有価証券<br>6,800株          |
| カワチ薬品              | 14,800  | 2,728.00  | 40,374,400  | 貸付有価証券<br>6,900株          |
| エービーシー・マート         | 82,800  | 2,560.50  | 212,009,400 |                           |
| ハードオフコーポレーション      | 6,700   | 1,779.00  | 11,919,300  |                           |
| アスクル               | 45,700  | 2,050.00  | 93,685,000  | 貸付有価証券<br>3,200株（600株）    |
| ゲオホールディングス         | 21,200  | 2,116.00  | 44,859,200  | 貸付有価証券<br>500株            |
| アダストリア             | 22,800  | 3,530.00  | 80,484,000  | 貸付有価証券<br>10,700株         |
| ジーフット              | 6,800   | 301.00    | 2,046,800   | 貸付有価証券<br>3,100株          |
| シー・ヴィ・エス・ベイ<br>エリア | 1,100   | 758.00    | 833,800     | 貸付有価証券<br>600株            |
| くら寿司               | 22,100  | 4,100.00  | 90,610,000  | 貸付有価証券<br>2,500株          |
| キャンドウ              | 6,700   | 2,718.00  | 18,210,600  | 貸付有価証券<br>800株（100株）      |
| I Kホールディングス        | 2,900   | 388.00    | 1,125,200   |                           |
| パルグループホールディングス     | 37,100  | 2,252.00  | 83,549,200  |                           |
| エディオン              | 74,900  | 1,523.00  | 114,072,700 | 貸付有価証券<br>32,100株         |
| サーラコーポレーション        | 39,700  | 808.00    | 32,077,600  | 貸付有価証券<br>400株            |
| ワッツ                | 4,100   | 608.00    | 2,492,800   | 貸付有価証券<br>1,900株（900株）    |
| ハローズ               | 8,600   | 4,315.00  | 37,109,000  | 貸付有価証券<br>4,000株          |
| フジオフードグループ本社       | 21,200  | 1,365.00  | 28,938,000  | 貸付有価証券<br>9,900株          |
| あみやき亭              | 4,600   | 4,440.00  | 20,424,000  | 貸付有価証券<br>2,100株          |
| ひらまつ               | 20,000  | 252.00    | 5,040,000   | 貸付有価証券<br>7,700株          |
| 大黒天物産              | 5,800   | 8,810.00  | 51,098,000  |                           |
| ハニーズホールディングス       | 16,800  | 1,622.00  | 27,249,600  |                           |
| ファーマライズホールディングス    | 1,900   | 647.00    | 1,229,300   |                           |
| アルペン               | 15,600  | 2,005.00  | 31,278,000  | 貸付有価証券<br>7,300株（200株）    |
| ハブ                 | 2,700   | 726.00    | 1,960,200   | 貸付有価証券<br>200株            |
| クオールホールディングス       | 26,000  | 1,643.00  | 42,718,000  |                           |
| ジンズホールディングス        | 11,200  | 3,815.00  | 42,728,000  |                           |
| ビックカメラ             | 100,700 | 1,331.00  | 134,031,700 | 貸付有価証券<br>47,300株（200株）   |
| DCMホールディングス        | 100,000 | 1,396.00  | 139,600,000 | 貸付有価証券<br>10,500株         |
| MonotaRO           | 268,200 | 1,564.00  | 419,464,800 | 貸付有価証券<br>126,000株（25,600 |

|                          |         |          |             | 株)                          |
|--------------------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| 東京一番フーズ                  | 1,900   | 522.00   | 991,800     | 貸付有価証券<br>1,100株            |
| DDグループ                   | 5,400   | 1,538.00 | 8,305,200   | 貸付有価証券<br>2,500株            |
| きちりホールディングス              | 2,300   | 994.00   | 2,286,200   |                             |
| J. フロント リテイリ<br>ング       | 217,100 | 1,577.00 | 342,366,700 | 貸付有価証券<br>1,500株            |
| ドトール・日レスホール<br>ディングス     | 33,500  | 2,095.00 | 70,182,500  | 貸付有価証券<br>15,700株           |
| マツキヨココカラ&カン<br>パニー       | 344,200 | 2,613.50 | 899,566,700 | 貸付有価証券<br>300株 (300株)       |
| ブロンコビリー                  | 11,100  | 3,270.00 | 36,297,000  | 貸付有価証券<br>5,200株            |
| Z O Z O                  | 120,600 | 3,434.00 | 414,140,400 | 貸付有価証券<br>1,000株            |
| トレジャー・ファクト<br>リー         | 10,400  | 1,512.00 | 15,724,800  | 貸付有価証券<br>4,300株 (2,100株)   |
| 物語コーポレーション               | 31,600  | 4,695.00 | 148,362,000 | 貸付有価証券<br>12,500株           |
| 三越伊勢丹ホールディン<br>グス        | 318,600 | 2,129.50 | 678,458,700 |                             |
| Hame e                   | 7,600   | 1,116.00 | 8,481,600   |                             |
| マーケットエンタープラ<br>イズ        | 700     | 859.00   | 601,300     |                             |
| ウエルシアホールディン<br>グス        | 98,100  | 2,632.50 | 258,248,250 | 貸付有価証券<br>46,200株 (200株)    |
| クリエイイト S D ホール<br>ディングス  | 26,800  | 3,175.00 | 85,090,000  | 貸付有価証券<br>900株 (900株)       |
| 丸善CHIホールディン<br>グス        | 9,900   | 328.00   | 3,247,200   |                             |
| ミサワ                      | 1,700   | 628.00   | 1,067,600   |                             |
| ティーライフ                   | 1,100   | 1,402.00 | 1,542,200   | 貸付有価証券<br>600株 (100株)       |
| エー・ピーホールディン<br>グス        | 2,000   | 989.00   | 1,978,000   | 貸付有価証券<br>1,300株            |
| チムニー                     | 2,600   | 1,437.00 | 3,736,200   | 貸付有価証券<br>1,700株            |
| シュッピン                    | 17,100  | 1,057.00 | 18,074,700  | 貸付有価証券<br>5,900株 (800株)     |
| オイシックス・ラ・大地              | 25,400  | 1,433.00 | 36,398,200  | 貸付有価証券<br>11,600株 (7,100株)  |
| ネクステージ                   | 43,200  | 2,157.00 | 93,182,400  | 貸付有価証券<br>20,300株           |
| ジョイフル本田                  | 55,000  | 2,013.00 | 110,715,000 | 貸付有価証券<br>2,600株            |
| 鳥貴族ホールディングス              | 7,000   | 4,120.00 | 28,840,000  | 貸付有価証券<br>1,400株 (1,400株)   |
| ホットランド                   | 14,500  | 1,862.00 | 26,999,000  | 貸付有価証券<br>4,200株            |
| すかいらくホールディ<br>ングス        | 258,600 | 2,224.00 | 575,126,400 | 貸付有価証券<br>108,200株 (4,100株) |
| S F Pホールディングス            | 10,300  | 2,090.00 | 21,527,000  | 貸付有価証券<br>4,800株            |
| 綿半ホールディングス               | 14,700  | 1,480.00 | 21,756,000  |                             |
| ヨシックスホールディン<br>グス        | 3,900   | 2,873.00 | 11,204,700  |                             |
| ユナイテッド・スーパー<br>マーケット・ホール | 52,800  | 1,000.00 | 52,800,000  | 貸付有価証券<br>24,800株 (5,000株)  |

|                                   |         |           |               |                           |
|-----------------------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| ゴルフダイジェスト・オンライン                   | 8,600   | 606.00    | 5,211,600     | 貸付有価証券<br>4,000株（2,100株）  |
| B E E N O S                       | 7,700   | 1,397.00  | 10,756,900    | 貸付有価証券<br>700株            |
| あさひ                               | 17,500  | 1,277.00  | 22,347,500    |                           |
| 日本調剤                              | 12,900  | 1,431.00  | 18,459,900    | 貸付有価証券<br>400株            |
| コスモス薬品                            | 16,000  | 15,150.00 | 242,400,000   |                           |
| トーエル                              | 3,700   | 787.00    | 2,911,900     | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| セブン&アイ・ホールディングス                   | 652,100 | 6,263.00  | 4,084,102,300 | 貸付有価証券<br>90,200株         |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング              | 128,100 | 1,095.00  | 140,269,500   | 貸付有価証券<br>60,300株         |
| ツルハホールディングス                       | 39,700  | 10,980.00 | 435,906,000   | 貸付有価証券<br>8,300株          |
| サンマルクホールディングス                     | 15,200  | 2,217.00  | 33,698,400    |                           |
| フェリシモ                             | 1,900   | 925.00    | 1,757,500     | 貸付有価証券<br>100株            |
| トリドールホールディングス                     | 53,000  | 4,220.00  | 223,660,000   | 貸付有価証券<br>10,200株（1,200株） |
| T O K Y O B A S E                 | 22,700  | 296.00    | 6,719,200     | 貸付有価証券<br>8,700株（8,700株）  |
| ウィルプラスホールディングス                    | 1,700   | 981.00    | 1,667,700     |                           |
| J M ホールディングス                      | 14,300  | 2,433.00  | 34,791,900    |                           |
| サツドラホールディングス                      | 3,400   | 805.00    | 2,737,000     | 貸付有価証券<br>1,600株（1,600株）  |
| アレンザホールディングス                      | 14,100  | 1,163.00  | 16,398,300    | 貸付有価証券<br>6,600株          |
| 串カツ田中ホールディングス                     | 5,000   | 1,797.00  | 8,985,000     |                           |
| バロックジャパンリミテッド                     | 14,700  | 828.00    | 12,171,600    | 貸付有価証券<br>6,900株（400株）    |
| クスリのアオキホールディングス                   | 56,900  | 3,088.00  | 175,707,200   |                           |
| 力の源ホールディングス                       | 9,700   | 1,637.00  | 15,878,900    | 貸付有価証券<br>4,500株          |
| F O O D & L I F E C O M P A N I E | 100,900 | 3,068.00  | 309,561,200   |                           |
| メディカルシステムネットワーク                   | 20,500  | 611.00    | 12,525,500    |                           |
| 一家ホールディングス                        | 2,100   | 710.00    | 1,491,000     | 貸付有価証券<br>1,300株          |
| ジャパングラフトホールディングス                  | 6,500   | 166.00    | 1,079,000     | 貸付有価証券<br>700株            |
| はるやまホールディングス                      | 4,000   | 595.00    | 2,380,000     | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| ノジマ                               | 54,900  | 1,741.00  | 95,580,900    |                           |
| カップ・クリエイト                         | 29,700  | 1,670.00  | 49,599,000    | 貸付有価証券<br>14,000株         |
| ライトオン                             | 6,300   | 413.00    | 2,601,900     | 貸付有価証券<br>4,100株          |
| 良品計画                              | 206,500 | 2,373.00  | 490,024,500   |                           |
| パルミキホールディングス                      | 10,500  | 432.00    | 4,536,000     | 貸付有価証券<br>2,700株（1,400株）  |
| アドヴァングループ                         | 18,000  | 1,165.00  | 20,970,000    |                           |

|                          |         |          |               |                          |
|--------------------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| アルビス                     | 6,200   | 2,639.00 | 16,361,800    |                          |
| コナカ                      | 9,200   | 415.00   | 3,818,000     | 貸付有価証券<br>100株           |
| ハウス オブ ローゼ               | 1,000   | 1,623.00 | 1,623,000     |                          |
| G-7ホールディングス              | 20,600  | 1,446.00 | 29,787,600    |                          |
| イオン北海道                   | 55,900  | 930.00   | 51,987,000    | 貸付有価証券<br>26,200株        |
| コジマ                      | 31,300  | 755.00   | 23,631,500    | 貸付有価証券<br>14,700株        |
| ヒマラヤ                     | 2,600   | 943.00   | 2,451,800     | 貸付有価証券<br>800株（100株）     |
| コーナン商事                   | 23,200  | 3,930.00 | 91,176,000    | 貸付有価証券<br>10,900株        |
| エコス                      | 7,000   | 2,370.00 | 16,590,000    | 貸付有価証券<br>3,200株         |
| ワタミ                      | 20,000  | 1,033.00 | 20,660,000    | 貸付有価証券<br>4,200株         |
| マルシェ                     | 3,000   | 244.00   | 732,000       | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| パン・パシフィック・イ<br>ンターナショナルホ | 382,100 | 3,516.00 | 1,343,463,600 | 貸付有価証券<br>5,300株         |
| 西松屋チェーン                  | 37,200  | 2,137.00 | 79,496,400    | 貸付有価証券<br>17,500株        |
| ゼンショーホールディン<br>グス        | 96,300  | 6,741.00 | 649,158,300   |                          |
| 幸楽苑ホールディングス              | 14,000  | 1,396.00 | 19,544,000    | 貸付有価証券<br>6,500株（100株）   |
| ハークスレイ                   | 2,900   | 916.00   | 2,656,400     |                          |
| サイゼリヤ                    | 28,000  | 5,000.00 | 140,000,000   | 貸付有価証券<br>6,800株（1,500株） |
| VTホールディングス               | 71,800  | 520.00   | 37,336,000    |                          |
| 魚力                       | 6,600   | 2,406.00 | 15,879,600    |                          |
| ポプラ                      | 2,200   | 309.00   | 679,800       | 貸付有価証券<br>1,400株         |
| フジ・コーポレーション              | 9,000   | 1,739.00 | 15,651,000    |                          |
| ユナイテッドアローズ               | 22,200  | 1,790.00 | 39,738,000    | 貸付有価証券<br>300株           |
| ハイデイ日高                   | 28,100  | 2,752.00 | 77,331,200    | 貸付有価証券<br>13,200株        |
| YU-WA Creat<br>ion Holdi | 4,700   | 146.00   | 686,200       | 貸付有価証券<br>2,500株（2,400株） |
| コロワイド                    | 81,400  | 2,267.00 | 184,533,800   | 貸付有価証券<br>38,300株        |
| 壺番屋                      | 14,900  | 6,110.00 | 91,039,000    | 貸付有価証券<br>600株（300株）     |
| トップカルチャー                 | 2,700   | 152.00   | 410,400       | 貸付有価証券<br>100株           |
| PLANT                    | 1,900   | 1,704.00 | 3,237,600     |                          |
| スギホールディングス               | 38,100  | 7,095.00 | 270,319,500   | 貸付有価証券<br>8,000株         |
| 薬王堂ホールディングス              | 9,200   | 2,811.00 | 25,861,200    | 貸付有価証券<br>4,300株         |
| スクロール                    | 28,200  | 946.00   | 26,677,200    |                          |
| ヨンドシーホールディン<br>グス        | 17,900  | 1,956.00 | 35,012,400    | 貸付有価証券<br>8,400株         |
| 木曽路                      | 28,600  | 2,627.00 | 75,132,200    | 貸付有価証券<br>11,500株        |

|                    |         |          |               |                           |
|--------------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| S R S ホールディングス     | 31,200  | 1,182.00 | 36,878,400    | 貸付有価証券<br>14,700株         |
| 千趣会                | 34,800  | 297.00   | 10,335,600    | 貸付有価証券<br>16,400株         |
| リテールパートナーズ         | 28,100  | 1,755.00 | 49,315,500    | 貸付有価証券<br>12,300株         |
| 上新電機               | 18,700  | 2,370.00 | 44,319,000    | 貸付有価証券<br>200株            |
| 日本瓦斯               | 100,200 | 2,376.00 | 238,075,200   | 貸付有価証券<br>100株            |
| ロイヤルホールディングス       | 33,300  | 2,454.00 | 81,718,200    | 貸付有価証券<br>16,000株         |
| 東天紅                | 600     | 850.00   | 510,000       | 貸付有価証券<br>300株            |
| いなげや               | 18,400  | 1,226.00 | 22,558,400    |                           |
| チヨダ                | 18,100  | 884.00   | 16,000,400    | 貸付有価証券<br>500株            |
| ライフコーポレーション        | 19,800  | 3,735.00 | 73,953,000    |                           |
| リンガーハット            | 24,400  | 2,377.00 | 57,998,800    | 貸付有価証券<br>11,500株（2,300株） |
| MrMaxHD            | 23,800  | 629.00   | 14,970,200    |                           |
| テンアライド             | 11,100  | 317.00   | 3,518,700     | 貸付有価証券<br>1,300株（1,200株）  |
| AOKIホールディングス       | 40,600  | 1,156.00 | 46,933,600    | 貸付有価証券<br>100株            |
| オークワ               | 27,200  | 860.00   | 23,392,000    | 貸付有価証券<br>12,800株         |
| コメリ                | 29,100  | 3,305.00 | 96,175,500    | 貸付有価証券<br>2,800株          |
| 青山商事               | 40,400  | 1,671.00 | 67,508,400    |                           |
| しまむら               | 44,400  | 8,498.00 | 377,311,200   | 貸付有価証券<br>4,400株（600株）    |
| はせがわ               | 4,000   | 353.00   | 1,412,000     |                           |
| 高島屋                | 130,800 | 2,293.50 | 299,989,800   | 貸付有価証券<br>14,200株（800株）   |
| 松屋                 | 32,100  | 988.00   | 31,714,800    | 貸付有価証券<br>6,300株（4,800株）  |
| エイチ・ツー・オー<br>テイリング | 83,700  | 1,810.00 | 151,497,000   |                           |
| 近鉄百貨店              | 8,100   | 2,522.00 | 20,428,200    | 貸付有価証券<br>3,800株          |
| 丸井グループ             | 125,600 | 2,478.00 | 311,236,800   | 貸付有価証券<br>7,900株          |
| アクシアル<br>リテイリング    | 12,900  | 4,010.00 | 51,729,000    |                           |
| 井筒屋                | 4,000   | 353.00   | 1,412,000     | 貸付有価証券<br>2,600株          |
| イオン                | 641,400 | 3,602.00 | 2,310,322,800 | 貸付有価証券<br>150,300株（600株）  |
| イズミ                | 33,500  | 3,605.00 | 120,767,500   | 貸付有価証券<br>5,200株          |
| 平和堂                | 31,600  | 2,195.00 | 69,362,000    | 貸付有価証券<br>14,800株         |
| フジ                 | 29,000  | 1,969.00 | 57,101,000    | 貸付有価証券<br>13,600株         |
| ヤオコー               | 21,400  | 8,145.00 | 174,303,000   |                           |
| ゼビオホールディングス        | 25,600  | 972.00   | 24,883,200    | 貸付有価証券<br>300株            |

|                    |         |           |               |                        |
|--------------------|---------|-----------|---------------|------------------------|
| ケーズホールディングス        | 127,100 | 1,238.50  | 157,413,350   |                        |
| O l y m p i c グループ | 3,700   | 555.00    | 2,053,500     | 貸付有価証券<br>1,700株       |
| 日産東京販売ホールディングス     | 12,500  | 501.00    | 6,262,500     | 貸付有価証券<br>4,400株       |
| シルバーライフ            | 3,600   | 847.00    | 3,049,200     |                        |
| Genky Drug Stores  | 8,300   | 6,380.00  | 52,954,000    | 貸付有価証券<br>3,500株       |
| ナルミヤ・インターナショナル     | 1,400   | 1,244.00  | 1,741,600     | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| ブックオフグループホールディングス  | 11,000  | 1,229.00  | 13,519,000    | 貸付有価証券<br>3,300株（800株） |
| ギフトホールディングス        | 8,000   | 2,949.00  | 23,592,000    |                        |
| アインホールディングス        | 26,100  | 4,655.00  | 121,495,500   |                        |
| 元気寿司               | 10,700  | 3,455.00  | 36,968,500    | 貸付有価証券<br>4,600株       |
| ヤマダホールディングス        | 581,900 | 437.70    | 254,697,630   | 貸付有価証券<br>600株         |
| アー克蘭ズ              | 56,300  | 1,676.00  | 94,358,800    | 貸付有価証券<br>26,400株      |
| ニトリホールディングス        | 68,900  | 22,155.00 | 1,526,479,500 | 貸付有価証券<br>200株         |
| グルメ杵屋              | 15,300  | 1,106.00  | 16,921,800    | 貸付有価証券<br>7,200株       |
| 愛眼                 | 6,200   | 181.00    | 1,122,200     | 貸付有価証券<br>100株         |
| ケーユーホールディングス       | 8,900   | 1,171.00  | 10,421,900    |                        |
| 吉野家ホールディングス        | 69,700  | 3,296.00  | 229,731,200   | 貸付有価証券<br>32,800株      |
| 松屋フーズホールディングス      | 8,900   | 5,630.00  | 50,107,000    |                        |
| サガミホールディングス        | 28,400  | 1,504.00  | 42,713,600    | 貸付有価証券<br>13,300株      |
| 関西フードマーケット         | 12,800  | 1,582.00  | 20,249,600    |                        |
| 王将フードサービス          | 14,000  | 7,750.00  | 108,500,000   |                        |
| ミニストップ             | 13,700  | 1,630.00  | 22,331,000    | 貸付有価証券<br>6,400株       |
| アークス               | 34,700  | 3,065.00  | 106,355,500   | 貸付有価証券<br>16,300株      |
| バローホールディングス        | 36,100  | 2,461.00  | 88,842,100    | 貸付有価証券<br>100株         |
| ベルク                | 9,400   | 6,590.00  | 61,946,000    | 貸付有価証券<br>300株         |
| 大庄                 | 9,100   | 1,324.00  | 12,048,400    | 貸付有価証券<br>4,200株       |
| ファーストリテイリング        | 85,100  | 42,060.00 | 3,579,306,000 | 貸付有価証券<br>100株         |
| サンドラッグ             | 63,800  | 4,505.00  | 287,419,000   | 貸付有価証券<br>100株（100株）   |
| サックスパーホールディングス     | 16,000  | 859.00    | 13,744,000    | 貸付有価証券<br>200株         |
| ヤマザワ               | 1,800   | 1,270.00  | 2,286,000     |                        |
| やまや                | 1,700   | 3,390.00  | 5,763,000     | 貸付有価証券<br>700株         |
| ペルーナ               | 45,500  | 618.00    | 28,119,000    | 貸付有価証券<br>1,600株       |
| いよぎんホールディング        | 209,600 | 1,090.00  | 228,464,000   |                        |



| ス                   |            |          |                |                           |
|---------------------|------------|----------|----------------|---------------------------|
| しずおかフィナンシャルグループ     | 391,300    | 1,450.00 | 567,385,000    | 貸付有価証券<br>5,400株          |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ    | 148,300    | 1,122.50 | 166,466,750    | 貸付有価証券<br>900株            |
| 楽天銀行                | 61,300     | 2,698.00 | 165,387,400    | 貸付有価証券<br>8,800株          |
| 京都フィナンシャルグループ       | 223,100    | 2,532.00 | 564,889,200    | 貸付有価証券<br>200株            |
| 島根銀行                | 2,300      | 529.00   | 1,216,700      |                           |
| じもとホールディングス         | 6,900      | 571.00   | 3,939,900      |                           |
| めぶきフィナンシャルグループ      | 873,900    | 438.90   | 383,554,710    | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ   | 22,500     | 4,190.00 | 94,275,000     |                           |
| 九州フィナンシャルグループ       | 340,900    | 972.50   | 331,525,250    | 貸付有価証券<br>24,200株         |
| ゆうちょ銀行              | 1,935,300  | 1,545.50 | 2,991,006,150  | 貸付有価証券<br>27,600株         |
| 富山第一銀行              | 55,900     | 885.00   | 49,471,500     | 貸付有価証券<br>2,600株          |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 945,000    | 732.00   | 691,740,000    |                           |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | 99,400     | 1,623.00 | 161,326,200    | 貸付有価証券<br>100株            |
| 三十三フィナンシャルグループ      | 15,700     | 1,950.00 | 30,615,000     | 貸付有価証券<br>400株            |
| 第四北越フィナンシャルグループ     | 27,700     | 4,305.00 | 119,248,500    |                           |
| ひろぎんホールディングス        | 250,700    | 1,040.50 | 260,853,350    | 貸付有価証券<br>5,400株          |
| おきなわフィナンシャルグループ     | 15,000     | 2,457.00 | 36,855,000     |                           |
| 十六フィナンシャルグループ       | 22,800     | 4,295.00 | 97,926,000     |                           |
| 北國フィナンシャルホールディングス   | 18,500     | 4,770.00 | 88,245,000     |                           |
| プロクレアホールディングス       | 20,100     | 1,845.00 | 37,084,500     |                           |
| あいちフィナンシャルグループ      | 27,100     | 2,640.00 | 71,544,000     | 貸付有価証券<br>100株            |
| あおぞら銀行              | 126,600    | 2,136.00 | 270,417,600    | 貸付有価証券<br>59,500株（3,200株） |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ   | 10,725,500 | 1,497.50 | 16,061,436,250 | 貸付有価証券<br>336,800株        |
| りそなホールディングス         | 2,053,600  | 836.50   | 1,717,836,400  |                           |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 632,900    | 2,988.00 | 1,891,105,200  |                           |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 1,252,200  | 8,185.00 | 10,249,257,000 | 貸付有価証券<br>1,100株          |
| 千葉銀行                | 490,800    | 1,161.50 | 570,064,200    | 貸付有価証券<br>7,400株          |
| 群馬銀行                | 341,800    | 779.50   | 266,433,100    |                           |
| 武蔵野銀行               | 24,600     | 2,800.00 | 68,880,000     |                           |
| 千葉興業銀行              | 33,300     | 826.00   | 27,505,800     | 貸付有価証券<br>600株            |
| 筑波銀行                | 77,300     | 247.00   | 19,093,100     | 貸付有価証券<br>4,600株          |
| 七十七銀行               | 51,300     | 3,760.00 | 192,888,000    |                           |

|                     |           |          |               |                          |
|---------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| 秋田銀行                | 11,800    | 2,040.00 | 24,072,000    |                          |
| 山形銀行                | 19,600    | 1,105.00 | 21,658,000    | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| 岩手銀行                | 11,100    | 2,537.00 | 28,160,700    | 貸付有価証券<br>400株           |
| 東邦銀行                | 139,300   | 312.00   | 43,461,600    | 貸付有価証券<br>4,800株         |
| 東北銀行                | 3,800     | 1,208.00 | 4,590,400     |                          |
| ふくおかフィナンシャル<br>グループ | 153,400   | 3,735.00 | 572,949,000   | 貸付有価証券<br>500株           |
| スルガ銀行               | 155,200   | 799.00   | 124,004,800   | 貸付有価証券<br>19,300株        |
| 八十二銀行               | 377,900   | 870.00   | 328,773,000   | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| 山梨中央銀行              | 19,700    | 1,739.00 | 34,258,300    | 貸付有価証券<br>300株           |
| 大垣共立銀行              | 33,600    | 2,083.00 | 69,988,800    | 貸付有価証券<br>200株           |
| 福井銀行                | 15,700    | 1,790.00 | 28,103,000    |                          |
| 清水銀行                | 7,000     | 1,575.00 | 11,025,000    |                          |
| 富山銀行                | 1,300     | 1,787.00 | 2,323,100     |                          |
| 滋賀銀行                | 29,300    | 3,990.00 | 116,907,000   |                          |
| 南都銀行                | 26,500    | 2,726.00 | 72,239,000    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 百五銀行                | 165,700   | 620.00   | 102,734,000   | 貸付有価証券<br>4,500株（2,900株） |
| 紀陽銀行                | 63,000    | 1,885.00 | 118,755,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| ほくほくフィナンシャル<br>グループ | 109,000   | 1,708.00 | 186,172,000   | 貸付有価証券<br>2,000株（1,000株） |
| 山陰合同銀行              | 110,200   | 1,026.00 | 113,065,200   |                          |
| 鳥取銀行                | 2,700     | 1,421.00 | 3,836,700     | 貸付有価証券<br>100株           |
| 百十四銀行               | 17,300    | 2,734.00 | 47,298,200    | 貸付有価証券<br>900株           |
| 四国銀行                | 25,800    | 1,070.00 | 27,606,000    |                          |
| 阿波銀行                | 24,700    | 2,462.00 | 60,811,400    |                          |
| 大分銀行                | 10,600    | 2,660.00 | 28,196,000    | 貸付有価証券<br>400株           |
| 宮崎銀行                | 10,600    | 2,753.00 | 29,181,800    |                          |
| 佐賀銀行                | 10,300    | 1,903.00 | 19,600,900    |                          |
| 琉球銀行                | 37,500    | 1,144.00 | 42,900,000    |                          |
| セブン銀行               | 552,000   | 299.00   | 165,048,000   | 貸付有価証券<br>31,100株        |
| みずほフィナンシャルグ<br>ループ  | 2,377,200 | 2,766.50 | 6,576,523,800 | 貸付有価証券<br>69,500株        |
| 高知銀行                | 2,700     | 994.00   | 2,683,800     |                          |
| 山口フィナンシャルグ<br>ループ   | 172,700   | 1,527.50 | 263,799,250   | 貸付有価証券<br>100株           |
| 名古屋銀行               | 11,400    | 5,990.00 | 68,286,000    |                          |
| 北洋銀行                | 266,900   | 348.00   | 92,881,200    | 貸付有価証券<br>4,600株         |
| 大光銀行                | 2,500     | 1,424.00 | 3,560,000     |                          |
| 愛媛銀行                | 23,700    | 1,120.00 | 26,544,000    | 貸付有価証券                   |

|                      |           |          |               |                            |
|----------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
|                      |           |          |               | 700株                       |
| トマト銀行                | 2,800     | 1,214.00 | 3,399,200     |                            |
| 京葉銀行                 | 73,900    | 719.00   | 53,134,100    |                            |
| 栃木銀行                 | 88,000    | 307.00   | 27,016,000    | 貸付有価証券<br>500株             |
| 北日本銀行                | 5,700     | 2,143.00 | 12,215,100    |                            |
| 東和銀行                 | 32,300    | 661.00   | 21,350,300    |                            |
| 福島銀行                 | 8,200     | 233.00   | 1,910,600     | 貸付有価証券<br>2,600株（1,300株）   |
| 大東銀行                 | 3,400     | 750.00   | 2,550,000     | 貸付有価証券<br>500株             |
| トモニホールディングス          | 166,700   | 403.00   | 67,180,100    | 貸付有価証券<br>23,700株          |
| フィデアホールディングス         | 18,200    | 1,600.00 | 29,120,000    | 貸付有価証券<br>300株             |
| 池田泉州ホールディングス         | 244,300   | 358.00   | 87,459,400    | 貸付有価証券<br>6,000株（4,600株）   |
| F P G                | 59,600    | 1,864.00 | 111,094,400   | 貸付有価証券<br>500株             |
| ジャパンインベストメントアドバイザー   | 28,600    | 901.00   | 25,768,600    | 貸付有価証券<br>12,900株（900株）    |
| マーキュリアホールディングス       | 4,000     | 780.00   | 3,120,000     |                            |
| S B I ホールディングス       | 258,100   | 4,055.00 | 1,046,595,500 | 貸付有価証券<br>24,500株（17,900株） |
| 日本アジア投資              | 5,700     | 249.00   | 1,419,300     | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| ジャフコ グループ            | 52,500    | 1,747.00 | 91,717,500    |                            |
| 大和証券グループ本社           | 1,364,300 | 1,093.50 | 1,491,862,050 | 貸付有価証券<br>3,200株           |
| 野村ホールディングス           | 2,961,700 | 841.80   | 2,493,159,060 | 貸付有価証券<br>19,500株          |
| 岡三証券グループ             | 154,600   | 753.00   | 116,413,800   | 貸付有価証券<br>20,800株（1,100株）  |
| 丸三証券                 | 58,600    | 983.00   | 57,603,800    | 貸付有価証券<br>200株             |
| 東洋証券                 | 46,700    | 372.00   | 17,372,400    | 貸付有価証券<br>5,500株（1,900株）   |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 209,100   | 584.00   | 122,114,400   | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| 光世証券                 | 1,800     | 648.00   | 1,166,400     |                            |
| 水戸証券                 | 52,000    | 478.00   | 24,856,000    |                            |
| いちよし証券               | 33,000    | 808.00   | 26,664,000    |                            |
| 松井証券                 | 86,700    | 854.00   | 74,041,800    | 貸付有価証券<br>3,400株           |
| マネックスグループ            | 172,500   | 884.00   | 152,490,000   |                            |
| 極東証券                 | 24,100    | 1,031.00 | 24,847,100    | 貸付有価証券<br>100株             |
| 岩井コスモホールディングス        | 20,100    | 2,210.00 | 44,421,000    |                            |
| アイザワ証券グループ           | 25,400    | 1,242.00 | 31,546,800    | 貸付有価証券<br>300株             |
| マネーパートナーズグループ        | 8,100     | 301.00   | 2,438,100     | 貸付有価証券<br>200株             |
| スパークス・グループ           | 19,600    | 1,848.00 | 36,220,800    |                            |
| 小林洋行                 | 3,400     | 260.00   | 884,000       | 貸付有価証券<br>1,100株           |

|                         |           |           |               |                   |
|-------------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------|
| かんぽ生命保険                 | 179,400   | 2,694.50  | 483,393,300   |                   |
| F P パートナー               | 3,500     | 6,600.00  | 23,100,000    |                   |
| SOMPOホールディングス           | 264,900   | 9,016.00  | 2,388,338,400 | 貸付有価証券<br>12,200株 |
| アニコム ホールディングス           | 59,800    | 590.00    | 35,282,000    | 貸付有価証券<br>600株    |
| MS&ADインシュアランスグループホール    | 394,300   | 7,558.00  | 2,980,119,400 |                   |
| 第一生命ホールディングス            | 860,500   | 3,445.00  | 2,964,422,500 |                   |
| 東京海上ホールディングス            | 1,740,800 | 4,517.00  | 7,863,193,600 | 貸付有価証券<br>8,400株  |
| T & Dホールディングス           | 472,900   | 2,570.50  | 1,215,589,450 | 貸付有価証券<br>23,900株 |
| アドバンスクリエイト              | 10,200    | 1,040.00  | 10,608,000    | 貸付有価証券<br>100株    |
| 全国保証                    | 46,100    | 5,545.00  | 255,624,500   | 貸付有価証券<br>100株    |
| あんしん保証                  | 3,400     | 251.00    | 853,400       |                   |
| ジェイリース                  | 5,300     | 2,565.00  | 13,594,500    |                   |
| イントラスト                  | 3,000     | 825.00    | 2,475,000     |                   |
| 日本モーゲージサービス             | 4,300     | 535.00    | 2,300,500     | 貸付有価証券<br>1,800株  |
| C a s a                 | 3,000     | 819.00    | 2,457,000     | 貸付有価証券<br>1,400株  |
| S B I アルヒ               | 16,900    | 917.00    | 15,497,300    |                   |
| プレミアムグループ               | 29,700    | 1,749.00  | 51,945,300    |                   |
| ネットプロテクションズ<br>ホールディングス | 58,400    | 189.00    | 11,037,600    | 貸付有価証券<br>8,800株  |
| クレディセゾン                 | 111,600   | 2,791.00  | 311,475,600   | 貸付有価証券<br>200株    |
| 芙蓉総合リース                 | 16,200    | 13,700.00 | 221,940,000   |                   |
| みずほリース                  | 29,500    | 5,390.00  | 159,005,000   |                   |
| 東京センチュリー                | 131,600   | 1,612.50  | 212,205,000   | 貸付有価証券<br>18,100株 |
| 日本証券金融                  | 64,700    | 1,656.00  | 107,143,200   |                   |
| アイフル                    | 259,300   | 433.00    | 112,276,900   | 貸付有価証券<br>300株    |
| リコーリース                  | 16,700    | 5,100.00  | 85,170,000    | 貸付有価証券<br>300株    |
| イオンフィナンシャル<br>サービス      | 101,100   | 1,349.00  | 136,383,900   |                   |
| アコム                     | 314,300   | 404.30    | 127,071,490   | 貸付有価証券<br>3,600株  |
| ジャックス                   | 18,800    | 5,580.00  | 104,904,000   |                   |
| オリエントコーポレー<br>ション       | 57,500    | 1,078.00  | 61,985,000    | 貸付有価証券<br>700株    |
| オリックス                   | 1,073,500 | 3,105.00  | 3,333,217,500 | 貸付有価証券<br>61,900株 |
| 三菱HCキャピタル               | 784,800   | 1,043.00  | 818,546,400   | 貸付有価証券<br>200株    |
| 九州リースサービス               | 3,100     | 1,271.00  | 3,940,100     | 貸付有価証券<br>100株    |
| 日本取引所グループ               | 459,500   | 3,870.00  | 1,778,265,000 | 貸付有価証券<br>16,000株 |
| イー・ギャランティ               | 28,600    | 1,929.00  | 55,169,400    | 貸付有価証券            |

|                    |         |           |               |                            |
|--------------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
|                    |         |           |               | 100株                       |
| アサックス              | 3,500   | 749.00    | 2,621,500     |                            |
| N E C キャピタルソリューション | 8,600   | 3,715.00  | 31,949,000    |                            |
| Robot Home         | 48,800  | 166.00    | 8,100,800     | 貸付有価証券<br>600株             |
| 大東建託               | 64,500  | 17,040.00 | 1,099,080,000 | 貸付有価証券<br>27,400株（27,400株） |
| いちご                | 202,800 | 409.00    | 82,945,200    | 貸付有価証券<br>12,900株（8,800株）  |
| 日本駐車場開発            | 186,400 | 182.00    | 33,924,800    | 貸付有価証券<br>87,600株（400株）    |
| スター・マイカ・ホールディングス   | 20,500  | 543.00    | 11,131,500    |                            |
| S R Eホールディングス      | 7,600   | 3,300.00  | 25,080,000    | 貸付有価証券<br>1,100株           |
| A Dワークスグループ        | 19,800  | 241.00    | 4,771,800     | 貸付有価証券<br>1,100株（500株）     |
| ヒューリック             | 410,800 | 1,512.50  | 621,335,000   | 貸付有価証券<br>48,400株          |
| 野村不動産ホールディングス      | 98,000  | 3,699.00  | 362,502,000   | 貸付有価証券<br>7,900株           |
| 三重交通グループホールディングス   | 37,700  | 603.00    | 22,733,100    | 貸付有価証券<br>17,700株（900株）    |
| サムティ               | 28,000  | 2,510.00  | 70,280,000    |                            |
| ディア・ライフ            | 30,000  | 919.00    | 27,570,000    |                            |
| コーセーアールイー          | 2,500   | 901.00    | 2,252,500     | 貸付有価証券<br>1,400株（1,400株）   |
| 地主                 | 13,500  | 2,156.00  | 29,106,000    |                            |
| プレサンスコーポレーション      | 27,900  | 1,704.00  | 47,541,600    | 貸付有価証券<br>5,600株           |
| ハウスコム              | 1,300   | 967.00    | 1,257,100     |                            |
| J PMC              | 10,200  | 1,213.00  | 12,372,600    |                            |
| サンセイランディック         | 2,300   | 1,039.00  | 2,389,700     |                            |
| エストラスト             | 800     | 651.00    | 520,800       |                            |
| フージャースホールディングス     | 27,200  | 1,064.00  | 28,940,800    |                            |
| オープンハウスグループ        | 64,500  | 4,886.00  | 315,147,000   | 貸付有価証券<br>5,000株（1,000株）   |
| 東急不動産ホールディングス      | 529,500 | 982.20    | 520,074,900   | 貸付有価証券<br>38,700株          |
| 飯田グループホールディングス     | 168,700 | 1,941.50  | 327,531,050   | 貸付有価証券<br>13,400株（700株）    |
| イーグランド             | 1,200   | 1,566.00  | 1,879,200     |                            |
| ムゲンエステート           | 5,200   | 1,423.00  | 7,399,600     |                            |
| ビーロッド              | 5,400   | 975.00    | 5,265,000     |                            |
| ファーストブラザーズ         | 1,500   | 1,281.00  | 1,921,500     | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| A n d D oホールディングス  | 10,600  | 1,112.00  | 11,787,200    |                            |
| シーアールイー            | 9,800   | 1,324.00  | 12,975,200    |                            |
| ケイアイスター不動産         | 8,500   | 3,735.00  | 31,747,500    | 貸付有価証券<br>1,500株（1,500株）   |
| アグレ都市デザイン          | 1,400   | 1,634.00  | 2,287,600     |                            |
| グッドコムアセット          | 16,300  | 757.00    | 12,339,100    | 貸付有価証券                     |

|                  |           |           |               |                           |
|------------------|-----------|-----------|---------------|---------------------------|
|                  |           |           |               | 1,900株（900株）              |
| ジェイ・エス・ビー        | 8,700     | 2,755.00  | 23,968,500    |                           |
| ロードスターキャピタル      | 11,500    | 2,272.00  | 26,128,000    |                           |
| テンポイノベーション       | 2,400     | 949.00    | 2,277,600     |                           |
| グローバル・リンク・マネジメント | 1,500     | 2,870.00  | 4,305,000     |                           |
| フェイスネットワーク       | 2,100     | 1,453.00  | 3,051,300     | 貸付有価証券<br>100株            |
| 霞ヶ関キャピタル         | 4,800     | 13,800.00 | 66,240,000    | 貸付有価証券<br>2,200株（400株）    |
| パーク24            | 114,400   | 1,775.00  | 203,060,000   | 貸付有価証券<br>4,700株          |
| パラカ              | 6,200     | 1,955.00  | 12,121,000    |                           |
| ミガロホールディングス      | 1,200     | 1,420.00  | 1,704,000     |                           |
| 三井不動産            | 814,500   | 4,074.00  | 3,318,273,000 |                           |
| 三菱地所             | 1,151,200 | 2,113.50  | 2,433,061,200 | 貸付有価証券<br>22,700株（2,000株） |
| 平和不動産            | 28,600    | 3,990.00  | 114,114,000   | 貸付有価証券<br>300株            |
| 東京建物             | 153,900   | 2,166.00  | 333,347,400   | 貸付有価証券<br>31,300株         |
| 京阪神ビルディング        | 32,900    | 1,584.00  | 52,113,600    | 貸付有価証券<br>100株            |
| 住友不動産            | 254,700   | 4,686.00  | 1,193,524,200 |                           |
| テーオーシー           | 31,400    | 682.00    | 21,414,800    | 貸付有価証券<br>800株            |
| 東京楽天地            | 2,900     | 6,710.00  | 19,459,000    | 貸付有価証券<br>100株            |
| レオパレス21          | 176,200   | 428.00    | 75,413,600    | 貸付有価証券<br>41,000株         |
| スターツコーポレーション     | 25,300    | 3,030.00  | 76,659,000    | 貸付有価証券<br>200株            |
| フジ住宅             | 22,200    | 719.00    | 15,961,800    |                           |
| 空港施設             | 24,800    | 606.00    | 15,028,800    | 貸付有価証券<br>100株            |
| 明和地所             | 10,000    | 1,082.00  | 10,820,000    | 貸付有価証券<br>300株            |
| ゴールドクレスト         | 14,400    | 2,288.00  | 32,947,200    | 貸付有価証券<br>100株            |
| エスリード            | 8,300     | 3,345.00  | 27,763,500    |                           |
| 日神グループホールディングス   | 28,300    | 507.00    | 14,348,100    | 貸付有価証券<br>13,300株         |
| 日本エスコン           | 33,000    | 988.00    | 32,604,000    | 貸付有価証券<br>1,500株          |
| MIRARTHホールディングス  | 80,900    | 492.00    | 39,802,800    | 貸付有価証券<br>2,200株          |
| AVANTIA          | 4,400     | 891.00    | 3,920,400     |                           |
| イオンモール           | 91,300    | 1,826.00  | 166,713,800   | 貸付有価証券<br>42,900株         |
| 毎日コムネット          | 2,900     | 758.00    | 2,198,200     | 貸付有価証券<br>400株（400株）      |
| ファースト住建          | 3,200     | 1,096.00  | 3,507,200     | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| カチタス             | 47,300    | 1,932.00  | 91,383,600    | 貸付有価証券<br>8,000株          |
| トーセイ             | 29,300    | 2,060.00  | 60,358,000    | 貸付有価証券<br>100株            |

|                   |           |          |             |                            |
|-------------------|-----------|----------|-------------|----------------------------|
| 穴吹興産              | 1,900     | 2,104.00 | 3,997,600   | 貸付有価証券<br>500株（500株）       |
| サンフロンティア不動産       | 26,100    | 1,711.00 | 44,657,100  | 貸付有価証券<br>800株             |
| FJネクストホールディングス    | 18,500    | 1,183.00 | 21,885,500  | 貸付有価証券<br>100株             |
| インテリックス           | 1,900     | 550.00   | 1,045,000   |                            |
| ランドビジネス           | 2,900     | 264.00   | 765,600     | 貸付有価証券<br>200株（100株）       |
| サンネクスタグループ        | 2,600     | 958.00   | 2,490,800   |                            |
| グランディハウス          | 13,200    | 646.00   | 8,527,200   |                            |
| 日本空港ビルデング         | 62,300    | 5,845.00 | 364,143,500 | 貸付有価証券<br>100株             |
| 明豊ファシリティワークス      | 4,100     | 947.00   | 3,882,700   |                            |
| L I F U L L       | 62,800    | 167.00   | 10,487,600  | 貸付有価証券<br>13,600株（400株）    |
| M I X I           | 39,400    | 2,426.00 | 95,584,400  | 貸付有価証券<br>1,000株           |
| ジェイエシーリクルートメント    | 66,400    | 744.00   | 49,401,600  |                            |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 292,900   | 1,007.50 | 295,096,750 | 貸付有価証券<br>3,400株           |
| メンバーズ             | 6,300     | 945.00   | 5,953,500   | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| 中広                | 1,300     | 411.00   | 534,300     |                            |
| UTグループ            | 23,700    | 3,225.00 | 76,432,500  |                            |
| アイティメディア          | 7,000     | 1,987.00 | 13,909,000  | 貸付有価証券<br>3,200株           |
| ケアネット             | 28,200    | 668.00   | 18,837,600  | 貸付有価証券<br>8,200株（4,500株）   |
| E・Jホールディングス       | 10,800    | 1,680.00 | 18,144,000  |                            |
| オープンアップグループ       | 55,100    | 2,141.00 | 117,969,100 | 貸付有価証券<br>25,800株          |
| コシダカホールディングス      | 55,000    | 927.00   | 50,985,000  | 貸付有価証券<br>1,200株           |
| アルトナー             | 3,400     | 2,394.00 | 8,139,600   | 貸付有価証券<br>1,500株（1,400株）   |
| パソナグループ           | 22,300    | 2,664.00 | 59,407,200  | 貸付有価証券<br>900株             |
| CDS               | 2,000     | 1,699.00 | 3,398,000   |                            |
| リンクアンドモチベーション     | 52,900    | 617.00   | 32,639,300  | 貸付有価証券<br>600株             |
| エス・エム・エス          | 64,400    | 2,632.50 | 169,533,000 | 貸付有価証券<br>200株（200株）       |
| サニーサイドアップグループ     | 2,800     | 637.00   | 1,783,600   |                            |
| パーソルホールディングス      | 1,871,300 | 219.20   | 410,188,960 | 貸付有価証券<br>37,700株（24,500株） |
| リニカル              | 5,300     | 449.00   | 2,379,700   | 貸付有価証券<br>200株（100株）       |
| クックパッド            | 50,300    | 128.00   | 6,438,400   | 貸付有価証券<br>3,000株           |
| エスクリ              | 3,300     | 301.00   | 993,300     | 貸付有価証券<br>1,500株           |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス  | 4,000     | 722.00   | 2,888,000   | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| 学情                | 9,400     | 1,849.00 | 17,380,600  |                            |

|                  |         |          |             |                           |
|------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| スタジオアリス          | 9,200   | 2,065.00 | 18,998,000  | 貸付有価証券<br>4,300株（200株）    |
| シミックホールディングス     | 3,800   | 2,640.00 | 10,032,000  | 貸付有価証券<br>200株（200株）      |
| エプコ              | 2,200   | 896.00   | 1,971,200   | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| N J S            | 4,000   | 2,743.00 | 10,972,000  | 貸付有価証券<br>1,800株          |
| 総合警備保障           | 307,100 | 804.70   | 247,123,370 |                           |
| カカココム            | 121,400 | 1,725.00 | 209,415,000 |                           |
| アイロムグループ         | 7,400   | 1,823.00 | 13,490,200  | 貸付有価証券<br>1,500株（1,300株）  |
| セントケア・ホールディング    | 13,400  | 938.00   | 12,569,200  | 貸付有価証券<br>4,800株          |
| サイネックス           | 1,400   | 828.00   | 1,159,200   | 貸付有価証券<br>100株            |
| ルネサンス            | 14,300  | 1,087.00 | 15,544,100  | 貸付有価証券<br>6,700株（1,200株）  |
| ディップ             | 28,200  | 2,704.00 | 76,252,800  | 貸付有価証券<br>200株            |
| デジタルホールディングス     | 9,600   | 1,173.00 | 11,260,800  | 貸付有価証券<br>500株            |
| 新日本科学            | 16,700  | 1,600.00 | 26,720,000  | 貸付有価証券<br>7,800株（100株）    |
| キャリアデザインセンター     | 1,700   | 1,781.00 | 3,027,700   |                           |
| ベネフィット・ワン        | 63,900  | 2,167.50 | 138,503,250 |                           |
| エムスリー            | 363,300 | 2,096.00 | 761,476,800 | 貸付有価証券<br>29,700株（2,700株） |
| ツカダ・グローバルホールディング | 5,200   | 419.00   | 2,178,800   | 貸付有価証券<br>300株            |
| プラス              | 900     | 681.00   | 612,900     | 貸付有価証券<br>500株            |
| アウトソーシング         | 118,000 | 1,737.00 | 204,966,000 |                           |
| ウェルネット           | 7,300   | 539.00   | 3,934,700   |                           |
| ワールドホールディングス     | 8,300   | 2,455.00 | 20,376,500  |                           |
| ディー・エヌ・エー        | 65,300  | 1,266.00 | 82,669,800  | 貸付有価証券<br>7,900株          |
| 博報堂D Yホールディングス   | 234,500 | 1,447.50 | 339,438,750 | 貸付有価証券<br>4,500株          |
| ぐるなび             | 34,200  | 307.00   | 10,499,400  | 貸付有価証券<br>11,400株（8,700株） |
| タカミヤ             | 24,900  | 522.00   | 12,997,800  | 貸付有価証券<br>200株            |
| ジャパンベストレスキューシステム | 4,600   | 997.00   | 4,586,200   | 貸付有価証券<br>100株（100株）      |
| ファンコミュニケーションズ    | 25,700  | 403.00   | 10,357,100  | 貸付有価証券<br>4,600株（200株）    |
| ライク              | 6,800   | 1,568.00 | 10,662,400  | 貸付有価証券<br>2,300株          |
| A o b a - B B T  | 3,100   | 396.00   | 1,227,600   |                           |
| エスプール            | 52,800  | 310.00   | 16,368,000  | 貸付有価証券<br>22,900株（8,500株） |
| W D Bホールディングス    | 9,400   | 2,317.00 | 21,779,800  | 貸付有価証券<br>1,000株          |
| ティア              | 4,800   | 467.00   | 2,241,600   |                           |
| C D G            | 900     | 1,255.00 | 1,129,500   |                           |



|                        |           |          |               |                           |
|------------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
|                        |           |          |               |                           |
| アドウェイズ                 | 25,300    | 465.00   | 11,764,500    | 貸付有価証券<br>3,800株          |
| バリューコマース               | 16,100    | 1,169.00 | 18,820,900    | 貸付有価証券<br>1,200株          |
| インフォマート                | 190,800   | 393.00   | 74,984,400    | 貸付有価証券<br>100株            |
| J Pホールディングス            | 47,000    | 472.00   | 22,184,000    | 貸付有価証券<br>200株            |
| C Lホールディングス            | 4,300     | 1,024.00 | 4,403,200     | 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   | 86,000    | 605.00   | 52,030,000    | 貸付有価証券<br>6,600株（300株）    |
| アミューズ                  | 11,200    | 1,517.00 | 16,990,400    | 貸付有価証券<br>200株            |
| ドリームインキュベータ            | 6,300     | 3,170.00 | 19,971,000    |                           |
| クイック                   | 12,800    | 2,409.00 | 30,835,200    |                           |
| T A C                  | 4,000     | 191.00   | 764,000       |                           |
| 電通グループ                 | 180,700   | 4,305.00 | 777,913,500   | 貸付有価証券<br>4,500株          |
| テイクアンドギヴ・ニ<br>ーズ       | 7,000     | 1,120.00 | 7,840,000     |                           |
| ぴあ                     | 6,300     | 3,170.00 | 19,971,000    | 貸付有価証券<br>2,000株          |
| イオンファンタジー              | 6,600     | 2,530.00 | 16,698,000    | 貸付有価証券<br>3,600株          |
| シーティーエス                | 23,200    | 730.00   | 16,936,000    |                           |
| N E X Y Z. G r o u p   | 2,500     | 654.00   | 1,635,000     |                           |
| H. U. グループホール<br>ディングス | 53,800    | 2,749.50 | 147,923,100   | 貸付有価証券<br>100株            |
| アルプス技研                 | 17,500    | 2,924.00 | 51,170,000    |                           |
| 日本空調サービス               | 19,700    | 890.00   | 17,533,000    |                           |
| オリエンタルランド              | 972,800   | 5,553.00 | 5,401,958,400 | 貸付有価証券<br>6,200株          |
| ダスキン                   | 40,900    | 3,373.00 | 137,955,700   | 貸付有価証券<br>100株            |
| 明光ネットワークジャ<br>パン       | 22,300    | 731.00   | 16,301,300    | 貸付有価証券<br>500株（500株）      |
| ファルコホールディン<br>グス       | 8,300     | 2,298.00 | 19,073,400    |                           |
| 秀英予備校                  | 1,800     | 306.00   | 550,800       | 貸付有価証券<br>100株            |
| ラウンドワン                 | 173,000   | 687.00   | 118,851,000   | 貸付有価証券<br>53,200株         |
| リゾートトラスト               | 79,800    | 2,547.00 | 203,250,600   |                           |
| ビー・エム・エル               | 22,600    | 2,734.00 | 61,788,400    | 貸付有価証券<br>700株            |
| リソー教育                  | 94,000    | 233.00   | 21,902,000    | 貸付有価証券<br>44,100株（8,900株） |
| 早稲田アカデミー               | 10,200    | 1,647.00 | 16,799,400    | 貸付有価証券<br>4,700株（200株）    |
| ユー・エス・エス               | 206,200   | 2,643.50 | 545,089,700   |                           |
| 東京個別指導学院               | 21,800    | 447.00   | 9,744,600     | 貸付有価証券<br>600株（300株）      |
| サイバーエージェント             | 406,200   | 1,069.50 | 434,430,900   | 貸付有価証券<br>25,000株         |
| 楽天グループ                 | 1,575,700 | 792.50   | 1,248,742,250 | 貸付有価証券                    |

|                     |         |          |             |                        |
|---------------------|---------|----------|-------------|------------------------|
|                     |         |          |             | 302,600株               |
| クリーク・アンド・リバー社       | 9,200   | 1,921.00 | 17,673,200  |                        |
| SBIグローバルアセットマネジメント  | 36,000  | 732.00   | 26,352,000  | 貸付有価証券<br>13,000株      |
| テー・オー・ダブリュー         | 36,000  | 363.00   | 13,068,000  |                        |
| 山田コンサルティンググループ      | 8,000   | 1,711.00 | 13,688,000  |                        |
| セントラルスポーツ           | 6,900   | 2,445.00 | 16,870,500  | 貸付有価証券<br>3,200株       |
| フルキャストホールディングス      | 17,500  | 1,476.00 | 25,830,000  |                        |
| エン・ジャパン             | 29,900  | 2,782.00 | 83,181,800  | 貸付有価証券<br>4,400株       |
| リソルホールディングス         | 700     | 5,880.00 | 4,116,000   | 貸付有価証券<br>300株         |
| テクノプロ・ホールディングス      | 107,600 | 3,256.00 | 350,345,600 | 貸付有価証券<br>32,800株      |
| アトラグループ             | 2,400   | 182.00   | 436,800     | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| アイ・アールジャパンホールディングス  | 9,500   | 1,421.00 | 13,499,500  | 貸付有価証券<br>4,400株       |
| Keepertech          | 11,300  | 6,620.00 | 74,806,000  | 貸付有価証券<br>2,300株（100株） |
| ファーストロジック           | 1,900   | 516.00   | 980,400     |                        |
| 三機サービス              | 1,400   | 1,366.00 | 1,912,400   |                        |
| Gunosy              | 14,600  | 721.00   | 10,526,600  | 貸付有価証券<br>400株         |
| デザインワン・ジャパン         | 2,000   | 135.00   | 270,000     | 貸付有価証券<br>1,100株       |
| イー・ガーディアン           | 7,000   | 1,390.00 | 9,730,000   | 貸付有価証券<br>700株         |
| リブセンス               | 3,800   | 234.00   | 889,200     |                        |
| ジャパンマテリアル           | 56,300  | 2,676.00 | 150,658,800 |                        |
| ベクトル                | 22,600  | 1,240.00 | 28,024,000  | 貸付有価証券<br>2,000株       |
| ウチヤマホールディングス        | 3,500   | 363.00   | 1,270,500   |                        |
| チャーム・ケア・コーポレーション    | 15,300  | 1,383.00 | 21,159,900  | 貸付有価証券<br>100株         |
| キャリアリンク             | 6,700   | 2,589.00 | 17,346,300  |                        |
| IBJ                 | 14,000  | 609.00   | 8,526,000   | 貸付有価証券<br>500株         |
| アサンテ                | 9,100   | 1,680.00 | 15,288,000  | 貸付有価証券<br>1,600株       |
| パリュエーHR             | 16,100  | 1,380.00 | 22,218,000  | 貸付有価証券<br>5,200株       |
| M&Aキャピタルパートナーズ      | 14,900  | 2,520.00 | 37,548,000  | 貸付有価証券<br>1,500株       |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 7,300   | 1,083.00 | 7,905,900   | 貸付有価証券<br>3,400株       |
| ERIホールディングス         | 2,300   | 1,865.00 | 4,289,500   |                        |
| アビスト                | 1,300   | 3,175.00 | 4,127,500   |                        |
| シグマクシス・ホールディングス     | 24,800  | 1,668.00 | 41,366,400  |                        |
| ウィルグループ             | 15,300  | 1,140.00 | 17,442,000  | 貸付有価証券<br>200株         |
| エスクロー・エージェン         | 9,800   | 141.00   | 1,381,800   | 貸付有価証券                 |

|                       |           |          |               |                          |
|-----------------------|-----------|----------|---------------|--------------------------|
| ト・ジャパン                |           |          |               | 800株                     |
| メドピア                  | 16,100    | 792.00   | 12,751,200    | 貸付有価証券<br>1,700株         |
| レアジョブ                 | 1,600     | 946.00   | 1,513,600     | 貸付有価証券<br>900株           |
| リクルートホールディングス         | 1,360,900 | 6,008.00 | 8,176,287,200 |                          |
| エラン                   | 24,300    | 979.00   | 23,789,700    | 貸付有価証券<br>300株           |
| 土木管理総合試験所             | 3,800     | 331.00   | 1,257,800     |                          |
| 日本郵政                  | 2,160,200 | 1,413.00 | 3,052,362,600 | 貸付有価証券<br>4,600株         |
| ベルシステム24ホールディングス      | 19,700    | 1,794.00 | 35,341,800    | 貸付有価証券<br>100株           |
| 鎌倉新書                  | 15,700    | 582.00   | 9,137,400     | 貸付有価証券<br>8,600株（200株）   |
| SMN                   | 1,600     | 388.00   | 620,800       | 貸付有価証券<br>600株           |
| 一蔵                    | 1,000     | 579.00   | 579,000       |                          |
| グローバルキッズCOMPANY       | 1,500     | 633.00   | 949,500       | 貸付有価証券<br>500株           |
| エアトリ                  | 13,500    | 1,645.00 | 22,207,500    | 貸付有価証券<br>6,300株         |
| アトラエ                  | 10,800    | 515.00   | 5,562,000     | 貸付有価証券<br>4,400株         |
| ストライク                 | 7,800     | 5,250.00 | 40,950,000    |                          |
| ソラスト                  | 50,700    | 538.00   | 27,276,600    | 貸付有価証券<br>1,200株         |
| セラク                   | 5,600     | 1,131.00 | 6,333,600     | 貸付有価証券<br>300株           |
| インソース                 | 39,900    | 791.00   | 31,560,900    | 貸付有価証券<br>5,600株（900株）   |
| ベイカレント・コンサルティング       | 135,100   | 3,178.00 | 429,347,800   | 貸付有価証券<br>1,100株（1,100株） |
| Orchestra Holdings    | 3,900     | 1,150.00 | 4,485,000     |                          |
| アイモバイル                | 24,500    | 461.00   | 11,294,500    | 貸付有価証券<br>600株           |
| キャリアインデックス            | 2,800     | 180.00   | 504,000       | 貸付有価証券<br>1,500株（1,100株） |
| MS-Japan              | 6,700     | 1,189.00 | 7,966,300     |                          |
| 船場                    | 1,700     | 1,281.00 | 2,177,700     |                          |
| ジャパンエレベーターサービスホールディング | 59,600    | 2,275.00 | 135,590,000   | 貸付有価証券<br>100株           |
| フルテック                 | 1,100     | 1,143.00 | 1,257,300     |                          |
| グリーンズ                 | 3,000     | 2,225.00 | 6,675,000     | 貸付有価証券<br>100株（100株）     |
| ツナググループ・ホールディングス      | 2,300     | 808.00   | 1,858,400     |                          |
| GameWith              | 3,400     | 309.00   | 1,050,600     | 貸付有価証券<br>600株（100株）     |
| MS&Consulting         | 1,100     | 601.00   | 661,100       |                          |
| ウェルビー                 | 9,200     | 1,085.00 | 9,982,000     | 貸付有価証券<br>400株（400株）     |
| エル・ティー・エス             | 2,100     | 2,687.00 | 5,642,700     |                          |
| ミダックホールディングス          | 11,100    | 1,626.00 | 18,048,600    | 貸付有価証券<br>2,200株         |

|                    |        |          |             |                            |
|--------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| キュービーネットホールディングス   | 10,500 | 1,327.00 | 13,933,500  |                            |
| RPAホールディングス        | 25,000 | 265.00   | 6,625,000   | 貸付有価証券<br>900株（800株）       |
| スプリックス             | 2,400  | 806.00   | 1,934,400   |                            |
| マネジメントソリューションズ     | 7,900  | 3,030.00 | 23,937,000  | 貸付有価証券<br>1,200株           |
| プロレド・パートナーズ        | 4,500  | 360.00   | 1,620,000   |                            |
| and factory        | 2,400  | 315.00   | 756,000     | 貸付有価証券<br>1,400株           |
| テノ. ホールディングス       | 1,000  | 499.00   | 499,000     | 貸付有価証券<br>600株（600株）       |
| フロンティア・マネジメント      | 4,600  | 1,940.00 | 8,924,000   | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| ピアラ                | 1,500  | 319.00   | 478,500     | 貸付有価証券<br>700株（500株）       |
| コプロ・ホールディングス       | 2,700  | 1,716.00 | 4,633,200   |                            |
| ギークス               | 1,100  | 469.00   | 515,900     | 貸付有価証券<br>700株             |
| アンビスホールディングス       | 19,700 | 2,569.00 | 50,609,300  | 貸付有価証券<br>600株             |
| カーブスホールディングス       | 50,200 | 742.00   | 37,248,400  | 貸付有価証券<br>2,300株           |
| フォーラムエンジニアリング      | 25,000 | 927.00   | 23,175,000  | 貸付有価証券<br>300株             |
| Fast Fitness Japan | 6,300  | 1,015.00 | 6,394,500   |                            |
| ダイレクトマーケティングミックス   | 18,900 | 319.00   | 6,029,100   | 貸付有価証券<br>8,800株           |
| ポピンズ               | 2,700  | 1,493.00 | 4,031,100   | 貸付有価証券<br>300株             |
| LITALICO           | 14,300 | 2,152.00 | 30,773,600  | 貸付有価証券<br>2,400株           |
| コンフィデンス・インターワークス   | 700    | 1,625.00 | 1,137,500   |                            |
| アドバンテッジリスクマネジメント   | 4,200  | 418.00   | 1,755,600   |                            |
| リロググループ            | 92,100 | 1,289.00 | 118,716,900 | 貸付有価証券<br>600株             |
| 東祥                 | 12,800 | 792.00   | 10,137,600  | 貸付有価証券<br>6,000株           |
| ID&Eホールディングス       | 11,100 | 3,660.00 | 40,626,000  |                            |
| ビーウィズ              | 3,700  | 1,779.00 | 6,582,300   | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| TREホールディングス        | 35,200 | 1,208.00 | 42,521,600  | 貸付有価証券<br>800株             |
| 人・夢・技術グループ         | 6,900  | 1,748.00 | 12,061,200  |                            |
| NISSOホールディングス      | 15,900 | 800.00   | 12,720,000  | 貸付有価証券<br>7,500株           |
| 大栄環境               | 33,400 | 2,674.00 | 89,311,600  | 貸付有価証券<br>100株             |
| 日本管財ホールディングス       | 19,300 | 2,576.00 | 49,716,800  |                            |
| M&A総研ホールディングス      | 8,800  | 6,490.00 | 57,112,000  |                            |
| エイチ・アイ・エス          | 53,400 | 1,737.00 | 92,755,800  | 貸付有価証券<br>25,000株（18,600株） |
| ラックランド             | 8,300  | 2,576.00 | 21,380,800  | 貸付有価証券                     |

|                   |           |           |                 |                            |
|-------------------|-----------|-----------|-----------------|----------------------------|
|                   |           |           |                 | 3,900株（100株）               |
| 共立メンテナンス          | 28,800    | 6,306.00  | 181,612,800     | 貸付有価証券<br>13,000株（12,900株） |
| イチネンホールディングス      | 19,500    | 1,684.00  | 32,838,000      |                            |
| 建設技術研究所           | 9,500     | 5,740.00  | 54,530,000      |                            |
| スペース              | 12,000    | 975.00    | 11,700,000      |                            |
| 燦ホールディングス         | 17,200    | 1,057.00  | 18,180,400      | 貸付有価証券<br>800株             |
| スバル興業             | 5,700     | 3,090.00  | 17,613,000      |                            |
| 東京テアトル            | 3,000     | 1,138.00  | 3,414,000       | 貸付有価証券<br>100株（100株）       |
| タナベコンサルティンググループ   | 6,300     | 1,037.00  | 6,533,100       |                            |
| ナガワ               | 5,700     | 7,190.00  | 40,983,000      | 貸付有価証券<br>2,700株           |
| 東京都競馬             | 15,400    | 4,280.00  | 65,912,000      | 貸付有価証券<br>7,200株（1,900株）   |
| 常磐興産              | 3,100     | 1,247.00  | 3,865,700       |                            |
| カナモト              | 28,500    | 2,938.00  | 83,733,000      |                            |
| ニシオホールディングス       | 17,100    | 3,880.00  | 66,348,000      |                            |
| トランス・コスモス         | 22,800    | 2,953.00  | 67,328,400      |                            |
| 乃村工藝社             | 80,200    | 879.00    | 70,495,800      |                            |
| 藤田観光              | 7,300     | 6,850.00  | 50,005,000      | 貸付有価証券<br>3,400株（100株）     |
| KN T－C Tホールディングス  | 11,000    | 1,241.00  | 13,651,000      | 貸付有価証券<br>800株             |
| トーカイ              | 16,300    | 2,149.00  | 35,028,700      |                            |
| 白洋舎               | 1,300     | 2,653.00  | 3,448,900       | 貸付有価証券<br>600株             |
| セコム               | 187,200   | 10,995.00 | 2,058,264,000   | 貸付有価証券<br>100株             |
| セントラル警備保障         | 9,900     | 2,598.00  | 25,720,200      |                            |
| 丹青社               | 35,600    | 802.00    | 28,551,200      | 貸付有価証券<br>9,900株           |
| メイテックグループホールディングス | 66,200    | 3,004.00  | 198,864,800     | 貸付有価証券<br>1,800株           |
| 応用地質              | 17,200    | 2,346.00  | 40,351,200      |                            |
| 船井総研ホールディングス      | 38,300    | 2,669.00  | 102,222,700     |                            |
| 進学会ホールディングス       | 2,100     | 263.00    | 552,300         | 貸付有価証券<br>1,200株（200株）     |
| オオバ               | 5,500     | 996.00    | 5,478,000       | 貸付有価証券<br>2,800株           |
| いであ               | 2,200     | 2,347.00  | 5,163,400       |                            |
| 学究社               | 7,300     | 2,108.00  | 15,388,400      |                            |
| ベネッセホールディングス      | 61,800    | 2,595.00  | 160,371,000     | 貸付有価証券<br>2,800株（1,800株）   |
| イオンディライト          | 19,700    | 3,535.00  | 69,639,500      |                            |
| ナック               | 15,600    | 527.00    | 8,221,200       | 貸付有価証券<br>3,600株           |
| ダイセキ              | 37,500    | 4,000.00  | 150,000,000     |                            |
| ステップ              | 6,700     | 2,034.00  | 13,627,800      |                            |
| 小計                | 銘柄数：2,134 |           | 669,607,594,350 |                            |

|    |              |  |  |                 |  |
|----|--------------|--|--|-----------------|--|
|    | 組入時価比率：98.8% |  |  | 100.0%          |  |
| 合計 |              |  |  | 669,607,594,350 |  |

(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(2024年2月19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       | 2024年 2月19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       | 7,411,412,820 | —     | 7,807,175,000 | 395,616,155 |
| 合計       | 7,411,412,820 | —     | 7,807,175,000 | 395,616,155 |

(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NOMURA－BPI総合 マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

| (2024年 2月19日現在)  |                   |
|------------------|-------------------|
| 資産の部             |                   |
| 流動資産             |                   |
| コール・ローン          | 26,859,930,142    |
| 国債証券             | 905,082,282,900   |
| 地方債証券            | 60,277,841,580    |
| 特殊債証券            | 74,823,188,538    |
| 社債証券             | 50,000,033,700    |
| 未収入金             | 15,696,212,000    |
| 未収利息             | 2,195,192,828     |
| 前払費用             | 199,652,731       |
| 流動資産合計           | 1,135,134,334,419 |
| 資産合計             | 1,135,134,334,419 |
| 負債の部             |                   |
| 流動負債             |                   |
| 未払金              | 36,872,810,620    |
| 未払解約金            | 553,416,077       |
| 未払利息             | 2,833             |
| 流動負債合計           | 37,426,229,530    |
| 負債合計             | 37,426,229,530    |
| 純資産の部            |                   |
| 元本等              |                   |
| 元本               | 871,999,839,663   |
| 剰余金              |                   |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | 225,708,265,226   |
| 元本等合計            | 1,097,708,104,889 |
| 純資産合計            | 1,097,708,104,889 |
| 負債純資産合計          | 1,135,134,334,419 |

## 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     | 国債証券、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）

| 2024年 2月19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                  | 1.2588円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (12,588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 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日                                                                                                                                      |  |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 1.金融商品に対する取組方針<br>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<br>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<br>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<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。                                                                                                |  |
| ○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。                                                                               |  |
| ○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

| 2024年 2月19日現在                                                                  |  |
|--------------------------------------------------------------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額                                                             |  |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。                         |  |
| 2. 時価の算定方法                                                                     |  |
| 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券<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。                          |  |
| 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。 |  |

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2024年 2月19日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2023年 2月21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 | 690,657,163,977円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 270,433,302,425円 |
| 同期中における一部解約元本額                   | 89,090,626,739円  |
| 期末元本額                            | 871,999,839,663円 |
| 期末元本額の内訳＊                        |                  |
| 野村国内債券インデックスファンド                 | 328,308,858円     |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース）               | 44,290,977,290円  |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース）               | 20,659,514,150円  |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース）               | 6,823,791,168円   |
| 野村資産設計ファンド2015                   | 334,484,540円     |
| 野村資産設計ファンド2020                   | 368,375,733円     |
| 野村資産設計ファンド2025                   | 427,051,283円     |
| 野村資産設計ファンド2030                   | 393,775,666円     |
| 野村資産設計ファンド2035                   | 244,229,820円     |
| 野村資産設計ファンド2040                   | 290,947,481円     |
| 野村日本債券インデックスファンド                 | 590,645,413円     |
| 野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）         | 137,732,871,445円 |
| のむらっぴ・ファンド（保守型）                  | 22,888,034,243円  |

|                                                |                  |
|------------------------------------------------|------------------|
| のむラップ・ファンド（普通型）                                | 64,507,192,695円  |
| のむラップ・ファンド（積極型）                                | 7,149,243,005円   |
| 野村日本債券インデックス（野村SMA向け）                          | 9,476,693,430円   |
| 野村資産設計ファンド2045                                 | 45,326,629円      |
| 野村円債投資インデックスファンド                               | 512,230,143円     |
| 野村インデックスファンド・国内債券                              | 2,505,480,747円   |
| マイ・ロード                                         | 40,420,523,229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                  | 1,548,384,238円   |
| 野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）                       | 20,571,055,371円  |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース）                           | 1,743,853,852円   |
| 野村資産設計ファンド2050                                 | 34,414,953円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型               | 34,872,697円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型               | 14,576,031円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型               | 6,682,190円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型               | 4,871,752円       |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                              | 2,784,037,811円   |
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                              | 1,575,039,847円   |
| インデックス・ブレンド（タイプI）                              | 35,210,569円      |
| インデックス・ブレンド（タイプII）                             | 20,245,492円      |
| インデックス・ブレンド（タイプIII）                            | 104,889,142円     |
| インデックス・ブレンド（タイプIV）                             | 23,945,519円      |
| インデックス・ブレンド（タイプV）                              | 12,908,497円      |
| 野村6資産均等バランス                                    | 9,597,588,543円   |
| 世界6資産分散ファンド                                    | 196,960,742円     |
| 野村資産設計ファンド2060                                 | 18,496,373円      |
| NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信            | 162,343,992,699円 |
| ファンドラップ（ウェルス・スクエア）債券・安定型                       | 20,953,885,824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）               | 464,555,032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）               | 94,135,048円      |
| グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）               | 1,295,972,640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）               | 366,737,892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）               | 12,859,527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）             | 9,113,106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）               | 180,178円         |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）                   | 3,179,619,504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）              | 906,801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）              | 15,801,096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）                 | 33,765,633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）             | 395,308,993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）             | 266,541,876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）             | 1,078,473,250円   |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）                        | 106,095,724円     |
| ノムラ日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）                 | 1,508,396,413円   |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）             | 438,924,174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） | 14,777,219円      |
| マイバランス30（確定拠出年金向け）                             | 43,887,281,576円  |
| マイバランス50（確定拠出年金向け）                             | 65,531,157,032円  |
| マイバランス70（確定拠出年金向け）                             | 29,405,992,620円  |
| 野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合（確定拠出年金向け）        | 51,340,787,905円  |
| マイバランスDC30                                     | 19,335,171,729円  |
| マイバランスDC50                                     | 17,675,611,412円  |
| マイバランスDC70                                     | 7,334,894,073円   |
| 野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合                | 13,290,000,733円  |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け）                          | 3,219,480,370円   |
| マイターゲット2030（確定拠出年金向け）                          | 9,867,610,968円   |
| マイターゲット2040（確定拠出年金向け）                          | 4,270,946,830円   |
| 野村世界6資産分散投信（DC）安定コース                           | 421,167,868円     |
| 野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース                         | 69,805,116円      |
| 野村世界6資産分散投信（DC）成長コース                           | 93,402,865円      |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030                    | 253,505,942円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040                    | 110,403,003円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050                    | 37,898,697円      |
| マイターゲット2035（確定拠出年金向け）                          | 3,793,950,620円   |
| マイターゲット2045（確定拠出年金向け）                          | 1,718,349,549円   |
| マイターゲット2055（確定拠出年金向け）                          | 803,037,694円     |
| マイターゲット2060（確定拠出年金向け）                          | 949,273,848円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060                    | 19,579,825円      |
| マイターゲット2065（確定拠出年金向け）                          | 370,063,802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）                  | 696,658,381円     |
| みらいバランス・株式10（富士通企業年金基金DC向け）                    | 6,361,817,330円   |
| 野村DCバランスファンド（年金運用戦略タイプ）                        | 244,048,530円     |



マイターゲット2070（確定拠出年金向け）

168,129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(2024年2月19日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2024年2月19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446回 | 5,000,000,000  | 5,000,000,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（2年）第452回 | 26,000,000,000 | 25,968,020,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（2年）第453回 | 13,000,000,000 | 12,980,110,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（2年）第455回 | 12,000,000,000 | 11,974,440,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（2年）第456回 | 6,000,000,000  | 5,996,040,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第143回 | 10,000,000,000 | 10,010,200,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第145回 | 3,900,000,000  | 3,901,209,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第146回 | 5,100,000,000  | 5,098,572,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第147回 | 5,600,000,000  | 5,586,056,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第148回 | 6,500,000,000  | 6,481,085,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第149回 | 4,100,000,000  | 4,086,798,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第150回 | 6,300,000,000  | 6,276,879,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第151回 | 4,500,000,000  | 4,479,975,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第152回 | 4,000,000,000  | 3,993,840,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第153回 | 9,000,000,000  | 8,949,330,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第154回 | 12,000,000,000 | 11,957,280,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第155回 | 3,500,000,000  | 3,509,940,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第156回 | 5,000,000,000  | 4,995,250,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第157回 | 12,000,000,000 | 11,975,760,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第158回 | 5,000,000,000  | 4,969,700,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第159回 | 7,000,000,000  | 6,947,570,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第160回 | 3,500,000,000  | 3,488,765,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第161回 | 2,000,000,000  | 2,001,700,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第162回 | 13,000,000,000 | 12,991,160,000 |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第163回 | 8,500,000,000  | 8,532,555,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（5年）第164回 | 5,000,000,000  | 4,965,550,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第1回  | 1,860,000,000  | 2,150,383,200  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第2回  | 2,700,000,000  | 3,006,045,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第3回  | 900,000,000    | 999,351,000    |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第4回  | 1,630,000,000  | 1,806,219,300  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第5回  | 1,300,000,000  | 1,381,991,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第6回  | 2,000,000,000  | 2,077,820,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第7回  | 2,000,000,000  | 1,978,340,000  |    |
|      |     | 国庫債券 利付（40年）第8回  | 1,500,000,000  | 1,373,580,000  |    |

|                   |                |                |  |
|-------------------|----------------|----------------|--|
| 国庫債券 利付（４０年）第９回   | 4,850,000,000  | 3,241,788,500  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１０回  | 2,810,000,000  | 2,203,433,400  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１１回  | 1,750,000,000  | 1,316,420,000  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１２回  | 2,370,000,000  | 1,580,126,400  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１３回  | 4,070,000,000  | 2,678,344,900  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１４回  | 2,960,000,000  | 2,078,808,000  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１５回  | 4,000,000,000  | 3,098,520,000  |  |
| 国庫債券 利付（４０年）第１６回  | 5,500,000,000  | 4,670,875,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３３８回 | 10,000,000,000 | 10,042,500,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４０回 | 4,200,000,000  | 4,221,210,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４１回 | 2,600,000,000  | 2,608,762,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４２回 | 4,550,000,000  | 4,547,634,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４３回 | 6,000,000,000  | 5,995,800,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４４回 | 6,400,000,000  | 6,395,008,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４５回 | 5,500,000,000  | 5,494,555,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４６回 | 7,000,000,000  | 6,989,220,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４７回 | 10,000,000,000 | 9,975,100,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４８回 | 13,000,000,000 | 12,953,720,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３４９回 | 5,500,000,000  | 5,473,875,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５０回 | 10,150,000,000 | 10,088,491,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５１回 | 9,500,000,000  | 9,428,845,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５２回 | 9,000,000,000  | 8,912,610,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５３回 | 5,000,000,000  | 4,944,100,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５４回 | 3,000,000,000  | 2,963,310,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５５回 | 1,000,000,000  | 986,920,000    |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５７回 | 4,500,000,000  | 4,431,915,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５８回 | 5,570,000,000  | 5,477,315,200  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３５９回 | 7,500,000,000  | 7,361,100,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６０回 | 13,000,000,000 | 12,733,500,000 |  |
|                   | 8,000,000,000  | 7,819,600,000  |  |

|                   |                |                |  |
|-------------------|----------------|----------------|--|
| 国庫債券 利付（１０年）第３６１回 |                |                |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６２回 | 8,500,000,000  | 8,290,220,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６３回 | 12,050,000,000 | 11,717,420,000 |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６４回 | 9,050,000,000  | 8,772,708,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６５回 | 9,500,000,000  | 9,182,510,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６６回 | 10,000,000,000 | 9,718,000,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６７回 | 10,000,000,000 | 9,690,300,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６８回 | 10,000,000,000 | 9,661,700,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３６９回 | 9,500,000,000  | 9,396,640,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３７０回 | 8,500,000,000  | 8,390,690,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３７１回 | 8,500,000,000  | 8,294,810,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３７２回 | 8,500,000,000  | 8,583,980,000  |  |
| 国庫債券 利付（１０年）第３７３回 | 7,000,000,000  | 6,919,640,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１回   | 2,000,000,000  | 2,270,080,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２回   | 500,000,000    | 560,070,000    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３回   | 160,000,000    | 178,844,800    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４回   | 1,400,000,000  | 1,629,964,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５回   | 150,000,000    | 168,414,000    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第６回   | 900,000,000    | 1,027,926,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第７回   | 600,000,000    | 683,340,000    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第８回   | 100,000,000    | 110,025,000    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第９回   | 265,000,000    | 282,540,350    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１０回  | 250,000,000    | 259,975,000    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１１回  | 660,000,000    | 721,584,600    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１２回  | 720,000,000    | 813,787,200    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１３回  | 1,090,000,000  | 1,222,009,900  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１４回  | 800,000,000    | 928,448,000    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１５回  | 1,000,000,000  | 1,172,250,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１６回  | 1,415,000,000  | 1,660,997,750  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１７回  | 1,500,000,000  | 1,747,020,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１８回  | 2,200,000,000  | 2,542,232,000  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第１９回  | 1,550,000,000  | 1,792,435,500  |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２０回  | 770,000,000    | 908,253,500    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２１回  | 300,000,000    | 347,319,000    |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２２回  | 600,000,000    | 708,816,000    |  |

|                  |               |               |  |
|------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付（３０年）第２３回 | 840,000,000   | 993,006,000   |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２４回 | 700,000,000   | 827,505,000   |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２５回 | 500,000,000   | 579,180,000   |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２６回 | 850,000,000   | 995,095,000   |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２７回 | 1,150,000,000 | 1,361,140,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２８回 | 1,000,000,000 | 1,184,360,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第２９回 | 2,000,000,000 | 2,339,920,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３０回 | 2,500,000,000 | 2,887,950,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３１回 | 1,700,000,000 | 1,938,408,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３２回 | 4,000,000,000 | 4,608,480,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３３回 | 2,400,000,000 | 2,652,672,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３４回 | 4,500,000,000 | 5,098,005,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３５回 | 2,300,000,000 | 2,528,574,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３６回 | 3,500,000,000 | 3,841,705,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３７回 | 2,300,000,000 | 2,484,207,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３８回 | 1,600,000,000 | 1,696,352,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第３９回 | 1,400,000,000 | 1,505,336,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４０回 | 1,300,000,000 | 1,373,580,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４１回 | 1,500,000,000 | 1,555,350,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４２回 | 3,000,000,000 | 3,106,950,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４３回 | 1,000,000,000 | 1,034,370,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４４回 | 1,400,000,000 | 1,446,298,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４５回 | 1,700,000,000 | 1,693,268,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４６回 | 1,800,000,000 | 1,789,956,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４７回 | 1,700,000,000 | 1,719,125,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４８回 | 1,900,000,000 | 1,849,422,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第４９回 | 2,900,000,000 | 2,817,553,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５０回 | 2,400,000,000 | 2,059,872,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５１回 | 4,150,000,000 | 3,161,013,500 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５２回 | 2,200,000,000 | 1,752,058,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５３回 | 1,700,000,000 | 1,381,080,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５４回 | 1,700,000,000 | 1,441,617,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５５回 | 1,500,000,000 | 1,268,130,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５６回 | 1,700,000,000 | 1,432,794,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５７回 | 2,000,000,000 | 1,680,460,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５８回 | 3,000,000,000 | 2,512,950,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第５９回 | 3,000,000,000 | 2,445,780,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第６０回 | 1,650,000,000 | 1,406,526,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第６１回 | 2,000,000,000 | 1,618,300,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第６２回 | 3,000,000,000 | 2,294,430,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第６３回 | 4,000,000,000 | 2,963,880,000 |  |
| 国庫債券 利付（３０年）第６４回 | 4,500,000,000 | 3,318,030,000 |  |
|                  |               |               |  |

|                   |               |               |
|-------------------|---------------|---------------|
| 国庫債券 利付（３０年）第６５回  | 3,800,000,000 | 2,790,606,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第６６回  | 5,500,000,000 | 4,019,345,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第６７回  | 3,500,000,000 | 2,694,370,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第６８回  | 3,450,000,000 | 2,646,184,500 |
| 国庫債券 利付（３０年）第６９回  | 2,700,000,000 | 2,122,308,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７０回  | 2,610,000,000 | 2,044,543,500 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７１回  | 2,700,000,000 | 2,107,674,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７２回  | 2,200,000,000 | 1,711,380,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７３回  | 3,000,000,000 | 2,327,670,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７４回  | 2,000,000,000 | 1,681,200,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７５回  | 3,000,000,000 | 2,718,570,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７６回  | 2,500,000,000 | 2,317,825,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７７回  | 3,000,000,000 | 2,913,750,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７８回  | 2,300,000,000 | 2,126,419,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第７９回  | 1,500,000,000 | 1,317,120,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第８０回  | 3,500,000,000 | 3,547,915,000 |
| 国庫債券 利付（３０年）第８１回  | 2,500,000,000 | 2,414,650,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第７５回  | 600,000,000   | 613,530,000   |
| 国庫債券 利付（２０年）第７６回  | 910,000,000   | 928,564,000   |
| 国庫債券 利付（２０年）第７８回  | 800,000,000   | 819,704,000   |
| 国庫債券 利付（２０年）第７９回  | 860,000,000   | 882,325,600   |
| 国庫債券 利付（２０年）第８１回  | 360,000,000   | 370,911,600   |
| 国庫債券 利付（２０年）第８２回  | 820,000,000   | 846,149,800   |
| 国庫債券 利付（２０年）第８３回  | 1,370,000,000 | 1,419,662,500 |
| 国庫債券 利付（２０年）第８４回  | 1,200,000,000 | 1,241,304,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第８５回  | 400,000,000   | 416,360,000   |
| 国庫債券 利付（２０年）第８６回  | 1,700,000,000 | 1,776,585,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第８７回  | 500,000,000   | 521,490,000   |
| 国庫債券 利付（２０年）第８８回  | 1,100,000,000 | 1,155,418,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第８９回  | 470,000,000   | 492,583,500   |
| 国庫債券 利付（２０年）第９０回  | 1,500,000,000 | 1,579,860,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第９１回  | 250,000,000   | 263,952,500   |
| 国庫債券 利付（２０年）第９２回  | 650,000,000   | 686,010,000   |
| 国庫債券 利付（２０年）第９３回  | 2,300,000,000 | 2,430,663,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第９４回  | 3,700,000,000 | 3,921,556,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第９５回  | 1,500,000,000 | 1,605,750,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第９６回  | 1,500,000,000 | 1,595,820,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第９７回  | 1,500,000,000 | 1,606,935,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第９８回  | 1,300,000,000 | 1,388,062,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第９９回  | 1,100,000,000 | 1,178,540,000 |
| 国庫債券 利付（２０年）第１００回 | 820,000,000   | 884,878,400   |
|                   | 750,000,000   | 815,400,000   |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付（２０年）第１０１回 |               |               |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０２回 | 1,500,000,000 | 1,637,055,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０３回 | 600,000,000   | 652,254,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０４回 | 400,000,000   | 431,412,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０５回 | 1,900,000,000 | 2,054,071,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０６回 | 400,000,000   | 434,244,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０７回 | 800,000,000   | 867,320,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０８回 | 1,000,000,000 | 1,074,640,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１０９回 | 900,000,000   | 970,551,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１０回 | 2,600,000,000 | 2,829,762,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１１回 | 500,000,000   | 548,815,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１２回 | 500,000,000   | 546,200,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１３回 | 500,000,000   | 548,195,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１５回 | 1,000,000,000 | 1,106,010,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１６回 | 1,100,000,000 | 1,220,351,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１７回 | 1,400,000,000 | 1,544,858,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１８回 | 1,100,000,000 | 1,210,121,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１１９回 | 800,000,000   | 870,200,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２０回 | 800,000,000   | 860,048,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２１回 | 1,900,000,000 | 2,082,742,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２２回 | 900,000,000   | 980,784,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２３回 | 2,000,000,000 | 2,223,820,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２４回 | 1,400,000,000 | 1,547,378,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２５回 | 1,800,000,000 | 2,018,790,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２６回 | 1,200,000,000 | 1,328,928,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２７回 | 1,200,000,000 | 1,320,684,000 |  |
|                   | 2,800,000,000 | 3,084,760,000 |  |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付（２０年）第１２８回 |               |               |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１２９回 | 1,300,000,000 | 1,422,993,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３０回 | 2,200,000,000 | 2,410,650,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３１回 | 800,000,000   | 870,752,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３２回 | 1,300,000,000 | 1,415,947,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３３回 | 1,900,000,000 | 2,083,749,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３４回 | 1,900,000,000 | 2,086,067,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３５回 | 700,000,000   | 763,133,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３６回 | 700,000,000   | 757,421,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３７回 | 1,000,000,000 | 1,090,710,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３８回 | 800,000,000   | 859,496,000   |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１３９回 | 1,000,000,000 | 1,082,750,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４０回 | 3,000,000,000 | 3,274,620,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４１回 | 2,600,000,000 | 2,838,628,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４２回 | 950,000,000   | 1,045,598,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４３回 | 2,300,000,000 | 2,492,602,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４４回 | 1,300,000,000 | 1,397,695,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４５回 | 3,300,000,000 | 3,607,923,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４６回 | 4,500,000,000 | 4,919,490,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４７回 | 5,500,000,000 | 5,957,985,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４８回 | 4,800,000,000 | 5,151,744,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１４９回 | 4,350,000,000 | 4,667,202,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５０回 | 4,030,000,000 | 4,280,464,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５１回 | 5,000,000,000 | 5,201,900,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５２回 | 3,150,000,000 | 3,273,196,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５３回 | 4,000,000,000 | 4,194,640,000 |  |
|                   | 1,820,000,000 | 1,886,157,000 |  |

|                   |               |               |  |
|-------------------|---------------|---------------|--|
| 国庫債券 利付（２０年）第１５４回 |               |               |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５５回 | 3,850,000,000 | 3,897,393,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５６回 | 5,150,000,000 | 4,848,364,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５７回 | 4,000,000,000 | 3,658,800,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５８回 | 1,970,000,000 | 1,863,048,700 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１５９回 | 2,010,000,000 | 1,917,479,700 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６０回 | 2,000,000,000 | 1,926,140,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６１回 | 2,500,000,000 | 2,368,450,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６２回 | 3,500,000,000 | 3,302,950,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６３回 | 3,500,000,000 | 3,289,930,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６４回 | 4,000,000,000 | 3,693,920,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６５回 | 3,500,000,000 | 3,218,145,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６６回 | 4,000,000,000 | 3,768,160,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６７回 | 6,000,000,000 | 5,467,740,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６８回 | 2,200,000,000 | 1,965,260,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１６９回 | 4,430,000,000 | 3,876,117,100 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７０回 | 4,300,000,000 | 3,745,257,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７１回 | 5,500,000,000 | 4,765,420,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７２回 | 4,840,000,000 | 4,241,001,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７３回 | 6,000,000,000 | 5,230,320,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７４回 | 6,970,000,000 | 6,044,244,600 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７５回 | 7,500,000,000 | 6,585,075,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７６回 | 8,020,000,000 | 7,005,871,000 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７７回 | 6,570,000,000 | 5,610,714,300 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７８回 | 6,450,000,000 | 5,583,700,500 |  |
| 国庫債券 利付（２０年）第１７９回 | 8,000,000,000 | 6,893,920,000 |  |
|                   | 5,500,000,000 | 4,984,375,000 |  |



|       |     |                         |                 |                 |  |
|-------|-----|-------------------------|-----------------|-----------------|--|
|       | 小計  | 国庫債券 利付（２０年）第１８０回       |                 |                 |  |
|       |     | 国庫債券 利付（２０年）第１８１回       | 4,500,000,000   | 4,138,605,000   |  |
|       |     | 国庫債券 利付（２０年）第１８２回       | 4,000,000,000   | 3,797,840,000   |  |
|       |     | 国庫債券 利付（２０年）第１８３回       | 4,500,000,000   | 4,483,260,000   |  |
|       |     | 国庫債券 利付（２０年）第１８４回       | 3,000,000,000   | 2,832,510,000   |  |
|       |     | 国庫債券 利付（２０年）第１８５回       | 2,000,000,000   | 1,881,520,000   |  |
|       |     | 国庫債券 利付（２０年）第１８６回       | 4,000,000,000   | 4,021,280,000   |  |
|       |     | 大韓民国円貨債券（２０２３）第２回       | 100,000,000     | 100,658,000     |  |
|       |     | 大韓民国円貨債券（２０２３）第３回       | 100,000,000     | 101,006,000     |  |
|       |     | ポーランド共和国 第１６回円貨債券（２０２３） | 100,000,000     | 100,074,000     |  |
|       |     | ポーランド共和国 第１７回円貨債券（２０２３） | 100,000,000     | 100,443,000     |  |
|       |     | ハンガリー円貨債券（２０２０）第８回      | 100,000,000     | 99,468,000      |  |
|       |     | ハンガリー円貨債券（２０２０）第１回      | 100,000,000     | 98,212,000      |  |
|       |     | 銘柄数：272                 | 928,420,000,000 | 905,082,282,900 |  |
|       |     | 組入時価比率：82.5%            |                 | 83.0%           |  |
|       | 合計  |                         |                 | 905,082,282,900 |  |
| 地方債証券 | 日本円 | 東京都 公募第７４５回             | 300,000,000     | 301,545,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第７４７回             | 100,000,000     | 100,457,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第７５１回             | 100,000,000     | 100,273,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第７６０回             | 100,000,000     | 99,487,000      |  |
|       |     | 東京都 公募第７６１回             | 100,000,000     | 99,564,000      |  |
|       |     | 東京都 公募第７６９回             | 500,000,000     | 498,745,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第７７８回             | 100,000,000     | 99,216,000      |  |
|       |     | 東京都 公募第７８４回             | 200,000,000     | 198,506,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第７９４回             | 100,000,000     | 97,871,000      |  |
|       |     | 東京都 公募第８００回             | 100,000,000     | 97,757,000      |  |
|       |     | 東京都 公募第８１３回             | 200,000,000     | 195,048,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第８２２回             | 130,000,000     | 124,922,200     |  |
|       |     | 東京都 公募第８３０回             | 400,000,000     | 386,472,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第８４３回             | 400,000,000     | 400,692,000     |  |
|       |     | 東京都 公募（３０年）第７回          | 100,000,000     | 116,613,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第１０回              | 200,000,000     | 226,880,000     |  |
|       |     | 東京都 公募（３０年）第５回          | 200,000,000     | 152,638,000     |  |
|       |     | 東京都 公募第７回               | 100,000,000     | 103,121,000     |  |
|       |     | 東京都 公募（２０年）第１１回         | 100,000,000     | 105,979,000     |  |

|      |              |             |             |  |
|------|--------------|-------------|-------------|--|
| 東京都  | 公募（２０年）第１３回  | 100,000,000 | 106,848,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第１５回  | 100,000,000 | 108,593,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第１６回  | 200,000,000 | 214,910,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第１７回  | 200,000,000 | 215,668,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第２０回  | 280,000,000 | 304,925,600 |  |
| 東京都  | 公募第２３回       | 100,000,000 | 110,448,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第２６回  | 100,000,000 | 108,352,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第２８回  | 100,000,000 | 107,182,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第２９回  | 200,000,000 | 213,898,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第３０回  | 100,000,000 | 105,997,000 |  |
| 東京都  | 公募（２０年）第３２回  | 100,000,000 | 103,350,000 |  |
| 東京都  | 公募（５年）第３２回   | 300,000,000 | 299,481,000 |  |
| 北海道  | 公募平成２７年度第７回  | 100,000,000 | 100,521,000 |  |
| 北海道  | 公募平成２９年度第５回  | 200,000,000 | 199,194,000 |  |
| 北海道  | 公募平成２９年度第７回  | 100,000,000 | 99,615,000  |  |
| 北海道  | 公募平成２９年度第９回  | 100,000,000 | 99,526,000  |  |
| 北海道  | 公募平成３０年度第１５回 | 230,880,000 | 221,827,195 |  |
| 北海道  | 公募平成３０年度第１８回 | 200,000,000 | 196,904,000 |  |
| 北海道  | 公募令和２年度第４回   | 300,000,000 | 293,367,000 |  |
| 北海道  | 公募令和４年度第５回   | 100,000,000 | 96,547,000  |  |
| 北海道  | 公募令和５年度第２回   | 100,000,000 | 99,369,000  |  |
| 北海道  | 公募令和５年度第８回   | 100,000,000 | 100,628,000 |  |
| 北海道  | 公募令和５年度第１０回  | 300,000,000 | 300,435,000 |  |
| 宮城県  | 公募第３１回１号     | 300,000,000 | 301,587,000 |  |
| 宮城県  | 公募第３２回２号     | 100,000,000 | 99,637,000  |  |
| 神奈川県 | 公募第２１２回      | 100,000,000 | 100,327,000 |  |
| 神奈川県 | 公募第２３１回      | 200,000,000 | 199,090,000 |  |
| 神奈川県 | 公募第２４３回      | 200,000,000 | 195,458,000 |  |
| 神奈川県 | 公募第２４７回      | 339,150,000 | 330,932,395 |  |
| 神奈川県 | 公募第２５４回      | 180,000,000 | 173,295,000 |  |
| 神奈川県 | 公募第２５８回      | 100,000,000 | 96,736,000  |  |
| 神奈川県 | 公募（３０年）第３回   | 100,000,000 | 117,835,000 |  |
| 神奈川県 | 公募第７回        | 300,000,000 | 317,937,000 |  |
| 神奈川県 | 公募（２０年）第１３回  | 100,000,000 | 109,941,000 |  |
| 神奈川県 | 公募（２０年）第１４回  | 100,000,000 | 109,102,000 |  |
| 神奈川県 | 公募（２０年）第１７回  | 200,000,000 | 219,690,000 |  |
| 神奈川県 | 公募（２０年）第２０回  | 100,000,000 | 108,084,000 |  |
| 神奈川県 | 公募（２０年）第２１回  | 200,000,000 | 216,784,000 |  |
| 神奈川県 | 公募（２０年）第２６回  | 100,000,000 | 105,703,000 |  |
| 神奈川県 | 公募（２０年）第２７回  | 100,000,000 | 104,812,000 |  |
| 神奈川県 | 公募（２０年）第４６回  | 100,000,000 | 83,944,000  |  |
| 大阪府  | 公募第３９６回      | 200,000,000 | 201,022,000 |  |
|      |              |             |             |  |

|                      |             |             |
|----------------------|-------------|-------------|
| 大阪府 公募第4 1 7回        | 102,000,000 | 101,929,620 |
| 大阪府 公募第4 2 3回        | 100,000,000 | 99,545,000  |
| 大阪府 公募第4 2 9回        | 179,000,000 | 177,798,910 |
| 大阪府 公募第4 5 1回        | 130,000,000 | 126,877,400 |
| 大阪府 公募第4 5 2回        | 100,000,000 | 97,498,000  |
| 大阪府 公募第4 5 8回        | 140,000,000 | 136,225,600 |
| 大阪府 公募第4 6 7回        | 140,000,000 | 135,794,400 |
| 大阪府 公募第4 6 9回        | 150,000,000 | 144,811,500 |
| 大阪府 公募第4 7 9回        | 200,000,000 | 193,438,000 |
| 大阪府 公募第4 8 1回        | 100,000,000 | 97,287,000  |
| 大阪府 公募第4 8 9回        | 176,000,000 | 173,898,560 |
| 大阪府 公募第4 9 2回        | 156,000,000 | 157,945,320 |
| 大阪府 公募（20年）第1回       | 100,000,000 | 109,361,000 |
| 大阪府 公募（20年）第2回       | 100,000,000 | 109,848,000 |
| 大阪府 公募第5回            | 100,000,000 | 110,090,000 |
| 大阪府 公募第8回            | 100,000,000 | 108,841,000 |
| 大阪府 公募（20年）第1 2回     | 200,000,000 | 210,498,000 |
| 大阪府 公募（5年）第1 7 3回    | 200,000,000 | 199,498,000 |
| 大阪府 公募（5年）第1 7 4回    | 200,000,000 | 199,440,000 |
| 大阪府 公募（5年）第1 7 8回    | 400,000,000 | 398,312,000 |
| 大阪府 公募（5年）第1 8 4回    | 400,000,000 | 397,620,000 |
| 大阪府 公募（5年）第1 8 7回    | 144,000,000 | 143,051,040 |
| 大阪府 公募（5年）第1 9 0回    | 200,000,000 | 198,534,000 |
| 京都府 公募（20年）平成20年度第2回 | 200,000,000 | 216,558,000 |
| 京都府 公募平成26年度第5回      | 100,000,000 | 105,361,000 |
| 京都府 公募（20年）平成27年度第5回 | 200,000,000 | 204,846,000 |
| 京都府 公募（15年）平成27年度第8回 | 100,000,000 | 101,538,000 |
| 京都府 公募（15年）平成28年度第2回 | 200,000,000 | 194,704,000 |
| 京都府 公募（20年）平成28年度第5回 | 200,000,000 | 182,426,000 |
| 京都府 公募平成29年度第4回      | 100,000,000 | 99,633,000  |
| 京都府 公募令和3年度第5回       | 100,000,000 | 83,670,000  |
| 兵庫県 公募平成29年度第2 2回    | 100,000,000 | 99,349,000  |
| 兵庫県 公募（30年）第2回       | 200,000,000 | 227,584,000 |
| 兵庫県 公募（15年）第1回       | 300,000,000 | 310,212,000 |
| 兵庫県 公募（15年）第3回       | 200,000,000 | 207,034,000 |
| 兵庫県 公募（12年）第3回       | 300,000,000 | 301,467,000 |
| 兵庫県 公募（15年）第8回       | 500,000,000 | 515,730,000 |
| 兵庫県 公募（15年）第1 1回     | 100,000,000 | 101,222,000 |
| 兵庫県 公募第2回            | 100,000,000 | 107,227,000 |
| 兵庫県 公募第9回            | 100,000,000 | 109,973,000 |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 兵庫県 公募（２０年）第１１回       | 200,000,000 | 216,542,000 |  |
| 兵庫県 公募（２０年）第１４回       | 100,000,000 | 108,089,000 |  |
| 兵庫県 公募（２０年）第１９回       | 100,000,000 | 106,756,000 |  |
| 兵庫県 公募（２０年）第２１回       | 100,000,000 | 106,236,000 |  |
| 兵庫県 公募（２０年）第２２回       | 100,000,000 | 104,767,000 |  |
| 静岡県 公募平成２７年度第１１回      | 115,400,000 | 115,089,574 |  |
| 静岡県 公募平成２８年度第２回       | 300,000,000 | 299,007,000 |  |
| 静岡県 公募平成２９年度第３回       | 100,000,000 | 99,706,000  |  |
| 静岡県 公募（３１年）第１回        | 174,000,000 | 170,890,620 |  |
| 静岡県 公募（５年）令和３年度第２回    | 100,000,000 | 99,524,000  |  |
| 静岡県 公募（５年）令和３年度第５回    | 300,000,000 | 298,332,000 |  |
| 静岡県 公募（１５年）第２回        | 300,000,000 | 311,082,000 |  |
| 静岡県 公募（１５年）第５回        | 200,000,000 | 206,068,000 |  |
| 静岡県 公募（１５年）第９回        | 100,000,000 | 101,361,000 |  |
| 静岡県 公募（３０年）第１５回       | 100,000,000 | 76,096,000  |  |
| 静岡県 公募（２０年）第１１回       | 100,000,000 | 108,468,000 |  |
| 静岡県 公募（２０年）第１４回       | 200,000,000 | 216,642,000 |  |
| 静岡県 公募（２０年）第１８回       | 200,000,000 | 211,286,000 |  |
| 静岡県 公募（２０年）第３０回       | 200,000,000 | 172,084,000 |  |
| 愛知県 公募（２０年）平成１９年度第２回  | 100,000,000 | 106,998,000 |  |
| 愛知県 公募平成２０年度第８回       | 100,000,000 | 107,623,000 |  |
| 愛知県 公募（２０年）平成２２年度第８回  | 200,000,000 | 217,468,000 |  |
| 愛知県 公募（１５年）平成２３年度第１３回 | 100,000,000 | 103,470,000 |  |
| 愛知県 公募（２０年）平成２４年度第４回  | 100,000,000 | 107,917,000 |  |
| 愛知県 公募（１５年）平成２４年度第１４回 | 400,000,000 | 414,668,000 |  |
| 愛知県 公募平成２４年度第１７回      | 100,000,000 | 109,252,000 |  |
| 愛知県 公募（３０年）平成２５年度第８回  | 120,000,000 | 128,938,800 |  |
| 愛知県 公募（２０年）平成２５年度第１７回 | 400,000,000 | 428,872,000 |  |
| 愛知県 公募（２０年）平成２６年度第４回  | 100,000,000 | 106,364,000 |  |
| 愛知県 公募平成２６年度第８回       | 100,000,000 | 103,441,000 |  |
| 愛知県 公募平成２６年度第１３回      | 200,000,000 | 208,756,000 |  |
| 愛知県 公募（１５年）平成２７年度第２回  | 300,000,000 | 304,314,000 |  |
| 愛知県 公募（３０年）平成２７年度第８回  | 100,000,000 | 98,646,000  |  |
| 愛知県 公募平成２７年度第１５回      | 100,000,000 | 100,460,000 |  |
| 愛知県 公募平成２９年度第８回       | 100,000,000 | 99,615,000  |  |
|                       |             |             |  |

|     |                       |             |             |  |
|-----|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 愛知県 | 公募平成29年度第9回           | 100,000,000 | 99,434,000  |  |
| 愛知県 | 公募平成30年度第7回           | 200,000,000 | 198,058,000 |  |
| 愛知県 | 公募令和3年度第10回           | 200,000,000 | 198,712,000 |  |
| 広島県 | 公募平成26年度第7回           | 200,000,000 | 200,742,000 |  |
| 広島県 | 公募平成29年度第3回           | 100,000,000 | 99,412,000  |  |
| 広島県 | 公募平成29年度第4回           | 211,300,000 | 210,435,783 |  |
| 広島県 | 公募令和2年度第2回            | 100,000,000 | 97,774,000  |  |
| 広島県 | 公募令和2年度第7回            | 300,000,000 | 292,635,000 |  |
| 広島県 | 公募令和5年度第4回            | 140,000,000 | 141,985,200 |  |
| 広島県 | 公募（20年）令和3年度第2回       | 100,000,000 | 84,056,000  |  |
| 埼玉県 | 公募平成27年度第9回           | 100,000,000 | 100,019,000 |  |
| 埼玉県 | 公募平成28年度第5回           | 100,000,000 | 99,527,000  |  |
| 埼玉県 | 公募平成30年度第4回           | 200,000,000 | 198,414,000 |  |
| 埼玉県 | 公募令和元年度第4回            | 100,000,000 | 97,897,000  |  |
| 埼玉県 | 公募令和2年度第4回            | 300,000,000 | 293,199,000 |  |
| 埼玉県 | 公募令和5年度第4回            | 100,000,000 | 99,616,000  |  |
| 埼玉県 | 公募（15年）第1回            | 200,000,000 | 205,234,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（15年）第2回            | 200,000,000 | 204,410,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（15年）第3回            | 100,000,000 | 98,226,000  |  |
| 埼玉県 | 公募（25年）第2回            | 200,000,000 | 176,412,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（30年）第9回            | 200,000,000 | 165,010,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（15年）第7回            | 200,000,000 | 186,012,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（15年）第8回            | 100,000,000 | 92,287,000  |  |
| 埼玉県 | 公募（20年）第6回            | 100,000,000 | 108,304,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（20年）第13回           | 100,000,000 | 107,248,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（20年）第16回           | 200,000,000 | 204,764,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（20年）第19回           | 200,000,000 | 186,496,000 |  |
| 埼玉県 | 公募（20年）第20回           | 100,000,000 | 93,707,000  |  |
| 埼玉県 | 公募（20年）第26回           | 100,000,000 | 85,383,000  |  |
| 福岡県 | 公募平成27年度第1回           | 300,000,000 | 301,725,000 |  |
| 福岡県 | 公募平成29年度第1回           | 100,000,000 | 99,698,000  |  |
| 福岡県 | 公募平成23年度第1回           | 100,000,000 | 103,413,000 |  |
| 福岡県 | 公募（15年）平成27年度第1回      | 200,000,000 | 203,184,000 |  |
| 福岡県 | 公募（15年）令和元年度第1回       | 300,000,000 | 281,307,000 |  |
| 福岡県 | 公募（15年）令和元年度第2回       | 200,000,000 | 186,460,000 |  |
| 福岡県 | 公募（30年）平成19年度第1回      | 100,000,000 | 118,026,000 |  |
| 福岡県 | 公募（30年）平成26年度第1回      | 100,000,000 | 103,641,000 |  |
| 福岡県 | 公募（30年・定時償還）平成29年度第2回 | 100,000,000 | 84,550,000  |  |
|     |                       |             |             |  |

|                              |               |               |  |
|------------------------------|---------------|---------------|--|
| 福岡県 公募（３０年・定時償還）<br>令和元年度第３回 | 100,000,000   | 72,593,000    |  |
| 福岡県 公募（２０年）平成２０年<br>度第１回     | 300,000,000   | 324,582,000   |  |
| 福岡県 公募（２０年）平成２０年<br>度第２回     | 100,000,000   | 107,670,000   |  |
| 福岡県 公募（２０年）平成２２年<br>度第１回     | 300,000,000   | 323,628,000   |  |
| 福岡県 公募（２０年）平成２２年<br>度第２回     | 300,000,000   | 331,800,000   |  |
| 福岡県 公募（２０年）平成２４年<br>度第２回     | 100,000,000   | 107,577,000   |  |
| 福岡県 公募（２０年）平成２６年<br>度第１回     | 100,000,000   | 106,331,000   |  |
| 福岡県 公募（２０年・定時償還）<br>令和３年度第１回 | 200,000,000   | 168,640,000   |  |
| 千葉県 公募平成２７年度第６回              | 200,000,000   | 200,914,000   |  |
| 千葉県 公募平成２８年度第４回              | 200,000,000   | 199,172,000   |  |
| 千葉県 公募平成２９年度第４回              | 100,000,000   | 99,413,000    |  |
| 千葉県 公募平成２９年度第８回              | 100,000,000   | 99,334,000    |  |
| 千葉県 公募令和元年度第６回               | 300,000,000   | 294,027,000   |  |
| 千葉県 公募令和４年度第４回               | 100,000,000   | 97,160,000    |  |
| 千葉県 公募令和５年度第９回               | 200,000,000   | 198,962,000   |  |
| 千葉県 公募（２０年）第１回               | 400,000,000   | 413,452,000   |  |
| 千葉県 公募（２０年）第８回               | 100,000,000   | 110,174,000   |  |
| 千葉県 公募（２０年）第１３回              | 200,000,000   | 216,244,000   |  |
| 千葉県 公募（２０年）第１６回              | 300,000,000   | 319,458,000   |  |
| 千葉県 公募（２０年）第１７回              | 100,000,000   | 104,836,000   |  |
| 千葉県 公募（２０年）第２０回              | 100,000,000   | 92,910,000    |  |
| 千葉県 公募（２０年）第２５回              | 100,000,000   | 92,570,000    |  |
| 新潟県 公募平成３０年度第２回              | 200,000,000   | 198,304,000   |  |
| 新潟県 公募令和２年度第２回               | 120,000,000   | 116,670,000   |  |
| 長野県 公募令和３年度第１回               | 300,000,000   | 291,861,000   |  |
| 茨城県 公募令和３年度第３回               | 200,000,000   | 198,800,000   |  |
| 茨城県 公募令和５年度第１回               | 100,000,000   | 99,093,000    |  |
| 茨城県 公募令和５年度第２回               | 200,000,000   | 199,516,000   |  |
| 群馬県 公募第１２回                   | 100,000,000   | 100,516,000   |  |
| 群馬県 公募第２２回                   | 100,000,000   | 97,539,000    |  |
| 群馬県 公募（５年）第１３回               | 300,000,000   | 298,215,000   |  |
| 群馬県 公募（２０年）第３回               | 100,000,000   | 107,952,000   |  |
| 大分県 公募令和５年度第１回               | 100,000,000   | 100,718,000   |  |
| 共同発行市場地方債 公募第１４５<br>回        | 1,000,000,000 | 1,003,240,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第１４８<br>回        | 100,000,000   | 100,559,000   |  |
| 共同発行市場地方債 公募第１５２<br>回        | 400,000,000   | 402,008,000   |  |
|                              |               |               |  |

|                      |             |             |  |
|----------------------|-------------|-------------|--|
| 共同発行市場地方債 公募第154回    | 400,000,000 | 401,416,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第156回    | 200,000,000 | 199,416,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第157回    | 300,000,000 | 298,959,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第161回    | 300,000,000 | 298,611,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第172回    | 600,000,000 | 598,560,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第184回    | 100,000,000 | 99,012,000  |  |
| 共同発行市場地方債 公募第186回    | 400,000,000 | 396,928,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第188回    | 300,000,000 | 297,675,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第190回    | 610,000,000 | 601,661,300 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第191回    | 100,000,000 | 98,474,000  |  |
| 共同発行市場地方債 公募第194回    | 300,000,000 | 294,618,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第196回    | 400,000,000 | 391,540,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第197回    | 300,000,000 | 293,475,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第198回    | 110,000,000 | 107,507,400 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第200回    | 100,000,000 | 97,738,000  |  |
| 共同発行市場地方債 公募第206回    | 300,000,000 | 293,190,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第213回    | 300,000,000 | 291,489,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第215回    | 400,000,000 | 388,528,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第228回    | 300,000,000 | 288,819,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第229回    | 250,000,000 | 242,437,500 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第234回    | 300,000,000 | 291,357,000 |  |
| 共同発行市場地方債 公募第239回    | 100,000,000 | 99,873,000  |  |
| 堺市 公募平成22年度第1回       | 100,000,000 | 109,310,000 |  |
| 堺市 公募平成26年度第1回       | 100,000,000 | 100,679,000 |  |
| 堺市 公募第3回             | 100,000,000 | 95,905,000  |  |
| 堺市 公募令和5年度第2回        | 200,000,000 | 200,462,000 |  |
| 長崎県 公募令和元年度第3回       | 100,000,000 | 97,871,000  |  |
| 長崎県 公募令和4年度第3回       | 100,000,000 | 97,356,000  |  |
| 島根県 公募（30年）平成29年度第1回 | 100,000,000 | 84,690,000  |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 島根県 公募（５年）令和２年度第３回    | 150,000,000 | 149,496,000 |  |
| 佐賀県 公募平成２８年度第１回       | 100,000,000 | 99,544,000  |  |
| 熊本県 公募平成２８年度第２回       | 132,000,000 | 131,346,600 |  |
| 熊本市 公募平成２９年度第１回       | 100,000,000 | 99,458,000  |  |
| 新潟市 公募平成２９年度第１回       | 100,000,000 | 99,469,000  |  |
| 新潟市 公募令和５年度第１回        | 200,000,000 | 200,290,000 |  |
| 静岡市 公募令和５年度第１回        | 100,000,000 | 101,418,000 |  |
| 大阪市 公募平成２７年度第６回       | 100,000,000 | 100,441,000 |  |
| 大阪市 公募令和２年度第２回        | 300,000,000 | 293,019,000 |  |
| 大阪市 公募令和３年度第２回        | 300,000,000 | 290,727,000 |  |
| 大阪市 公募（１５年）第１回        | 100,000,000 | 103,593,000 |  |
| 大阪市 公募（２０年）第１回        | 300,000,000 | 321,699,000 |  |
| 大阪市 公募（２０年）第５回        | 100,000,000 | 109,224,000 |  |
| 大阪市 公募（２０年）第６回        | 100,000,000 | 108,376,000 |  |
| 大阪市 公募（２０年）第１７回       | 200,000,000 | 216,450,000 |  |
| 大阪市 公募（２０年）第１９回       | 100,000,000 | 101,693,000 |  |
| 大阪市 公募（２０年）第２６回       | 100,000,000 | 93,094,000  |  |
| 名古屋市 公募第５０１回          | 200,000,000 | 199,000,000 |  |
| 名古屋市 公募第５０３回          | 100,000,000 | 99,355,000  |  |
| 名古屋市 公募第５０４回          | 200,000,000 | 198,422,000 |  |
| 名古屋市 公募第５１１回          | 200,000,000 | 195,082,000 |  |
| 名古屋市 公募第５１２回          | 300,000,000 | 293,283,000 |  |
| 名古屋市 公募（１２年）第１回       | 200,000,000 | 202,346,000 |  |
| 名古屋市 公募（１５年）第２回       | 100,000,000 | 102,413,000 |  |
| 名古屋市 公募（３０年）第１３回      | 100,000,000 | 85,525,000  |  |
| 名古屋市 公募（２０年）第１５回      | 100,000,000 | 108,238,000 |  |
| 名古屋市 公募（２０年）第１７回      | 100,000,000 | 102,418,000 |  |
| 名古屋市 公募（２０年）第１８回      | 100,000,000 | 101,354,000 |  |
| 名古屋市 公募（２０年）第１９回      | 100,000,000 | 91,748,000  |  |
| 京都市 公募平成２９年度第１回       | 100,000,000 | 99,634,000  |  |
| 京都市 公募平成２９年度第４回       | 101,280,000 | 100,795,881 |  |
| 京都市 公募平成３０年度第１回       | 101,090,000 | 100,327,781 |  |
| 京都市 公募（２０年）第２回        | 100,000,000 | 103,033,000 |  |
| 京都市 公募（２０年）第５回        | 200,000,000 | 211,788,000 |  |
| 京都市 公募（２０年）第６回        | 100,000,000 | 107,263,000 |  |
| 京都市 公募（２０年）第１３回       | 100,000,000 | 104,196,000 |  |
| 京都市 公募（２０年）第１５回       | 200,000,000 | 185,232,000 |  |
| 神戸市 公募（２０年）平成２０年度第２４回 | 100,000,000 | 107,812,000 |  |
| 神戸市 公募平成２５年度第１２回      | 100,000,000 | 106,172,000 |  |
| 神戸市 公募（２０年）平成２６年度第３回  | 100,000,000 | 105,734,000 |  |
| 神戸市 公募平成２８年度第１回       | 200,000,000 | 199,312,000 |  |



|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 神戸市 公募平成30年度第2回       | 200,000,000 | 165,010,000 |  |
| 神戸市 公募令和3年度第6回        | 100,000,000 | 75,988,000  |  |
| 横浜市 公募平成28年度第5回       | 300,000,000 | 299,724,000 |  |
| 横浜市 公募平成29年度第3回       | 100,000,000 | 99,722,000  |  |
| 横浜市 公募2019年度第3回       | 200,000,000 | 195,410,000 |  |
| 横浜市 公募（30年）第2回        | 200,000,000 | 232,038,000 |  |
| 横浜市 公募（20年）第11回       | 100,000,000 | 105,475,000 |  |
| 横浜市 公募（20年）第18回       | 100,000,000 | 109,076,000 |  |
| 横浜市 公募（20年）第26回       | 100,000,000 | 108,823,000 |  |
| 横浜市 公募（20年）第30回       | 100,000,000 | 104,530,000 |  |
| 横浜市 公募（20年）第35回       | 100,000,000 | 92,325,000  |  |
| 札幌市 公募（15年）平成23年度第9回  | 200,000,000 | 207,290,000 |  |
| 札幌市 公募（20年）平成24年度第1回  | 100,000,000 | 108,720,000 |  |
| 札幌市 公募（20年）平成24年度第11回 | 200,000,000 | 217,924,000 |  |
| 札幌市 公募（20年）平成28年度第4回  | 100,000,000 | 92,163,000  |  |
| 札幌市 公募（5年）令和3年度第8回    | 100,000,000 | 96,240,000  |  |
| 札幌市 公募（5年）令和4年度第4回    | 100,000,000 | 97,770,000  |  |
| 札幌市 公募（20年）第6回        | 200,000,000 | 218,650,000 |  |
| 川崎市 公募第95回            | 160,000,000 | 157,660,800 |  |
| 川崎市 公募（20年）第14回       | 200,000,000 | 217,412,000 |  |
| 川崎市 公募（20年）第17回       | 100,000,000 | 106,606,000 |  |
| 川崎市 公募（20年）第18回       | 100,000,000 | 106,361,000 |  |
| 川崎市 公募（20年）第19回       | 100,000,000 | 104,464,000 |  |
| 川崎市 公募（20年）第20回       | 100,000,000 | 101,783,000 |  |
| 川崎市 公募（20年）第22回       | 100,000,000 | 92,388,000  |  |
| 川崎市 公募（30年）第11回       | 100,000,000 | 81,908,000  |  |
| 川崎市 公募（5年）第66回        | 230,000,000 | 228,576,300 |  |
| 川崎市 公募（5年）第67回        | 100,000,000 | 99,794,000  |  |
| 北九州市 公募（10年）令和2年度第2回  | 200,000,000 | 194,200,000 |  |
| 北九州市 公募（10年）令和5年度第2回  | 200,000,000 | 200,290,000 |  |
| 北九州市 公募（20年）第3回       | 200,000,000 | 214,216,000 |  |
| 北九州市 公募（20年）第14回      | 100,000,000 | 108,311,000 |  |
| 福岡市 公募（20年）平成21年度第3回  | 200,000,000 | 218,332,000 |  |
| 福岡市 公募（20年）平成23年度第4回  | 100,000,000 | 109,253,000 |  |
| 福岡市 公募平成26年度第2回       | 100,000,000 | 105,827,000 |  |
| 福岡市 公募平成26年度第8回       | 160,000,000 | 160,601,600 |  |
|                       |             |             |  |

|      |     |                             |                |                |  |
|------|-----|-----------------------------|----------------|----------------|--|
|      |     | 福岡市 公募（５年）２０２０年度第９回         | 300,000,000    | 298,839,000    |  |
|      |     | 福岡市 公募（２０年）２０２１年度第６回        | 100,000,000    | 84,722,000     |  |
|      |     | 広島市 公募平成２７年度第２回             | 500,000,000    | 502,240,000    |  |
|      |     | 広島市 公募（１０年）平成３０年度第６回        | 241,000,000    | 237,392,230    |  |
|      |     | 広島市 公募（１０年）令和３年度第６回         | 100,000,000    | 96,722,000     |  |
|      |     | 広島市 公募（１０年）令和５年度第５回         | 100,000,000    | 100,236,000    |  |
|      |     | さいたま市 公募第２１回                | 320,100,000    | 320,855,436    |  |
|      |     | 三重県 公募平成２８年度第１回             | 155,000,000    | 154,626,450    |  |
|      |     | 三重県 公募令和５年度第３回              | 200,000,000    | 200,472,000    |  |
|      |     | 福井県 公募平成２７年度第４回             | 200,000,000    | 199,326,000    |  |
|      |     | 福井県 公募令和元年度第３回              | 200,000,000    | 195,320,000    |  |
|      |     | 福井県 公募令和４年度第５回              | 100,000,000    | 97,155,000     |  |
|      |     | 徳島県 公募平成２９年度第２回             | 200,000,000    | 198,916,000    |  |
|      |     | 徳島県 公募平成３０年度第２回             | 300,000,000    | 297,600,000    |  |
|      |     | 山梨県 公募令和元年度第１回              | 100,000,000    | 97,658,000     |  |
|      |     | 岡山県 公募平成２８年度第２回             | 168,900,000    | 168,580,779    |  |
|      |     | 岡山県 公募令和２年度第３回              | 300,000,000    | 292,806,000    |  |
|      |     | 岡山県 公募令和３年度第１回              | 100,000,000    | 96,371,000     |  |
|      |     | 秋田県 公募令和３年度第１回              | 116,600,000    | 112,566,806    |  |
|      |     | 神奈川県住宅供給公社債券 第４回            | 100,000,000    | 99,020,000     |  |
|      |     | 広島県・広島市折半保証広島高速道路債券 第２２回    | 100,000,000    | 84,388,000     |  |
|      |     | 愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第９６回  | 100,000,000    | 108,198,000    |  |
|      |     | 愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第１０２回 | 300,000,000    | 328,245,000    |  |
|      |     | 愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第１２８回 | 100,000,000    | 98,238,000     |  |
|      |     | 愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第１４８回 | 100,000,000    | 90,832,000     |  |
|      |     | 福岡北九州高速道路債券 第１１７回           | 100,000,000    | 107,872,000    |  |
|      |     | 福岡北九州高速道路債券 第１３６回           | 100,000,000    | 101,187,000    |  |
|      |     | 福岡北九州高速道路債券 第１４５回           | 100,000,000    | 92,018,000     |  |
|      |     | 東京都住宅供給公社債券 第１９回            | 300,000,000    | 311,148,000    |  |
|      |     | 東京都住宅供給公社債券 第２３回            | 100,000,000    | 101,406,000    |  |
|      | 小計  | 銘柄数：３４６                     | 59,963,700,000 | 60,277,841,580 |  |
|      |     | 組入時価比率：５.５％                 |                | 5.5%           |  |
|      | 合計  |                             |                | 60,277,841,580 |  |
| 特殊債券 | 日本円 | 新関西国際空港債券 政府保証第５回           | 117,000,000    | 116,706,330    |  |

|                             |             |             |  |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 新関西国際空港社債 財投機関債第6回          | 300,000,000 | 312,321,000 |  |
| 新関西国際空港社債 財投機関債第9回          | 100,000,000 | 103,205,000 |  |
| 新関西国際空港社債 財投機関債第12回         | 100,000,000 | 102,550,000 |  |
| 新関西国際空港社債 財投機関債第14回         | 100,000,000 | 102,507,000 |  |
| 新関西国際空港社債 財投機関債第28回         | 100,000,000 | 96,530,000  |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回        | 100,000,000 | 102,723,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第66回        | 400,000,000 | 398,328,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第78回        | 200,000,000 | 199,338,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第82回        | 100,000,000 | 99,712,000  |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回        | 300,000,000 | 298,434,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回        | 200,000,000 | 197,750,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第101回       | 300,000,000 | 297,465,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第137回       | 400,000,000 | 397,892,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第138回       | 400,000,000 | 387,036,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第37回         | 400,000,000 | 398,596,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第41回         | 333,000,000 | 330,878,790 |  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第42回         | 420,000,000 | 417,778,200 |  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第55回         | 300,000,000 | 295,227,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第62回         | 200,000,000 | 194,574,000 |  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第75回         | 370,000,000 | 359,207,100 |  |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第78回         | 220,000,000 | 218,856,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第1回  | 400,000,000 | 488,808,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第4回  | 100,000,000 | 116,208,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8回  | 300,000,000 | 313,473,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回 | 100,000,000 | 105,258,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回 | 500,000,000 | 534,305,000 |  |
|                             | 100,000,000 | 117,163,000 |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第26回  |             |             |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回  | 200,000,000 | 242,348,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回  | 300,000,000 | 325,575,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第43回  | 300,000,000 | 268,287,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回  | 100,000,000 | 109,617,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第55回  | 100,000,000 | 109,748,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回  | 100,000,000 | 107,531,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第95回  | 200,000,000 | 216,222,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回 | 350,000,000 | 376,033,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回 | 600,000,000 | 652,896,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第126回 | 100,000,000 | 102,512,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回 | 300,000,000 | 291,606,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回 | 100,000,000 | 98,434,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第151回 | 100,000,000 | 101,789,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第152回 | 100,000,000 | 98,851,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第155回 | 100,000,000 | 102,531,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回 | 100,000,000 | 101,722,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第160回 | 100,000,000 | 102,310,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第163回 | 100,000,000 | 101,361,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回 | 100,000,000 | 100,814,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回 | 100,000,000 | 69,647,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回 | 100,000,000 | 92,242,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第204回 | 100,000,000 | 77,712,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第260回 | 200,000,000 | 150,538,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第278回 | 300,000,000 | 298,905,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第90回  | 100,000,000 | 109,168,000 |  |
|                              | 200,000,000 | 218,602,000 |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回  |             |             |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回  | 200,000,000 | 219,014,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回  | 200,000,000 | 220,404,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回 | 200,000,000 | 219,814,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第111回 | 100,000,000 | 109,442,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回 | 200,000,000 | 217,782,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回 | 100,000,000 | 110,259,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第127回 | 300,000,000 | 329,661,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第146回 | 100,000,000 | 108,813,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第164回 | 100,000,000 | 108,008,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回 | 100,000,000 | 105,261,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第167回 | 100,000,000 | 108,001,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回 | 300,000,000 | 323,103,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回 | 300,000,000 | 321,411,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回 | 300,000,000 | 319,842,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第176回 | 200,000,000 | 215,658,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第181回 | 100,000,000 | 108,004,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回 | 100,000,000 | 108,548,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第185回 | 200,000,000 | 217,666,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第196回 | 400,000,000 | 436,280,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第214回 | 100,000,000 | 106,015,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回 | 100,000,000 | 106,083,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回 | 100,000,000 | 102,385,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回 | 200,000,000 | 212,070,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回 | 100,000,000 | 102,249,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第228回 | 100,000,000 | 105,108,000 |  |
|                              | 100,000,000 | 104,179,000 |  |

|                                |             |             |  |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 3 3回 |             |             |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 3 7回 | 100,000,000 | 100,497,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 3 9回 | 500,000,000 | 512,010,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 4 1回 | 200,000,000 | 200,798,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 4 3回 | 444,000,000 | 445,536,240 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 4 5回 | 500,000,000 | 507,285,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 4 6回 | 200,000,000 | 204,956,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 5 5回 | 100,000,000 | 102,752,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 5 8回 | 400,000,000 | 401,460,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 5 9回 | 100,000,000 | 101,511,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 6 1回 | 583,000,000 | 585,069,650 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 7 1回 | 151,000,000 | 150,427,710 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 9 6回 | 200,000,000 | 186,948,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 9 7回 | 100,000,000 | 99,644,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 0 6回 | 403,000,000 | 401,988,470 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 1 5回 | 100,000,000 | 99,597,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 2 1回 | 600,000,000 | 597,582,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 2 4回 | 100,000,000 | 99,338,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 5回 | 100,000,000 | 83,355,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 9回 | 500,000,000 | 497,590,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 4 2回 | 131,000,000 | 130,043,700 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 1回 | 100,000,000 | 99,117,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 4回 | 200,000,000 | 197,968,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 5 7回 | 100,000,000 | 99,287,000  |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 9 1回 | 113,000,000 | 110,312,860 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 9 8回 | 100,000,000 | 72,357,000  |  |
|                                | 500,000,000 | 498,105,000 |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第449回 |             |             |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第453回 | 200,000,000 | 199,704,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第463回 | 500,000,000 | 497,875,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第9回   | 100,000,000 | 116,742,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回  | 500,000,000 | 589,035,000 |  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回  | 100,000,000 | 118,719,000 |  |
| 公営企業債券 30年第4回財投機関債           | 300,000,000 | 357,549,000 |  |
| 地方公営企業等金融機構債券（20年） 第1回       | 100,000,000 | 107,459,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（20年） 第1回        | 300,000,000 | 327,552,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第4回          | 100,000,000 | 109,091,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F16回            | 100,000,000 | 104,932,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第6回          | 300,000,000 | 330,258,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第7回          | 400,000,000 | 440,028,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（20年） 第10回       | 300,000,000 | 322,368,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（20年） 第19回       | 200,000,000 | 217,206,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（20年） 第20回       | 100,000,000 | 108,314,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F96回            | 300,000,000 | 310,851,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F104回           | 100,000,000 | 101,207,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F122回           | 100,000,000 | 103,522,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F124回           | 100,000,000 | 103,518,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F132回           | 500,000,000 | 506,320,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（20年） 第24回       | 200,000,000 | 215,390,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F143回           | 300,000,000 | 310,362,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F145回           | 200,000,000 | 201,932,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F147回           | 100,000,000 | 103,018,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 F160回           | 100,000,000 | 102,560,000 |  |
|                              | 100,000,000 | 107,908,000 |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第２９回 |             |             |  |
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第３２回 | 100,000,000 | 106,832,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（１５年）第２回  | 200,000,000 | 206,368,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第３７回 | 200,000,000 | 211,128,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第３８回 | 300,000,000 | 315,144,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 Ｆ２４０回    | 300,000,000 | 309,348,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 Ｆ２４３回    | 300,000,000 | 312,828,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 Ｆ２４８回    | 100,000,000 | 104,219,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第３９回 | 200,000,000 | 208,750,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第４０回 | 100,000,000 | 103,878,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第４３回 | 100,000,000 | 101,363,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券第７２回   | 189,000,000 | 189,943,110 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券第７３回   | 338,000,000 | 339,632,540 |  |
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第４４回 | 200,000,000 | 205,238,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第７４回     | 500,000,000 | 502,210,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券第７５回   | 124,000,000 | 124,550,560 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券第７６回   | 141,000,000 | 141,603,480 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券第７７回   | 121,000,000 | 121,450,120 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第７７回     | 100,000,000 | 100,421,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券第７８回   | 616,000,000 | 618,205,280 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 Ｆ３０８回    | 200,000,000 | 199,908,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第７９回     | 400,000,000 | 401,608,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券第８０回   | 300,000,000 | 300,744,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券第８３回   | 116,000,000 | 115,551,080 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第８４回     | 100,000,000 | 99,560,000  |  |
| 地方公共団体金融機構債券（２０年）第５３回 | 200,000,000 | 177,636,000 |  |
|                       | 300,000,000 | 298,947,000 |  |



|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 9 1 回    |             |             |  |
| 地方公共団体金融機構債券（20<br>年） 第 5 8 回 | 100,000,000 | 94,246,000  |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 9 5<br>回       | 200,000,000 | 199,236,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 9 8 回    | 122,000,000 | 121,604,720 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 1 0<br>1 回     | 400,000,000 | 397,888,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 1 0 8 回  | 157,000,000 | 155,718,880 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 6 7<br>回       | 100,000,000 | 90,658,000  |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 1 1 0 回  | 100,000,000 | 99,016,000  |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 1 1 3 回  | 110,000,000 | 109,164,000 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 1 1 9 回  | 116,000,000 | 113,751,920 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 1 2 0 回  | 103,000,000 | 100,674,260 |  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券<br>第 1 2 1 回  | 100,000,000 | 97,598,000  |  |
| 地方公共団体金融機構債券 2 回              | 100,000,000 | 66,475,000  |  |
| 地方公共団体金融機構債券 1 2 回            | 200,000,000 | 153,354,000 |  |
| 地方公共団体金融機構債券 第 1 6<br>6 回     | 200,000,000 | 198,730,000 |  |
| 公営企業債券（20年） 第 1 9 回<br>財投機関債  | 100,000,000 | 105,774,000 |  |
| 公営企業債券（20年） 第 2 0 回<br>財投機関債  | 100,000,000 | 105,887,000 |  |
| 公営企業債券（20年） 第 2 3 回<br>財投機関債  | 200,000,000 | 213,622,000 |  |
| 公営企業債券（20年） 第 2 4 回<br>財投機関債  | 100,000,000 | 107,656,000 |  |
| 公営企業債券（20年） 第 2 5 回<br>財投機関債  | 100,000,000 | 108,756,000 |  |
| 首都高速道路 第 2 8 回                | 200,000,000 | 198,542,000 |  |
| 阪神高速道路 第 2 5 回                | 100,000,000 | 99,401,000  |  |
| 日本政策金融公庫債券 政府保証第<br>5 5 回     | 108,000,000 | 106,219,080 |  |
| 日本政策金融公庫債券 政府保証第<br>6 3 回     | 270,000,000 | 262,062,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第 9 3 回           | 100,000,000 | 103,024,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第 9 7 回           | 100,000,000 | 102,668,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第 1 0 1<br>回      | 100,000,000 | 102,183,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第 1 0 9<br>回      | 100,000,000 | 102,095,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第 1 1 3<br>回      | 300,000,000 | 304,863,000 |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 都市再生債券 財投機関債第121回     | 200,000,000 | 197,948,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第127回     | 200,000,000 | 198,898,000 |  |
| 都市再生債券 財投機関債第141回     | 100,000,000 | 91,850,000  |  |
| 都市再生債券 財投機関債第155回     | 100,000,000 | 71,831,000  |  |
| 都市再生債券 財投機関債第166回     | 100,000,000 | 70,265,000  |  |
| 都市再生債券 財投機関債第170回     | 100,000,000 | 84,721,000  |  |
| 都市再生債券 財投機関債第191回     | 100,000,000 | 97,319,000  |  |
| 本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回    | 100,000,000 | 102,715,000 |  |
| 民間都市開発推進機構 政府保証第17回   | 400,000,000 | 399,596,000 |  |
| 民間都市開発推進機構 政府保証第20回   | 113,600,000 | 112,770,720 |  |
| 関西国際空港債券 政府保証第54回     | 400,000,000 | 435,140,000 |  |
| 福祉医療機構債券 第50回財投機関債    | 300,000,000 | 298,656,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回   | 400,000,000 | 423,628,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回   | 200,000,000 | 213,868,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回  | 100,000,000 | 101,913,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回  | 100,000,000 | 109,437,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回  | 100,000,000 | 108,694,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回  | 100,000,000 | 109,922,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回  | 900,000,000 | 930,195,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回  | 100,000,000 | 109,874,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第81回  | 100,000,000 | 109,000,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第85回  | 200,000,000 | 216,820,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回  | 200,000,000 | 207,290,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第94回  | 100,000,000 | 108,813,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第111回 | 100,000,000 | 103,496,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第112回 | 100,000,000 | 107,797,000 |  |
|                       | 100,000,000 | 108,410,000 |  |

|                           |             |             |  |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第115回 |             |             |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第120回 | 100,000,000 | 108,674,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第123回 | 300,000,000 | 325,011,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第128回 | 100,000,000 | 111,071,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第132回 | 200,000,000 | 205,418,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第134回 | 100,000,000 | 103,650,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第137回 | 200,000,000 | 207,394,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第143回 | 100,000,000 | 103,225,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第162回 | 100,000,000 | 102,521,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第177回 | 450,000,000 | 451,710,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第188回 | 300,000,000 | 298,692,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第195回 | 100,000,000 | 91,430,000  |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第198回 | 300,000,000 | 298,779,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第208回 | 200,000,000 | 199,190,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第222回 | 200,000,000 | 198,668,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第223回 | 100,000,000 | 96,675,000  |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第227回 | 100,000,000 | 99,428,000  |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第244回 | 130,000,000 | 128,888,500 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第277回 | 100,000,000 | 74,396,000  |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第301回 | 300,000,000 | 298,713,000 |  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債<br>第306回 | 200,000,000 | 183,390,000 |  |
| 成田国際空港 第19回               | 100,000,000 | 99,920,000  |  |
| 成田国際空港 第39回               | 300,000,000 | 276,108,000 |  |
| 沖縄振興開発金融公庫債券 財投機<br>関債第6回 | 200,000,000 | 204,900,000 |  |
| 商工債券 利付第845回い号            | 300,000,000 | 298,893,000 |  |
| 商工債券 利付第852回い号            | 100,000,000 | 99,292,000  |  |
| 商工債券 利付第854回い号            | 400,000,000 | 396,864,000 |  |
| 商工債券 利付第856回い号            | 200,000,000 | 198,328,000 |  |
| 商工債券 利付第862回い号            | 100,000,000 | 99,278,000  |  |
|                           |             |             |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 商工債券 利付第 8 6 8 回い号    | 100,000,000 | 99,062,000  |  |
| 商工債券 利付第 8 7 1 回い号    | 100,000,000 | 99,321,000  |  |
| 商工債券 利付第 8 7 2 回い号    | 100,000,000 | 99,660,000  |  |
| 商工債券 利付第 8 7 6 回い号    | 300,000,000 | 298,377,000 |  |
| 商工債券 利付第 8 7 8 回い号    | 200,000,000 | 198,514,000 |  |
| 商工債券 利付第 8 7 9 回い号    | 300,000,000 | 298,173,000 |  |
| 商工債券 利付第 8 8 3 回い号    | 200,000,000 | 199,814,000 |  |
| 商工債券 利付第 8 8 5 回い号    | 300,000,000 | 299,400,000 |  |
| しんきん中金債券 利付第 3 7 4 回  | 300,000,000 | 298,524,000 |  |
| しんきん中金債券 利付第 3 7 7 回  | 100,000,000 | 99,414,000  |  |
| しんきん中金債券 利付第 3 7 9 回  | 400,000,000 | 397,432,000 |  |
| しんきん中金債券 利付第 3 8 0 回  | 100,000,000 | 99,311,000  |  |
| しんきん中金債券 利付第 3 8 7 回  | 100,000,000 | 99,280,000  |  |
| しんきん中金債券 利付第 4 0 0 回  | 100,000,000 | 99,778,000  |  |
| しんきん中金債券 利付第 4 0 1 回  | 300,000,000 | 298,950,000 |  |
| しんきん中金債券 利付第 4 0 2 回  | 100,000,000 | 99,372,000  |  |
| しんきん中金債券 利付第 4 0 3 回  | 100,000,000 | 99,145,000  |  |
| しんきん中金債券 利付第 4 0 7 回  | 300,000,000 | 299,379,000 |  |
| 商工債券 利付（3 年）第 2 7 4 回 | 200,000,000 | 199,260,000 |  |
| 商工債券 利付（1 0 年）第 1 5 回 | 200,000,000 | 200,518,000 |  |
| 商工債券 利付（1 0 年）第 1 6 回 | 100,000,000 | 100,163,000 |  |
| 商工債券 利付（1 0 年）第 4 1 回 | 300,000,000 | 286,761,000 |  |
| 国際協力機構債券 第 6 回財投機関債   | 200,000,000 | 219,612,000 |  |
| 国際協力機構債券 第 1 5 回財投機関債 | 100,000,000 | 107,717,000 |  |
| 国際協力機構債券 第 2 5 回財投機関債 | 100,000,000 | 105,115,000 |  |
| 国際協力機構債券 第 3 2 回財投機関債 | 100,000,000 | 101,515,000 |  |
| 国際協力機構債券 第 3 5 回財投機関債 | 100,000,000 | 99,514,000  |  |
| 国際協力機構債券 第 4 0 回財投機関債 | 100,000,000 | 99,569,000  |  |
| 国際協力機構債券 第 6 8 回財投機関債 | 100,000,000 | 97,059,000  |  |
| 東日本高速道路 第 5 7 回       | 100,000,000 | 99,502,000  |  |
| 東日本高速道路 第 6 1 回       | 200,000,000 | 195,412,000 |  |
| 東日本高速道路 第 6 4 回       | 100,000,000 | 97,519,000  |  |
| 東日本高速道路 第 6 9 回       | 100,000,000 | 97,707,000  |  |
| 東日本高速道路 第 8 3 回       | 200,000,000 | 198,728,000 |  |
| 東日本高速道路 第 8 6 回       | 400,000,000 | 396,748,000 |  |
| 東日本高速道路 第 8 9 回       | 130,000,000 | 128,943,100 |  |
| 東日本高速道路 第 9 5 回       | 750,000,000 | 746,520,000 |  |
| 中日本高速道路 第 6 3 回       | 100,000,000 | 100,484,000 |  |
|                       |             |             |  |

|                                  |               |               |  |
|----------------------------------|---------------|---------------|--|
| 中日本高速道路 第 8 6 回                  | 500,000,000   | 497,605,000   |  |
| 中日本高速道路 第 8 9 回                  | 100,000,000   | 99,377,000    |  |
| 中日本高速道路 第 9 0 回                  | 300,000,000   | 298,008,000   |  |
| 中日本高速道路 第 9 1 回                  | 200,000,000   | 198,542,000   |  |
| 中日本高速道路 第 9 3 回                  | 200,000,000   | 198,654,000   |  |
| 中日本高速道路 第 9 6 回                  | 200,000,000   | 200,104,000   |  |
| 中日本高速道路 第 9 7 回                  | 200,000,000   | 201,500,000   |  |
| 中日本高速道路 第 9 8 回                  | 300,000,000   | 300,795,000   |  |
| 中日本高速道路 第 1 0 1 回                | 500,000,000   | 498,695,000   |  |
| 西日本高速道路 第 2 9 回                  | 200,000,000   | 199,980,000   |  |
| 西日本高速道路 第 3 0 回                  | 300,000,000   | 298,992,000   |  |
| 西日本高速道路 第 3 4 回                  | 300,000,000   | 299,949,000   |  |
| 西日本高速道路 第 6 1 回                  | 300,000,000   | 298,023,000   |  |
| 西日本高速道路 第 6 2 回                  | 1,100,000,000 | 1,091,981,000 |  |
| 西日本高速道路 第 6 4 回                  | 200,000,000   | 198,542,000   |  |
| 西日本高速道路 第 6 9 回                  | 200,000,000   | 199,040,000   |  |
| 西日本高速道路 第 7 7 回                  | 200,000,000   | 199,330,000   |  |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 9 回   | 200,000,000   | 208,940,000   |  |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 9 0 回   | 300,000,000   | 290,217,000   |  |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 1 3 5 回 | 300,000,000   | 292,131,000   |  |
| 貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券            | 19,920,000    | 19,958,047    |  |
| 貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券            | 9,787,000     | 9,807,650     |  |
| 貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券          | 14,649,000    | 15,265,429    |  |
| 貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援機構債券          | 50,721,000    | 52,908,596    |  |
| 貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券          | 45,022,000    | 46,465,405    |  |
| 貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券          | 52,671,000    | 54,699,360    |  |
| 貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援機構債券          | 39,066,000    | 40,309,861    |  |
| 貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券          | 26,156,000    | 27,068,321    |  |
| 貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援機構債券          | 49,143,000    | 51,035,988    |  |
| 貸付債権担保第 4 0 回住宅金融支援機構債券          | 56,607,000    | 58,101,990    |  |
| 貸付債権担保第 6 2 回住宅金融支援機構債券          | 85,890,000    | 87,778,721    |  |
| 貸付債権担保第 6 0 回住宅金融支援機構債券          | 75,279,000    | 77,489,191    |  |
| 貸付債権担保第 6 1 回住宅金融支援機構債券          | 50,574,000    | 51,823,177    |  |
|                                  |               |               |  |

|                             |             |             |  |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 貸付債権担保第 5 1 回住宅金融支援<br>機構債券 | 18,246,000  | 18,875,669  |  |
| 貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援<br>機構債券 | 44,768,000  | 46,529,620  |  |
| 貸付債権担保第 7 9 回住宅金融支援<br>機構債券 | 29,576,000  | 30,037,385  |  |
| 貸付債権担保第 8 1 回住宅金融支援<br>機構債券 | 65,624,000  | 66,585,391  |  |
| 貸付債権担保第 7 2 回住宅金融支援<br>機構債券 | 28,399,000  | 28,869,287  |  |
| 貸付債権担保第 7 0 回住宅金融支援<br>機構債券 | 88,125,000  | 90,240,881  |  |
| 貸付債権担保第 3 3 回住宅金融支援<br>機構債券 | 18,559,000  | 19,363,903  |  |
| 貸付債権担保第 3 4 回住宅金融支援<br>機構債券 | 18,985,000  | 19,798,317  |  |
| 貸付債権担保第 3 5 回住宅金融支援<br>機構債券 | 17,981,000  | 18,730,807  |  |
| 貸付債権担保第 4 6 回住宅金融支援<br>機構債券 | 17,224,000  | 17,900,730  |  |
| 貸付債権担保第 5 5 回住宅金融支援<br>機構債券 | 48,808,000  | 50,358,630  |  |
| 貸付債権担保第 5 6 回住宅金融支援<br>機構債券 | 69,447,000  | 71,646,386  |  |
| 貸付債権担保第 5 7 回住宅金融支援<br>機構債券 | 23,298,000  | 24,054,253  |  |
| 貸付債権担保第 7 6 回住宅金融支援<br>機構債券 | 55,738,000  | 56,992,105  |  |
| 貸付債権担保第 2 3 回住宅金融支援<br>機構債券 | 53,384,000  | 55,208,131  |  |
| 貸付債権担保第 3 2 回住宅金融支援<br>機構債券 | 53,301,000  | 55,376,540  |  |
| 貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援<br>機構債券 | 94,195,000  | 97,163,084  |  |
| 貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援<br>機構債券 | 52,208,000  | 53,876,045  |  |
| 貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援<br>機構債券 | 92,985,000  | 94,776,820  |  |
| 貸付債権担保第 7 1 回住宅金融支援<br>機構債券 | 83,406,000  | 84,769,688  |  |
| 貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援<br>機構債券 | 66,982,000  | 68,687,361  |  |
| 貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援<br>機構債券 | 55,556,000  | 56,927,122  |  |
| 貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援<br>機構債券 | 142,244,000 | 143,926,746 |  |
| 貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援<br>機構債券 | 243,887,000 | 246,506,346 |  |
| 貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援<br>機構債券 | 37,927,000  | 38,107,153  |  |
| 貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援<br>機構債券 | 38,875,000  | 39,085,313  |  |
|                             | 39,819,000  | 39,848,864  |  |

|                           |             |             |  |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援機構債券   |             |             |  |
| 貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援機構債券   | 84,712,000  | 84,008,890  |  |
| 貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援機構債券   | 90,372,000  | 88,738,074  |  |
| 貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援機構債券   | 47,563,000  | 47,242,425  |  |
| 貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援機構債券   | 50,831,000  | 50,204,762  |  |
| 貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援機構債券   | 149,907,000 | 148,826,170 |  |
| 貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援機構債券   | 156,513,000 | 155,794,605 |  |
| 貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券   | 105,466,000 | 104,759,377 |  |
| 貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券 | 51,449,000  | 50,992,647  |  |
| 貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券 | 52,381,000  | 52,066,714  |  |
| 貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券 | 201,045,000 | 192,830,301 |  |
| 貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券 | 135,152,000 | 130,155,430 |  |
| 貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券 | 135,692,000 | 130,360,661 |  |
| 貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券 | 67,335,000  | 64,783,676  |  |
| 貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券 | 135,392,000 | 130,119,835 |  |
| 貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券 | 67,989,000  | 64,996,124  |  |
| 貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券 | 68,865,000  | 65,909,314  |  |
| 貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券 | 70,114,000  | 67,164,304  |  |
| 貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券 | 278,900,000 | 266,321,610 |  |
| 貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券 | 211,506,000 | 201,939,583 |  |
| 貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券 | 141,050,000 | 134,598,373 |  |
| 貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券 | 144,244,000 | 137,826,584 |  |
| 貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券 | 146,496,000 | 139,012,984 |  |
| 貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券 | 73,498,000  | 69,723,877  |  |
| 貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券 | 74,158,000  | 70,587,292  |  |
| 貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券 | 74,150,000  | 70,224,499  |  |
|                           | 230,418,000 | 216,966,197 |  |

|                       |             |             |  |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券 |             |             |  |
| 貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券 | 228,291,000 | 214,958,805 |  |
| 貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券 | 404,865,000 | 376,334,163 |  |
| 貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券 | 163,362,000 | 153,212,318 |  |
| 貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券 | 165,442,000 | 154,618,784 |  |
| 貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券 | 261,318,000 | 244,021,361 |  |
| 貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券 | 173,046,000 | 162,059,309 |  |
| 貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券 | 261,150,000 | 245,564,568 |  |
| 貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券 | 174,098,000 | 163,587,703 |  |
| 貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券 | 173,576,000 | 162,932,319 |  |
| 貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券 | 264,576,000 | 247,968,564 |  |
| 貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券 | 441,420,000 | 413,226,504 |  |
| 貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券 | 270,330,000 | 253,210,001 |  |
| 貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券 | 272,403,000 | 254,598,739 |  |
| 貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券 | 272,388,000 | 253,421,623 |  |
| 貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券 | 182,166,000 | 170,623,962 |  |
| 貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券 | 273,429,000 | 258,081,430 |  |
| 貸付債権担保第179回住宅金融支援機構債券 | 273,951,000 | 257,787,891 |  |
| 貸付債権担保第180回住宅金融支援機構債券 | 183,130,000 | 173,259,293 |  |
| 貸付債権担保第183回住宅金融支援機構債券 | 559,158,000 | 529,013,792 |  |
| 貸付債権担保第185回住宅金融支援機構債券 | 282,522,000 | 268,361,997 |  |
| 貸付債権担保第186回住宅金融支援機構債券 | 189,202,000 | 182,735,075 |  |
| 貸付債権担保第195回住宅金融支援機構債券 | 196,362,000 | 193,663,986 |  |
| 貸付債権担保第197回住宅金融支援機構債券 | 295,512,000 | 295,319,917 |  |
| 貸付債権担保第198回住宅金融支援機構債券 | 198,074,000 | 199,668,495 |  |
| 貸付債権担保第199回住宅金融支援機構債券 | 397,604,000 | 398,438,968 |  |
|                       | 499,460,000 | 498,580,950 |  |



|     |     |                                 |                |                |  |
|-----|-----|---------------------------------|----------------|----------------|--|
|     | 小計  | 貸付債権担保第200回住宅金融支援機構債券           |                |                |  |
|     |     | 銘柄数：391                         | 74,216,665,000 | 74,823,188,538 |  |
|     |     | 組入時価比率：6.8%                     |                | 6.9%           |  |
|     | 合計  |                                 |                | 74,823,188,538 |  |
| 社債券 | 日本円 | フランス相互信用連合銀行（BFCM）第31回円貨社債      | 100,000,000    | 95,671,000     |  |
|     |     | フランス相互信用連合銀行（BFCM）第42回円貨社債      | 200,000,000    | 201,244,000    |  |
|     |     | ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債      | 100,000,000    | 98,933,000     |  |
|     |     | ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第25回非上位円貨社債   | 200,000,000    | 196,300,000    |  |
|     |     | ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第29回非上位円貨社債   | 100,000,000    | 100,080,000    |  |
|     |     | ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第36回円貨社債      | 100,000,000    | 99,876,000     |  |
|     |     | ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第37回円貨社債      | 100,000,000    | 99,813,000     |  |
|     |     | クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債（2018） | 100,000,000    | 97,530,000     |  |
|     |     | スタンダード・チャータード 第3回円貨社債（2015）     | 100,000,000    | 99,804,000     |  |
|     |     | エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円  | 100,000,000    | 99,911,000     |  |
|     |     | ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第7回円貨社債   | 100,000,000    | 97,353,000     |  |
|     |     | フランス電力 第4回円貨社債（2017）            | 100,000,000    | 100,346,000    |  |
|     |     | INPEX 第1回社債間限定同順位特約付            | 500,000,000    | 496,305,000    |  |
|     |     | 清水建設 第34回社債間限定同順位特約付            | 100,000,000    | 100,331,000    |  |
|     |     | 長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付     | 200,000,000    | 194,736,000    |  |
|     |     | 戸田建設 第5回社債間限定同順位特約付             | 100,000,000    | 96,885,000     |  |
|     |     | 五洋建設 第7回社債間限定同順位特約付             | 100,000,000    | 99,077,000     |  |
|     |     | 大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000    | 91,913,000     |  |
|     |     | 大和ハウス工業 第25回特定社債間限定同順位特約付       | 300,000,000    | 287,379,000    |  |
|     |     | 大和ハウス工業 第26回特定社債間限定同順位特約付       | 100,000,000    | 83,665,000     |  |
|     |     | 大和ハウス工業 第29回特定社債間限定同順位特約付       | 100,000,000    | 99,881,000     |  |
|     |     | 明治ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付      | 200,000,000    | 198,512,000    |  |
|     |     | アサヒグループホールディングス 第16回特定社債間限定同順位  | 300,000,000    | 298,005,000    |  |

|                                    |             |             |  |
|------------------------------------|-------------|-------------|--|
| アサヒグループホールディングス<br>第23回特定社債間限定同順位  | 100,000,000 | 99,429,000  |  |
| キリンホールディングス 第10回<br>社債間限定同順位特約付    | 100,000,000 | 100,386,000 |  |
| コカ・コーラボトラーズジャパン<br>第2回社債間限定同順位特約付  | 100,000,000 | 99,338,000  |  |
| コカ・コーラボトラーズジャパン<br>第3回社債間限定同順位特約付  | 100,000,000 | 97,242,000  |  |
| ニチレイ 第24回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 99,861,000  |  |
| 日本たばこ産業 第13回                       | 100,000,000 | 98,807,000  |  |
| 三越伊勢丹ホールディングス 第6<br>回社債間限定同順位特約付   | 100,000,000 | 99,093,000  |  |
| 野村不動産ホールディングス 第1<br>5回             | 100,000,000 | 96,028,000  |  |
| 森ヒルズリート投資法人 第17回<br>特定投資法人債間限定同順位特 | 200,000,000 | 198,758,000 |  |
| 森ビル 第23回社債間限定同順位<br>特約付            | 100,000,000 | 89,781,000  |  |
| 東急不動産ホールディングス 第2<br>0回社債間限定同順位特約付  | 100,000,000 | 97,572,000  |  |
| 東急不動産ホールディングス 第2<br>1回社債間限定同順位特約付  | 100,000,000 | 87,230,000  |  |
| 東急不動産ホールディングス 第2<br>9回社債間限定同順位特約付  | 100,000,000 | 99,160,000  |  |
| セブン&アイ・ホールディングス<br>第14回社債間限定同順位特約  | 600,000,000 | 597,972,000 |  |
| セブン&アイ・ホールディングス<br>第15回社債間限定同順位特約  | 200,000,000 | 198,104,000 |  |
| 東レ 第30回社債間限定同順位特<br>約付             | 100,000,000 | 99,462,000  |  |
| 東レ 第33回社債間限定同順位特<br>約付             | 100,000,000 | 98,582,000  |  |
| 旭化成 第12回社債間限定同順位<br>特約付            | 100,000,000 | 97,074,000  |  |
| 旭化成 第25回社債間限定同順位<br>特約付            | 100,000,000 | 99,842,000  |  |
| 日本土地建物 第4回社債間限定同<br>順位特約付          | 200,000,000 | 195,816,000 |  |
| 王子ホールディングス 第34回社<br>債間限定同順位特約付     | 100,000,000 | 99,243,000  |  |
| 王子ホールディングス 第42回社<br>債間限定同順位特約付     | 600,000,000 | 595,578,000 |  |
| 日本製紙 第15回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 92,104,000  |  |
| 大王製紙 第21回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 100,006,000 |  |
| レゾナックホールディングス 第3<br>回社債間限定同順位特約付   | 100,000,000 | 99,036,000  |  |
| レゾナックホールディングス 第3<br>5回社債間限定同順位特約付  | 100,000,000 | 93,677,000  |  |
| 住友化学 第52回社債間限定同順<br>位特約付           | 100,000,000 | 88,750,000  |  |

|                                |             |             |  |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 住友化学 第56回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 99,032,000  |  |
| 住友化学 第60回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 84,035,000  |  |
| 住友化学 第61回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 97,798,000  |  |
| 住友化学 第65回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 76,318,000  |  |
| イビデン 第12回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 99,042,000  |  |
| 日本酸素ホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付    | 100,000,000 | 99,682,000  |  |
| 日本酸素ホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付    | 100,000,000 | 98,912,000  |  |
| 三菱瓦斯化学 第24回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 99,985,000  |  |
| 三井化学 第48回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 98,587,000  |  |
| J S R 第9回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 99,169,000  |  |
| 三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 97,420,000  |  |
| 三菱ケミカルホールディングス 第33回社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 192,960,000 |  |
| 三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 84,112,000  |  |
| ダイセル 第17回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 97,024,000  |  |
| UBE株式会社 第21回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 100,912,000 |  |
| 電通 第3回社債間限定同順位特約付              | 100,000,000 | 98,833,000  |  |
| 電通 第6回社債間限定同順位特約付              | 300,000,000 | 294,165,000 |  |
| 武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付         | 300,000,000 | 284,688,000 |  |
| アステラス製薬 第1回無担保社債間限定            | 100,000,000 | 99,767,000  |  |
| アステラス製薬 第3回無担保社債間限定            | 100,000,000 | 99,750,000  |  |
| アステラス製薬 第4回無担保社債間限定            | 100,000,000 | 99,768,000  |  |
| オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 99,708,000  |  |
| オリエンタルランド 第18回社債間限定同順位特約付      | 200,000,000 | 193,200,000 |  |
| ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付            | 200,000,000 | 197,748,000 |  |
| 楽天 第13回社債間限定同順位特約付             | 100,000,000 | 75,164,000  |  |
| 富士フイルムホールディングス 第16回社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 199,604,000 |  |
|                                | 100,000,000 | 95,223,000  |  |

|                                 |             |             |  |
|---------------------------------|-------------|-------------|--|
| 出光興産 第14回社債間限定同順位特約付            |             |             |  |
| JXホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 99,542,000  |  |
| コスモエネルギーホールディングス 第1回社債間限定同順位特約  | 100,000,000 | 99,542,000  |  |
| TOYO TIRE 第4回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 99,430,000  |  |
| ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 99,364,000  |  |
| 住友理工 第7回社債間限定同順位特約付             | 100,000,000 | 99,624,000  |  |
| AGC 第2回社債間限定同順位特約付              | 100,000,000 | 98,004,000  |  |
| 太平洋セメント 第27回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 98,309,000  |  |
| 日本碍子 第7回社債間限定同順位特約付             | 100,000,000 | 96,838,000  |  |
| 新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付            | 300,000,000 | 296,070,000 |  |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位 | 100,000,000 | 99,562,000  |  |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位 | 100,000,000 | 99,873,000  |  |
| 三菱マテリアル 第36回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 98,098,000  |  |
| 住友金属鉱山 第33回社債間限定同順位特約付          | 200,000,000 | 198,272,000 |  |
| 住友金属鉱山 第35回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 98,537,000  |  |
| 住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付          | 200,000,000 | 198,662,000 |  |
| LIXILグループ 第16回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 96,285,000  |  |
| YKK 第13回社債間限定同順位特約付             | 100,000,000 | 99,191,000  |  |
| 住友重機械工業 第8回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 99,237,000  |  |
| 日立建機 第20回社債間限定同順位特約付            | 100,000,000 | 95,429,000  |  |
| 荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 99,501,000  |  |
| ダイキン工業 第30回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 98,425,000  |  |
| タダノ 第7回社債間限定同順位特約付              | 100,000,000 | 96,104,000  |  |
| セガサミーホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付    | 100,000,000 | 96,790,000  |  |
| 日本精工 第55回社債間限定同順位特約付            | 100,000,000 | 99,715,000  |  |
| ジェイテクト 第11回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 99,129,000  |  |
|                                 | 200,000,000 | 206,586,000 |  |

|                                |             |             |  |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付          |             |             |  |
| 日立製作所 第23回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 99,466,000  |  |
| 日本電気 第63回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 96,070,000  |  |
| セイコーエプソン 第15回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 99,542,000  |  |
| パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000 | 199,848,000 |  |
| パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 99,532,000  |  |
| パナソニック 第22回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000 | 197,098,000 |  |
| パナソニック 第23回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000 | 192,550,000 |  |
| パナソニック 第24回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 99,835,000  |  |
| パナソニック 第26回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 101,010,000 |  |
| TDK 第7回社債間限定同順位特約付             | 100,000,000 | 97,081,000  |  |
| デンソー 第17回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 99,951,000  |  |
| 東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 99,068,000  |  |
| 三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 99,171,000  |  |
| 三菱重工業 第38回社債間限定同順位特約付（第2回グリーンボ | 300,000,000 | 297,258,000 |  |
| IHI 第47回社債間限定同順位特約付            | 100,000,000 | 99,708,000  |  |
| IHI 第50回社債間限定同順位特約付            | 100,000,000 | 94,565,000  |  |
| JA三井リース 第14回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 96,725,000  |  |
| 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第9回社債間限定 | 100,000,000 | 99,664,000  |  |
| いすゞ自動車 第31回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 98,850,000  |  |
| いすゞ自動車 第32回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 99,149,000  |  |
| トヨタ自動車 第26回社債間限定同順位特約付         | 700,000,000 | 695,240,000 |  |
| トヨタ自動車 第27回社債間限定同順位特約付         | 300,000,000 | 289,104,000 |  |
| SUBARU 第8回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 100,339,000 |  |
| 楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 88,548,000  |  |
| ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 99,441,000  |  |
|                                | 100,000,000 | 97,479,000  |  |

|                              |             |             |  |
|------------------------------|-------------|-------------|--|
| オリンパス 第27回社債間限定同順位特約付        |             |             |  |
| 大日本印刷 第4回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 97,959,000  |  |
| 大日本印刷 第5回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 97,276,000  |  |
| アシックス 第7回特定社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 100,213,000 |  |
| 丸紅 第113回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 96,237,000  |  |
| 豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 101,064,000 |  |
| 豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000 | 202,402,000 |  |
| 三井物産 第64回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 105,944,000 |  |
| 三井物産 第71回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 102,375,000 |  |
| 日本紙パルプ商事 第7回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 96,449,000  |  |
| 住友商事 第49回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 102,819,000 |  |
| 住友商事 第53回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 99,215,000  |  |
| 住友商事 第61回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 100,086,000 |  |
| 三菱商事 第80回担保提供制限等財務上特約無       | 100,000,000 | 103,937,000 |  |
| 丸井グループ 第43回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 99,670,000  |  |
| クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 99,247,000  |  |
| クレディセゾン 第76回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 96,958,000  |  |
| クレディセゾン 第99回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 99,394,000  |  |
| イオン 第24回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 99,045,000  |  |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ 第7回劣後特約付   | 100,000,000 | 100,746,000 |  |
| りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付  | 100,000,000 | 99,765,000  |  |
| 三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付   | 200,000,000 | 200,162,000 |  |
| みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 106,513,000 |  |
| 三菱東京UFJ銀行 第23回劣後特約付          | 100,000,000 | 109,540,000 |  |
| 三菱東京UFJ銀行 第24回劣後特約付          | 100,000,000 | 106,124,000 |  |
| 三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付     | 100,000,000 | 100,060,000 |  |
|                              | 100,000,000 | 100,275,000 |  |

|                                   |             |             |  |
|-----------------------------------|-------------|-------------|--|
| 三井住友フィナンシャルグループ<br>第4回劣後特約付       |             |             |  |
| 三井住友信託銀行 第18回社債間<br>限定同順位特約付      | 200,000,000 | 198,808,000 |  |
| セブン銀行 第12回社債間限定同<br>順位特約付         | 300,000,000 | 298,338,000 |  |
| みずほ銀行 第7回劣後特約付                    | 100,000,000 | 104,967,000 |  |
| 芙蓉総合リース 第30回社債間限<br>定同順位特約付       | 100,000,000 | 94,855,000  |  |
| みずほリース 第3回社債間限定同<br>順位特約付         | 300,000,000 | 299,388,000 |  |
| みずほリース 第7回社債間限定同<br>順位特約付         | 200,000,000 | 197,690,000 |  |
| みずほリース 第9回社債間限定同<br>順位特約付         | 100,000,000 | 97,930,000  |  |
| N T Tファイナンス 第2回社債間<br>限定同順位特約付    | 100,000,000 | 99,485,000  |  |
| N T Tファイナンス 第16回日本<br>電信電話保証付     | 200,000,000 | 199,106,000 |  |
| N T Tファイナンス 第17回日本<br>電信電話保証付     | 200,000,000 | 198,030,000 |  |
| N T Tファイナンス 第18回日本<br>電信電話保証付     | 600,000,000 | 584,034,000 |  |
| N T Tファイナンス 第25回社債<br>間限定同順位特約付   | 100,000,000 | 99,259,000  |  |
| N T Tファイナンス 第26回社債<br>間限定同順位特約付   | 100,000,000 | 98,081,000  |  |
| N T Tファイナンス 第30回社債<br>間限定同順位特約付   | 100,000,000 | 101,119,000 |  |
| 日産フィナンシャルサービス 第5<br>6回社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 198,536,000 |  |
| 東京センチュリー 第28回社債間<br>限定同順位特約付      | 100,000,000 | 96,828,000  |  |
| 東京センチュリー 第33回社債間<br>限定同順位特約付      | 100,000,000 | 98,446,000  |  |
| 東京センチュリー 第34回社債間<br>限定同順位特約付      | 100,000,000 | 98,000,000  |  |
| ホンダファイナンス 第63回社債<br>間限定同順位特約付     | 100,000,000 | 99,767,000  |  |
| ホンダファイナンス 第69回社債<br>間限定同順位特約付     | 200,000,000 | 198,476,000 |  |
| ホンダファイナンス 第83回社債<br>間限定同順位特約付     | 100,000,000 | 99,499,000  |  |
| S B Iホールディングス 第26回<br>社債間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 198,162,000 |  |
| トヨタファイナンス 第81回社債<br>間限定同順位特約付     | 100,000,000 | 99,170,000  |  |
| トヨタファイナンス 第94回社債<br>間限定同順位特約付     | 100,000,000 | 99,676,000  |  |
| トヨタファイナンス 第96回社債<br>間限定同順位特約付     | 800,000,000 | 794,368,000 |  |
| リコーリース 第28回社債間限定<br>同順位特約付        | 100,000,000 | 99,235,000  |  |
|                                   |             |             |  |

|                                        |             |             |  |
|----------------------------------------|-------------|-------------|--|
| イオンフィナンシャルサービス 第<br>1 7 回社債間限定同順位特約付   | 100,000,000 | 99,254,000  |  |
| イオンフィナンシャルサービス 第<br>2 1 回社債間限定同順位特約付   | 200,000,000 | 199,674,000 |  |
| アコム 第7 8 回特定社債間限定同<br>順位特約付            | 100,000,000 | 99,429,000  |  |
| オリエントコーポレーション 第3<br>0 回社債間限定同順位特約付     | 100,000,000 | 94,170,000  |  |
| オリエントコーポレーション 第3<br>2 回社債間限定同順位特約付     | 200,000,000 | 187,894,000 |  |
| 日立キャピタル 第6 1 回社債間限<br>定同順位特約付          | 100,000,000 | 99,585,000  |  |
| 日立キャピタル 第8 0 回社債間限<br>定同順位特約付          | 100,000,000 | 96,864,000  |  |
| オリックス 第1 8 9 回社債間限定<br>同順位特約付          | 100,000,000 | 99,823,000  |  |
| オリックス 第2 0 2 回社債間限定<br>同順位特約付          | 100,000,000 | 95,492,000  |  |
| 三井住友ファイナンス&リース 第<br>2 7 回社債間限定同順位特約付   | 100,000,000 | 99,397,000  |  |
| 三菱UFJリース 第5 2 回社債間<br>限定同順位特約付         | 400,000,000 | 397,288,000 |  |
| 三菱UFJリース 第5 6 回社債間<br>限定同順位特約付         | 100,000,000 | 99,323,000  |  |
| 三菱UFJリース 第7 6 回社債間<br>限定同順位特約付         | 300,000,000 | 291,615,000 |  |
| 大和証券グループ本社 第2 3 回社<br>債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 100,553,000 |  |
| 大和証券グループ本社 第3 6 回社<br>債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 99,122,000  |  |
| 大和証券グループ本社 第3 9 回社<br>債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 99,775,000  |  |
| 三井住友海上火災保険 第7 回社債<br>間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 99,205,000  |  |
| N E C キャピタルソリューション<br>第1 9 回社債間限定同順位特約 | 100,000,000 | 99,099,000  |  |
| 三井不動産 第6 0 回社債間限定同<br>順位特約付            | 100,000,000 | 98,704,000  |  |
| 三井不動産 第7 1 回社債間限定同<br>順位特約付            | 200,000,000 | 194,472,000 |  |
| 三井不動産 第8 3 回社債間限定同<br>順位特約付            | 300,000,000 | 292,317,000 |  |
| 三井不動産 第8 4 回社債間限定同<br>順位特約付            | 100,000,000 | 99,250,000  |  |
| 三菱地所 第9 3 回担保提供制限等<br>財務上特約無           | 200,000,000 | 216,692,000 |  |
| 三菱地所 第1 2 0 回担保提供制限<br>等財務上特約無         | 100,000,000 | 99,235,000  |  |
| 三菱地所 第1 2 9 回担保提供制限<br>等財務上特約無         | 100,000,000 | 99,392,000  |  |
| 三菱地所 第1 3 5 回担保提供制限<br>等財務上特約無         | 100,000,000 | 95,664,000  |  |
|                                        | 100,000,000 | 99,730,000  |  |



|                                |             |             |  |
|--------------------------------|-------------|-------------|--|
| 東京建物 第25回社債間限定同順位特約付           |             |             |  |
| 東京建物 第34回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 96,297,000  |  |
| ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 86,878,000  |  |
| 京阪神ビルディング 第13回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 91,950,000  |  |
| 住友不動産 第109回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000 | 191,936,000 |  |
| イオンモール 第22回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 96,546,000  |  |
| イオンモール 第23回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 84,252,000  |  |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 第15回社債間限定同順位特約付   | 100,000,000 | 102,847,000 |  |
| 日本ビルファンド投資法人 第17回              | 100,000,000 | 88,753,000  |  |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 第4回特定投資法人債間限定 | 100,000,000 | 103,243,000 |  |
| 日本プライムリアルティ投資法人 第27回特定投資法人債間限定 | 100,000,000 | 94,078,000  |  |
| グローバル・ワン不動産投資法人 第9回            | 100,000,000 | 99,375,000  |  |
| 野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限 | 100,000,000 | 108,314,000 |  |
| 東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 102,267,000 |  |
| 東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000 | 194,778,000 |  |
| 小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付          | 200,000,000 | 204,430,000 |  |
| 小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付          | 100,000,000 | 92,023,000  |  |
| 京王電鉄 第38回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 99,286,000  |  |
| 京成電鉄 第63回社債間限定同順位特約付           | 100,000,000 | 97,473,000  |  |
| 東日本旅客鉄道 第47回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 105,364,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付        | 200,000,000 | 216,660,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 107,503,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 108,903,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第86回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 106,638,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 98,166,000  |  |
| 東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 91,977,000  |  |
|                                | 100,000,000 | 99,432,000  |  |

|                               |             |             |  |
|-------------------------------|-------------|-------------|--|
| 東日本旅客鉄道 第119回社債間<br>限定同順位特約付  |             |             |  |
| 東日本旅客鉄道 第133回社債間<br>限定同順位特約付  | 100,000,000 | 76,948,000  |  |
| 東日本旅客鉄道 第142回社債間<br>限定同順位特約付  | 200,000,000 | 104,686,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第145回社債間<br>限定同順位特約付  | 200,000,000 | 128,788,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第147回社債間<br>限定同順位特約付  | 100,000,000 | 97,368,000  |  |
| 東日本旅客鉄道 第151回社債間<br>限定同順位特約付  | 100,000,000 | 56,838,000  |  |
| 東日本旅客鉄道 第153回社債間<br>限定同順位特約付  | 100,000,000 | 96,916,000  |  |
| 東日本旅客鉄道 第164回社債間<br>限定同順位特約付  | 100,000,000 | 96,245,000  |  |
| 東日本旅客鉄道 第165回社債間<br>限定同順位特約付  | 100,000,000 | 84,498,000  |  |
| 東日本旅客鉄道 第167回社債間<br>限定同順位特約付  | 200,000,000 | 136,756,000 |  |
| 東日本旅客鉄道 第184回社債間<br>限定同順位特約付  | 100,000,000 | 99,811,000  |  |
| 西日本旅客鉄道 第13回社債間限<br>定同順位特約付   | 100,000,000 | 105,717,000 |  |
| 西日本旅客鉄道 第15回社債間限<br>定同順位特約付   | 300,000,000 | 320,037,000 |  |
| 西日本旅客鉄道 第53回社債間限<br>定同順位特約付   | 100,000,000 | 77,580,000  |  |
| 西日本旅客鉄道 第60回社債間限<br>定同順位特約付   | 200,000,000 | 194,436,000 |  |
| 西日本旅客鉄道 第65回社債間限<br>定同順位特約付   | 200,000,000 | 193,704,000 |  |
| 西日本旅客鉄道 第66回社債間限<br>定同順位特約付   | 200,000,000 | 172,152,000 |  |
| 西日本旅客鉄道 第77回社債間限<br>定同順位特約付   | 100,000,000 | 67,927,000  |  |
| 東海旅客鉄道 第51回社債間限定<br>同順位特約付    | 200,000,000 | 218,216,000 |  |
| 東海旅客鉄道 第70回社債間限定<br>同順位特約付    | 100,000,000 | 103,186,000 |  |
| 東海旅客鉄道 第73回社債間限定<br>同順位特約付    | 300,000,000 | 295,461,000 |  |
| 東海旅客鉄道 第74回社債間限定<br>同順位特約付    | 100,000,000 | 96,622,000  |  |
| 東京地下鉄 第22回                    | 100,000,000 | 99,224,000  |  |
| 東京地下鉄 第23回                    | 100,000,000 | 91,441,000  |  |
| 東京地下鉄 第24回                    | 100,000,000 | 82,934,000  |  |
| 東京地下鉄 第44回                    | 100,000,000 | 59,300,000  |  |
| 東京地下鉄 第49回                    | 100,000,000 | 84,590,000  |  |
| 西武ホールディングス 第1回社債<br>間限定同順位特約付 | 200,000,000 | 191,672,000 |  |
|                               | 100,000,000 | 98,688,000  |  |

|                             |             |             |  |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 西日本鉄道 第４５回社債間限定同順位特約付       |             |             |  |
| 阪急阪神ホールディングス 第４７回           | 400,000,000 | 411,408,000 |  |
| 阪急阪神ホールディングス 第４９回           | 100,000,000 | 93,414,000  |  |
| 名古屋鉄道 第５０回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 101,172,000 |  |
| 日本通運 第１１回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 99,477,000  |  |
| 日本通運 第１２回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 92,513,000  |  |
| 日立物流 第４回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000 | 99,180,000  |  |
| 日本郵船 第３２回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 106,589,000 |  |
| 横浜高速鉄道 第２回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 99,646,000  |  |
| 九州旅客鉄道 第２回社債間限定同順位特約付       | 200,000,000 | 154,060,000 |  |
| 九州旅客鉄道 第４回社債間限定同順位特約付       | 100,000,000 | 84,439,000  |  |
| 日本航空 第１２回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 97,794,000  |  |
| ANAホールディングス 第３２回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 88,636,000  |  |
| KDDI 第２５回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 98,477,000  |  |
| KDDI 第３０回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000 | 99,739,000  |  |
| ソフトバンク 第１１回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 99,167,000  |  |
| ソフトバンク 第１２回社債間限定同順位特約付      | 200,000,000 | 194,824,000 |  |
| ソフトバンク 第１４回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 98,644,000  |  |
| ソフトバンク 第１６回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 93,191,000  |  |
| ソフトバンク 第２３回社債間限定同順位特約付      | 100,000,000 | 97,202,000  |  |
| 東京電力 第５４８回                  | 100,000,000 | 102,808,000 |  |
| 東京電力 第５６０回                  | 100,000,000 | 101,679,000 |  |
| 中部電力 第５２４回                  | 100,000,000 | 99,707,000  |  |
| 中部電力 第５３０回                  | 200,000,000 | 195,468,000 |  |
| 中部電力 第５５９回                  | 100,000,000 | 90,825,000  |  |
| 中部電力 第５６０回                  | 100,000,000 | 91,570,000  |  |
| 関西電力 第５０９回                  | 100,000,000 | 99,804,000  |  |
| 関西電力 第５１１回                  | 300,000,000 | 298,158,000 |  |
| 関西電力 第５２０回                  | 100,000,000 | 88,215,000  |  |
| 関西電力 第５２２回                  | 200,000,000 | 197,780,000 |  |
| 関西電力 第５３５回                  | 200,000,000 | 198,982,000 |  |

|                      |             |             |  |
|----------------------|-------------|-------------|--|
| 関西電力 第536回           | 100,000,000 | 97,038,000  |  |
| 関西電力 第556回           | 100,000,000 | 97,583,000  |  |
| 関西電力 第557回           | 100,000,000 | 94,082,000  |  |
| 中国電力 第394回           | 100,000,000 | 91,021,000  |  |
| 中国電力 第400回           | 100,000,000 | 99,242,000  |  |
| 中国電力 第406回           | 100,000,000 | 89,067,000  |  |
| 中国電力 第416回           | 100,000,000 | 98,103,000  |  |
| 中国電力 第422回           | 600,000,000 | 583,926,000 |  |
| 中国電力 第425回           | 100,000,000 | 97,286,000  |  |
| 中国電力 第448回           | 100,000,000 | 98,280,000  |  |
| 北陸電力 第307回           | 100,000,000 | 101,427,000 |  |
| 北陸電力 第312回           | 100,000,000 | 101,569,000 |  |
| 北陸電力 第322回           | 100,000,000 | 99,503,000  |  |
| 北陸電力 第326回           | 200,000,000 | 177,388,000 |  |
| 北陸電力 第330回           | 100,000,000 | 97,978,000  |  |
| 北陸電力 第339回           | 100,000,000 | 90,629,000  |  |
| 東北電力 第481回           | 200,000,000 | 201,314,000 |  |
| 東北電力 第484回           | 100,000,000 | 92,270,000  |  |
| 東北電力 第491回           | 100,000,000 | 99,819,000  |  |
| 東北電力 第508回           | 100,000,000 | 98,655,000  |  |
| 東北電力 第521回           | 300,000,000 | 293,388,000 |  |
| 東北電力 第529回           | 200,000,000 | 198,404,000 |  |
| 東北電力 第560回           | 200,000,000 | 195,152,000 |  |
| 四国電力 第293回           | 100,000,000 | 91,883,000  |  |
| 四国電力 第321回           | 100,000,000 | 75,799,000  |  |
| 四国電力 第328回           | 100,000,000 | 98,979,000  |  |
| 九州電力 第449回           | 200,000,000 | 199,556,000 |  |
| 九州電力 第451回           | 100,000,000 | 99,772,000  |  |
| 九州電力 第476回           | 100,000,000 | 98,384,000  |  |
| 九州電力 第478回           | 100,000,000 | 88,581,000  |  |
| 九州電力 第481回           | 300,000,000 | 293,115,000 |  |
| 九州電力 第484回           | 200,000,000 | 195,122,000 |  |
| 九州電力 第493回           | 300,000,000 | 297,615,000 |  |
| 北海道電力 第323回          | 300,000,000 | 308,910,000 |  |
| 北海道電力 第325回          | 130,000,000 | 133,443,700 |  |
| 北海道電力 第338回          | 100,000,000 | 92,139,000  |  |
| 北海道電力 第350回          | 100,000,000 | 89,041,000  |  |
| 北海道電力 第385回          | 100,000,000 | 98,995,000  |  |
| 沖縄電力 第32回            | 100,000,000 | 99,791,000  |  |
| 電源開発 第50回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 99,586,000  |  |
| 電源開発 第55回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000 | 98,918,000  |  |
|                      |             |             |  |

|    |                                 |                |                |
|----|---------------------------------|----------------|----------------|
| 小計 | 電源開発 第 5 9 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 98,768,000     |
|    | 電源開発 第 7 3 回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000    | 191,710,000    |
|    | 電源開発 第 8 6 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 98,374,000     |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 6 回               | 100,000,000    | 100,281,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 1 1 回             | 300,000,000    | 299,520,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 1 5 回             | 300,000,000    | 296,121,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 2 8 回             | 100,000,000    | 100,149,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 3 2 回             | 300,000,000    | 291,045,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 3 5 回             | 100,000,000    | 100,748,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 3 8 回             | 400,000,000    | 400,244,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 4 0 回             | 400,000,000    | 387,988,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 4 5 回             | 300,000,000    | 292,362,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 5 0 回             | 100,000,000    | 97,415,000     |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 5 1 回             | 200,000,000    | 182,572,000    |
|    | 東京電力パワーグリッド 第 5 4 回             | 100,000,000    | 99,172,000     |
|    | J E R A 第 3 回無担保社債間限定同順位特約付     | 100,000,000    | 98,925,000     |
|    | J E R A 第 1 7 回無担保社債間限定同順位特約付   | 200,000,000    | 200,284,000    |
|    | 東京瓦斯 第 2 8 回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000    | 212,126,000    |
|    | 東京瓦斯 第 3 7 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 106,785,000    |
|    | 東京瓦斯 第 3 8 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 104,133,000    |
|    | 東京瓦斯 第 5 5 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 82,764,000     |
|    | 大阪瓦斯 第 3 6 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 72,960,000     |
|    | 大阪瓦斯 第 4 3 回社債間限定同順位特約付         | 200,000,000    | 148,940,000    |
|    | 大阪瓦斯 第 5 1 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 98,215,000     |
|    | 東邦瓦斯 第 4 4 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 85,351,000     |
|    | 北海道瓦斯 第 2 3 回社債間限定同順位特約付        | 100,000,000    | 91,438,000     |
|    | 広島ガス 第 1 3 回社債間限定同順位特約付         | 100,000,000    | 98,558,000     |
|    | 西部ガスホールディングス 第 2 1 回社債間限定同順位特約付 | 100,000,000    | 99,966,000     |
|    | ファーストリテイリング 第 7 回特定社債間限定同順位特約付  | 100,000,000    | 99,135,000     |
|    | ファーストリテイリング 第 8 回特定社債間限定同順位特約付  | 100,000,000    | 91,309,000     |
|    | 銘柄数：363                         | 51,430,000,000 | 50,000,033,700 |
|    | 組入時価比率：4.6%                     |                | 4.6%           |

|  |    |  |                   |  |
|--|----|--|-------------------|--|
|  | 合計 |  | 50,000,033,700    |  |
|  | 合計 |  | 1,090,183,346,718 |  |

(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)

(2024年 2月19日現在)

|                   |                   |
|-------------------|-------------------|
| <b>資産の部</b>       |                   |
| 流動資産              |                   |
| 預金                | 8,716,525,552     |
| コール・ローン           | 3,729,378,307     |
| 株式                | 2,064,165,718,165 |
| 投資証券              | 40,505,803,641    |
| 派生商品評価勘定          | 685,014,830       |
| 未収入金              | 12,836,678        |
| 未収配当金             | 1,826,825,103     |
| 差入委託証拠金           | 17,427,317,907    |
| 流動資産合計            | 2,137,069,420,183 |
| 資産合計              |                   |
| 2,137,069,420,183 |                   |
| <b>負債の部</b>       |                   |
| 流動負債              |                   |
| 派生商品評価勘定          | 18,778,193        |
| 未払解約金             | 1,119,743,340     |
| 未払利息              | 393               |
| その他未払費用           | 4,467,700         |
| 流動負債合計            | 1,142,989,626     |
| 負債合計              |                   |
| 1,142,989,626     |                   |
| <b>純資産の部</b>      |                   |
| 元本等               |                   |
| 元本                | 334,396,043,485   |
| 剰余金               |                   |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△）   | 1,801,530,387,072 |
| 元本等合計             | 2,135,926,430,557 |
| 純資産合計             | 2,135,926,430,557 |
| 負債純資産合計           | 2,137,069,420,183 |

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

| 2024年 2月19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                  | 6.3874円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (63,874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 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19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>                          |
| 3.金融商品に係るリスク管理体制               | <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<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っております。</p> <p>○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っております。</p> <p>○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っております。</p> |

(2)金融商品の時価等に関する事項

| 2024年 2月19日現在      |                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | <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>                                                                                                                                                                                                                          |
| 2. 時価の算定方法         | <p>株式<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>新株予約権証券<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>投資証券<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>派生商品評価勘定<br/>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。</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

| 2024年 2月19日現在                    |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 期首                               | 2023年 2月21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 | 311,898,207,724円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 50,863,212,884円  |
| 同期中における一部解約元本額                   | 28,365,377,123円  |

|                                                 |                  |
|-------------------------------------------------|------------------|
| 期末元本額                                           | 334,396,043,485円 |
| 期末元本額の内訳*                                       |                  |
| バランスセレクト30                                      | 21,606,104円      |
| バランスセレクト50                                      | 66,787,409円      |
| バランスセレクト70                                      | 94,627,045円      |
| 野村外国株式インデックスファンド                                | 459,559,078円     |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)                              | 2,249,070,901円   |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)                              | 3,147,233,644円   |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)                              | 4,851,353,170円   |
| 野村資産設計ファンド2015                                  | 6,567,513円       |
| 野村資産設計ファンド2020                                  | 7,233,292円       |
| 野村資産設計ファンド2025                                  | 11,244,287円      |
| 野村資産設計ファンド2030                                  | 19,312,952円      |
| 野村資産設計ファンド2035                                  | 19,523,766円      |
| 野村資産設計ファンド2040                                  | 34,945,622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)                    | 39,496,926,426円  |
| のむラップ・ファンド(保守型)                                 | 1,215,485,817円   |
| のむラップ・ファンド(普通型)                                 | 13,758,871,242円  |
| のむラップ・ファンド(積極型)                                 | 16,426,242,898円  |
| 野村資産設計ファンド2045                                  | 8,030,614円       |
| 野村インデックスファンド・外国株式                               | 8,970,274,651円   |
| マイ・ロード                                          | 1,302,649,538円   |
| ネクストコア                                          | 12,863,182円      |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス                          | 164,969,177円     |
| 野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)                     | 3,773,085,922円   |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)                            | 365,546,707円     |
| 野村資産設計ファンド2050                                  | 8,987,517円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型                | 2,054,236円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型                | 1,362,709円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型                | 1,166,835円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型                | 1,158,022円       |
| のむラップ・ファンド(やや保守型)                               | 296,982,538円     |
| のむラップ・ファンド(やや積極型)                               | 1,551,093,857円   |
| インデックス・ブレンド(タイプI)                               | 2,805,446円       |
| インデックス・ブレンド(タイプII)                              | 4,003,358円       |
| インデックス・ブレンド(タイプIII)                             | 37,757,130円      |
| インデックス・ブレンド(タイプIV)                              | 16,273,095円      |
| インデックス・ブレンド(タイプV)                               | 56,577,491円      |
| 野村6資産均等バランス                                     | 1,949,537,093円   |
| 野村つみたて外国株投信                                     | 17,774,109,029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)             | 5,276,624,995円   |
| 世界6資産分散ファンド                                     | 40,008,155円      |
| 野村資産設計ファンド2060                                  | 7,626,876円       |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信                                  | 2,601,673,584円   |
| はじめてのNISA・全世界株式インデックス(オール・カンントリー)               | 613,457,479円     |
| NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSA I指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 6,886,852,596円   |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式                          | 6,775,783,018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)                | 78,630,742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)                | 47,805,221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)                | 317,174,754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)                | 249,319,396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)                | 712,293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)              | 2,544,923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)                | 201,264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)               | 92,084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)               | 3,209,753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)                     | 270,751,032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)                  | 2,571,647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)              | 20,072,983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)              | 54,139,553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)              | 1,752,540,651円   |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)                         | 10,773,902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)              | 1,105,339,249円   |
| 野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)  | 11,157,124,379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)  | 750,330円         |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け)                            | 1,115,384円       |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け)                            | 7,698,818円       |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け)                            | 8,477,143円       |
| 野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I(確定拠出年金向け)        | 106,155,190,250円 |



|                                  |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| マイバランス３０（確定拠出年金向け）               | 1,716,425,683円  |
| マイバランス５０（確定拠出年金向け）               | 7,085,912,399円  |
| マイバランス７０（確定拠出年金向け）               | 7,712,739,588円  |
| マイバランスDC３０                       | 752,195,103円    |
| マイバランスDC５０                       | 1,860,297,600円  |
| マイバランスDC７０                       | 1,859,690,877円  |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I | 48,121,509,635円 |
| 野村DC運用戦略ファンド                     | 645,563,053円    |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）               | 41,323,054円     |
| マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）            | 562,603,232円    |
| マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）            | 473,906,048円    |
| マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）            | 512,860,048円    |
| 野村世界６資産分散投信（DC）安定コース             | 21,387,962円     |
| 野村世界６資産分散投信（DC）インカムコース           | 10,634,652円     |
| 野村世界６資産分散投信（DC）成長コース             | 66,590,902円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０３０      | 12,434,070円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０４０      | 13,260,664円     |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０５０      | 9,897,865円      |
| マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）            | 316,488,479円    |
| マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）            | 246,643,632円    |
| マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）            | 175,335,224円    |
| マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）            | 241,029,938円    |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）２０６０      | 8,073,771円      |
| マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）            | 93,963,195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）    | 84,906,438円     |
| みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金DC向け）      | 64,612,576円     |
| 野村DCバランスファンド（年金運用戦略タイプ）          | 49,573,347円     |
| マイターゲット２０７０（確定拠出年金向け）            | 42,683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(2024年2月19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         | 245,000 | 29.15  | 7,141,750.00  |    |
|    |     | HALLIBURTON CO          | 218,000 | 35.31  | 7,697,580.00  |    |
|    |     | SCHLUMBERGER LTD        | 342,000 | 48.57  | 16,610,940.00 |    |
|    |     | APA CORPORATION         | 72,000  | 31.57  | 2,273,040.00  |    |
|    |     | CHENIERE ENERGY INC     | 58,300  | 160.37 | 9,349,571.00  |    |
|    |     | CHESAPEAKE ENERGY CORP  | 26,100  | 78.73  | 2,054,853.00  |    |
|    |     | CHEVRON CORP            | 434,200 | 154.63 | 67,140,346.00 |    |
|    |     | CONOCOPHILLIPS          | 286,600 | 110.57 | 31,689,362.00 |    |
|    |     | COTERRA ENERGY INC      | 177,000 | 24.68  | 4,368,360.00  |    |
|    |     | DEVON ENERGY CORP       | 154,000 | 43.46  | 6,692,840.00  |    |
|    |     | DIAMONDBACK ENERGY INC  | 40,900  | 179.42 | 7,338,278.00  |    |
|    |     | EOG RESOURCES INC       | 138,800 | 113.56 | 15,762,128.00 |    |
|    |     | EQT CORP                | 94,000  | 34.70  | 3,261,800.00  |    |
|    |     | EXXON MOBIL CORP        | 958,800 | 103.73 | 99,456,324.00 |    |
|    |     | HESS CORP               | 66,900  | 148.43 | 9,929,967.00  |    |
|    |     | HF SINCLAIR CORP        | 40,000  | 60.11  | 2,404,400.00  |    |
|    |     | KINDER MORGAN INC       | 479,000 | 17.11  | 8,195,690.00  |    |
|    |     | MARATHON OIL CORP       | 147,000 | 23.38  | 3,436,860.00  |    |
|    |     | MARATHON PETROLEUM CORP | 96,400  | 170.01 | 16,388,964.00 |    |
|    |     | OCCIDENTAL PETE CORP    | 161,000 | 60.52  | 9,743,720.00  |    |

|                                   |         |          |               |
|-----------------------------------|---------|----------|---------------|
| ONEOK INC                         | 140,900 | 71.99    | 10,143,391.00 |
| OVINTIV INC                       | 62,000  | 44.83    | 2,779,460.00  |
| PHILLIPS 66                       | 107,200 | 143.81   | 15,416,432.00 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO      | 55,200  | 231.57   | 12,782,664.00 |
| TARGA RESOURCES CORP              | 50,800  | 96.94    | 4,924,552.00  |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP           | 1,480   | 1,511.81 | 2,237,478.80  |
| VALERO ENERGY CORP                | 85,500  | 139.54   | 11,930,670.00 |
| WILLIAMS COS                      | 288,000 | 34.31    | 9,881,280.00  |
| AIR PRODUCTS                      | 53,600  | 226.85   | 12,159,160.00 |
| ALBEMARLE CORP                    | 27,500  | 122.59   | 3,371,225.00  |
| CELANESE CORP-SERIES A            | 24,600  | 151.06   | 3,716,076.00  |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC        | 46,300  | 77.70    | 3,597,510.00  |
| CORTEVA INC                       | 169,000 | 54.80    | 9,261,200.00  |
| DOW INC                           | 166,000 | 55.48    | 9,209,680.00  |
| DUPONT DE NEMOURS INC             | 108,900 | 68.45    | 7,454,205.00  |
| EASTMAN CHEMICAL CO.              | 27,200  | 85.19    | 2,317,168.00  |
| ECOLAB INC                        | 61,900  | 215.38   | 13,332,022.00 |
| FMC CORP                          | 28,400  | 52.34    | 1,486,456.00  |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 61,800  | 81.19    | 5,017,542.00  |
| LINDE PLC                         | 116,800 | 431.63   | 50,414,384.00 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A          | 60,800  | 97.70    | 5,940,160.00  |
| MOSAIC CO/THE                     | 76,000  | 30.55    | 2,321,800.00  |
| PPG INDUSTRIES                    | 56,500  | 141.91   | 8,017,915.00  |
| RPM INTERNATIONAL INC             | 30,300  | 108.44   | 3,285,732.00  |
| SHERWIN-WILLIAMS                  | 58,800  | 309.08   | 18,173,904.00 |
| WESTLAKE CORPORATION              | 9,400   | 144.15   | 1,355,010.00  |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS         | 14,800  | 539.87   | 7,990,076.00  |
| VULCAN MATERIALS CO               | 31,300  | 255.15   | 7,986,195.00  |
| AMCOR PLC                         | 335,000 | 9.04     | 3,028,400.00  |
| AVERY DENNISON CORP               | 19,200  | 208.83   | 4,009,536.00  |
| BALL CORP                         | 73,000  | 62.09    | 4,532,570.00  |
| CROWN HOLDINGS INC                | 30,100  | 72.26    | 2,175,026.00  |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)        | 79,000  | 35.80    | 2,828,200.00  |
| PACKAGING CORP OP AMERICA         | 22,000  | 167.98   | 3,695,560.00  |
| WESTROCK CO                       | 63,000  | 43.71    | 2,753,730.00  |
| CLEVELAND-CLIFFS INC              | 115,000 | 19.87    | 2,285,050.00  |
| FREEPORT-MCMORAN INC              | 342,000 | 38.83    | 13,279,860.00 |
| NEWMONT CORP                      | 273,000 | 33.43    | 9,126,390.00  |
| NUCOR CORP                        | 58,900  | 185.58   | 10,930,662.00 |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM         | 13,700  | 326.43   | 4,472,091.00  |
| STEEL DYNAMICS                    | 38,500  | 123.34   | 4,748,590.00  |
| AXON ENTERPRISE INC               | 17,200  | 269.80   | 4,640,560.00  |
| BOEING CO                         | 137,200 | 203.89   | 27,973,708.00 |

|                                    |         |          |               |
|------------------------------------|---------|----------|---------------|
| GENERAL DYNAMICS                   | 55,100  | 269.44   | 14,846,144.00 |
| HEICO CORP                         | 10,700  | 194.01   | 2,075,907.00  |
| HEICO CORP-CLASS A                 | 17,000  | 157.19   | 2,672,230.00  |
| HOWMET AEROSPACE INC               | 94,000  | 62.82    | 5,905,080.00  |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE       | 9,500   | 285.09   | 2,708,355.00  |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC          | 45,800  | 211.98   | 9,708,684.00  |
| LOCKHEED MARTIN                    | 53,700  | 424.07   | 22,772,559.00 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP              | 34,600  | 450.96   | 15,603,216.00 |
| RTX CORP                           | 348,400 | 91.01    | 31,707,884.00 |
| TEXTRON INC                        | 46,400  | 85.69    | 3,976,016.00  |
| TRANSDIGM GROUP INC                | 13,310  | 1,146.39 | 15,258,450.90 |
| ALLEGION PLC                       | 21,900  | 132.42   | 2,899,998.00  |
| BUILDERS FIRSTSOURCE INC           | 30,900  | 183.79   | 5,679,111.00  |
| CARLISLE COS INC                   | 12,300  | 341.92   | 4,205,616.00  |
| CARRIER GLOBAL CORP                | 198,000 | 54.00    | 10,692,000.00 |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC     | 31,000  | 79.31    | 2,458,610.00  |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 161,000 | 56.86    | 9,154,460.00  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC           | 7,700   | 448.41   | 3,452,757.00  |
| MASCO CORP                         | 54,000  | 73.16    | 3,950,640.00  |
| OWENS CORNING INC                  | 21,100  | 139.95   | 2,952,945.00  |
| SMITH (A.O.) CORP                  | 31,200  | 80.09    | 2,498,808.00  |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC             | 54,600  | 272.17   | 14,860,482.00 |
| AECOM                              | 31,500  | 89.19    | 2,809,485.00  |
| QUANTA SERVICES INC                | 34,900  | 211.44   | 7,379,256.00  |
| AMETEK INC                         | 55,300  | 173.89   | 9,616,117.00  |
| EATON CORP PLC                     | 95,000  | 277.52   | 26,364,400.00 |
| EMERSON ELEC                       | 136,500 | 106.15   | 14,489,475.00 |
| HUBBELL INC                        | 13,000  | 358.88   | 4,665,440.00  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC            | 27,300  | 279.72   | 7,636,356.00  |
| VERTIV HOLDINGS CO                 | 82,000  | 62.97    | 5,163,540.00  |
| 3M CORP                            | 133,100 | 91.25    | 12,145,375.00 |
| GENERAL ELECTRIC CO                | 260,500 | 149.16   | 38,856,180.00 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC        | 158,900 | 197.17   | 31,330,313.00 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD         | 38,000  | 41.32    | 1,570,160.00  |
| CATERPILLAR INC DEL                | 122,100 | 321.91   | 39,305,211.00 |
| CNH INDUSTRIAL NV                  | 240,000 | 12.15    | 2,916,000.00  |
| CUMMINS INC                        | 33,600  | 266.48   | 8,953,728.00  |
| DEERE & COMPANY                    | 65,800  | 360.68   | 23,732,744.00 |
| DOVER CORP                         | 33,100  | 161.46   | 5,344,326.00  |
| FORTIVE CORP                       | 83,200  | 84.32    | 7,015,424.00  |
| GRACO INC                          | 39,900  | 88.15    | 3,517,185.00  |
| IDEX CORP                          | 18,400  | 227.47   | 4,185,448.00  |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC            | 72,100  | 253.92   | 18,307,632.00 |

|                                             |         |        |               |  |
|---------------------------------------------|---------|--------|---------------|--|
|                                             |         |        |               |  |
| INGERSOLL-RAND INC                          | 96,400  | 89.47  | 8,624,908.00  |  |
| NORDSON CORP                                | 12,200  | 264.07 | 3,221,654.00  |  |
| OTIS WORLDWIDE CORP                         | 98,100  | 91.24  | 8,950,644.00  |  |
| PACCAR                                      | 125,000 | 107.77 | 13,471,250.00 |  |
| PARKER HANNIFIN CORP                        | 30,700  | 520.06 | 15,965,842.00 |  |
| PENTAIR PLC                                 | 41,000  | 74.92  | 3,071,720.00  |  |
| SNAP-ON INC                                 | 12,400  | 267.24 | 3,313,776.00  |  |
| STANLEY BLACK & DECKER INC                  | 35,400  | 88.35  | 3,127,590.00  |  |
| TORO CO                                     | 25,200  | 93.76  | 2,362,752.00  |  |
| WABTEC CORP                                 | 43,700  | 134.28 | 5,868,036.00  |  |
| XYLEM INC                                   | 56,500  | 123.79 | 6,994,135.00  |  |
| AERCAP HOLDINGS NV                          | 48,600  | 77.64  | 3,773,304.00  |  |
| FASTENAL CO                                 | 138,300 | 70.24  | 9,714,192.00  |  |
| FERGUSON PLC                                | 48,500  | 198.99 | 9,651,015.00  |  |
| GRAINGER(W.W.) INC                          | 10,890  | 935.80 | 10,190,862.00 |  |
| UNITED RENTALS INC                          | 16,500  | 650.31 | 10,730,115.00 |  |
| WATSCO INC                                  | 8,000   | 381.46 | 3,051,680.00  |  |
| CINTAS CORP                                 | 21,900  | 614.66 | 13,461,054.00 |  |
| COPART INC                                  | 204,000 | 48.96  | 9,987,840.00  |  |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A                  | 53,100  | 180.43 | 9,580,833.00  |  |
| ROLLINS INC                                 | 67,000  | 41.05  | 2,750,350.00  |  |
| VERALTO CORP                                | 56,700  | 86.09  | 4,881,303.00  |  |
| WASTE CONNECTIONS INC                       | 61,100  | 167.87 | 10,256,857.00 |  |
| WASTE MANAGEMENT INC                        | 97,500  | 201.54 | 19,650,150.00 |  |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC                  | 29,100  | 72.25  | 2,102,475.00  |  |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH<br>INC        | 34,800  | 124.16 | 4,320,768.00  |  |
| FEDEX CORPORATION                           | 57,600  | 237.59 | 13,685,184.00 |  |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B                  | 173,100 | 148.41 | 25,689,771.00 |  |
| DELTA AIR LINES INC                         | 36,000  | 40.12  | 1,444,320.00  |  |
| SOUTHWEST AIRLINES                          | 34,000  | 33.93  | 1,153,620.00  |  |
| CSX CORP                                    | 483,000 | 36.72  | 17,735,760.00 |  |
| GRAB HOLDINGS LTD-CL A                      | 450,000 | 3.53   | 1,588,500.00  |  |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC                 | 19,200  | 211.70 | 4,064,640.00  |  |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION<br>HOLDINGS INC | 38,000  | 56.82  | 2,159,160.00  |  |
| NORFOLK SOUTHERN CORP                       | 53,900  | 252.04 | 13,584,956.00 |  |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE                   | 23,800  | 423.45 | 10,078,110.00 |  |
| U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING                | 24,000  | 65.35  | 1,568,400.00  |  |
| UBER TECHNOLOGIES INC                       | 440,000 | 78.41  | 34,500,400.00 |  |
| UNION PAC CORP                              | 145,900 | 246.59 | 35,977,481.00 |  |
| APTIV PLC                                   | 67,400  | 78.96  | 5,321,904.00  |  |
| BORGWARNER INC                              | 56,000  | 30.61  | 1,714,160.00  |  |
| LEAR CORP                                   | 13,700  | 136.30 | 1,867,310.00  |  |

|                              |           |          |                |  |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|--|
|                              |           |          |                |  |
| FORD MOTOR COMPANY           | 940,000   | 12.30    | 11,562,000.00  |  |
| GENERAL MOTORS CO            | 332,000   | 38.70    | 12,848,400.00  |  |
| LUCID GROUP INC              | 205,000   | 3.71     | 760,550.00     |  |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A      | 151,000   | 16.30    | 2,461,300.00   |  |
| TESLA INC                    | 683,700   | 199.95   | 136,705,815.00 |  |
| DR HORTON INC                | 73,600    | 141.27   | 10,397,472.00  |  |
| GARMIN LTD                   | 37,500    | 122.20   | 4,582,500.00   |  |
| LENNAR CORP-A                | 59,400    | 150.22   | 8,923,068.00   |  |
| NVR INC                      | 789       | 7,390.65 | 5,831,222.85   |  |
| PULTEGROUP INC               | 53,600    | 101.45   | 5,437,720.00   |  |
| HASBRO INC                   | 31,700    | 50.78    | 1,609,726.00   |  |
| DECKERS OUTDOOR CORP         | 6,290     | 862.98   | 5,428,144.20   |  |
| LULULEMON ATHLETICA INC      | 27,800    | 449.60   | 12,498,880.00  |  |
| NIKE INC-B                   | 293,000   | 103.51   | 30,328,430.00  |  |
| V F CORP                     | 72,000    | 16.65    | 1,198,800.00   |  |
| AIRBNB INC-CLASS A           | 102,800   | 152.51   | 15,678,028.00  |  |
| BOOKING HOLDINGS INC         | 8,540     | 3,716.84 | 31,741,813.60  |  |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC    | 53,000    | 42.51    | 2,253,030.00   |  |
| CARNIVAL CORP                | 244,000   | 14.80    | 3,611,200.00   |  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC   | 6,580     | 2,598.43 | 17,097,669.40  |  |
| DARDEN RESTAURANTS INC       | 28,100    | 162.46   | 4,565,126.00   |  |
| DOMINOS PIZZA INC            | 8,600     | 421.85   | 3,627,910.00   |  |
| DOORDASH INC-A               | 61,700    | 116.01   | 7,157,817.00   |  |
| DRAFTKINGS INC               | 102,000   | 44.57    | 4,546,140.00   |  |
| EXPEDIA GROUP INC            | 33,800    | 135.25   | 4,571,450.00   |  |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 62,700    | 197.57   | 12,387,639.00  |  |
| HYATT HOTELS CORP-CL A       | 10,600    | 132.83   | 1,407,998.00   |  |
| LAS VEGAS SANDS CORP         | 91,000    | 55.25    | 5,027,750.00   |  |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA   | 60,900    | 241.63   | 14,715,267.00  |  |
| MCDONALD'S CORP              | 174,400   | 292.02   | 50,928,288.00  |  |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL    | 65,000    | 42.54    | 2,765,100.00   |  |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD  | 58,200    | 116.09   | 6,756,438.00   |  |
| STARBUCKS CORP               | 275,300   | 93.22    | 25,663,466.00  |  |
| VAIL RESORTS INC             | 8,900     | 225.48   | 2,006,772.00   |  |
| WYNN RESORTS LTD             | 24,500    | 105.13   | 2,575,685.00   |  |
| YUM BRANDS INC               | 67,900    | 134.55   | 9,135,945.00   |  |
| GENUINE PARTS CO             | 33,700    | 142.93   | 4,816,741.00   |  |
| LKQ CORP                     | 62,000    | 50.04    | 3,102,480.00   |  |
| POOL CORP                    | 9,500     | 387.30   | 3,679,350.00   |  |
| AMAZON.COM INC               | 2,222,500 | 169.51   | 376,735,975.00 |  |
| EBAY INC                     | 126,000   | 43.45    | 5,474,700.00   |  |
| ETSY INC                     | 28,000    | 76.57    | 2,143,960.00   |  |

|                                |         |          |               |
|--------------------------------|---------|----------|---------------|
| GLOBAL-E ONLINE LTD            | 20,000  | 40.98    | 819,600.00    |
| MERCADOLIBRE INC               | 10,750  | 1,768.78 | 19,014,385.00 |
| AUTOZONE                       | 4,310   | 2,727.83 | 11,756,947.30 |
| BATH & BODY WORKS INC          | 50,400  | 45.40    | 2,288,160.00  |
| BEST BUY COMPANY INC           | 48,400  | 73.75    | 3,569,500.00  |
| BURLINGTON STORES INC          | 15,900  | 195.17   | 3,103,203.00  |
| CARMAX INC                     | 36,700  | 71.88    | 2,637,996.00  |
| DICK S SPORTING GOODS INC      | 13,900  | 169.15   | 2,351,185.00  |
| HOME DEPOT                     | 239,400 | 362.35   | 86,746,590.00 |
| LOWES COS INC                  | 138,100 | 226.85   | 31,327,985.00 |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,        | 14,370  | 1,051.05 | 15,103,588.50 |
| ROSS STORES INC                | 80,700  | 144.08   | 11,627,256.00 |
| TJX COS INC                    | 275,000 | 98.04    | 26,961,000.00 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY         | 25,600  | 236.49   | 6,054,144.00  |
| ULTA BEAUTY INC                | 11,500  | 532.09   | 6,119,035.00  |
| ALBERTSONS COS INC-CLASS A     | 88,000  | 21.58    | 1,899,040.00  |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION   | 105,970 | 723.99   | 76,721,220.30 |
| DOLLAR GENERAL CORP            | 52,200  | 141.50   | 7,386,300.00  |
| DOLLAR TREE INC                | 49,400  | 143.37   | 7,082,478.00  |
| KROGER CO                      | 162,000 | 47.64    | 7,717,680.00  |
| SYSCO CORP                     | 118,900 | 79.50    | 9,452,550.00  |
| TARGET CORP                    | 111,300 | 149.61   | 16,651,593.00 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC   | 176,000 | 21.98    | 3,868,480.00  |
| WALMART INC                    | 354,300 | 170.36   | 60,358,548.00 |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B         | 76,000  | 57.87    | 4,398,120.00  |
| CELSIUS HOLDINGS INC           | 36,000  | 64.41    | 2,318,760.00  |
| COCA COLA CO                   | 983,200 | 59.39    | 58,392,248.00 |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS | 49,000  | 67.60    | 3,312,400.00  |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A     | 39,100  | 243.84   | 9,534,144.00  |
| KEURIG DR PEPPER INC           | 250,000 | 30.97    | 7,742,500.00  |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B     | 46,000  | 62.15    | 2,858,900.00  |
| MONSTER BEVERAGE CORP          | 190,000 | 55.02    | 10,453,800.00 |
| PEPSICO INC                    | 329,100 | 166.32   | 54,735,912.00 |
| ARCHER DANIELS MIDLAND         | 129,000 | 53.65    | 6,920,850.00  |
| BUNGE GLOBAL SA                | 36,200  | 91.68    | 3,318,816.00  |
| CAMPBELL SOUP CO               | 46,000  | 41.45    | 1,906,700.00  |
| CONAGRA BRANDS INC             | 112,000 | 27.21    | 3,047,520.00  |
| DARLING INGREDIENTS INC        | 37,500  | 42.61    | 1,597,875.00  |
| GENERAL MILLS                  | 138,600 | 64.10    | 8,884,260.00  |
| HERSHEY CO/THE                 | 36,100  | 191.16   | 6,900,876.00  |
| HORMEL FOODS CORP              | 75,000  | 28.99    | 2,174,250.00  |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW          | 26,200  | 124.09   | 3,251,158.00  |
| KELLANOVA                      | 68,000  | 55.47    | 3,771,960.00  |

|                                |         |        |               |  |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| KRAFT HEINZ CO/THE             | 204,000 | 34.81  | 7,101,240.00  |  |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC       | 35,200  | 101.23 | 3,563,296.00  |  |
| MCCORMICK & CO INC.            | 62,000  | 66.15  | 4,101,300.00  |  |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC     | 327,100 | 71.98  | 23,544,658.00 |  |
| TYSON FOODS INC-CL A           | 67,000  | 53.12  | 3,559,040.00  |  |
| ALTRIA GROUP INC               | 423,000 | 40.18  | 16,996,140.00 |  |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL    | 371,500 | 89.65  | 33,304,975.00 |  |
| CHURCH & DWIGHT CO INC         | 60,000  | 97.78  | 5,866,800.00  |  |
| CLOROX CO                      | 30,400  | 151.05 | 4,591,920.00  |  |
| COLGATE PALMOLIVE CO.          | 189,300 | 83.48  | 15,802,764.00 |  |
| KIMBERLY-CLARK CORP            | 81,800  | 118.29 | 9,676,122.00  |  |
| PROCTER & GAMBLE CO            | 564,100 | 157.51 | 88,851,391.00 |  |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A    | 56,400  | 146.37 | 8,255,268.00  |  |
| KENVUE INC                     | 410,000 | 19.05  | 7,810,500.00  |  |
| ABBOTT LABORATORIES            | 415,300 | 114.01 | 47,348,353.00 |  |
| ALIGN TECHNOLOGY INC           | 17,800  | 308.77 | 5,496,106.00  |  |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.      | 123,000 | 41.22  | 5,070,060.00  |  |
| BECTON,DICKINSON               | 69,900  | 240.76 | 16,829,124.00 |  |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP         | 352,000 | 65.82  | 23,168,640.00 |  |
| DEXCOM INC                     | 93,700  | 117.05 | 10,967,585.00 |  |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP      | 145,500 | 86.10  | 12,527,550.00 |  |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC | 99,400  | 86.02  | 8,550,388.00  |  |
| HOLOGIC INC                    | 57,900  | 73.79  | 4,272,441.00  |  |
| IDEXX LABORATORIES INC         | 20,100  | 555.54 | 11,166,354.00 |  |
| INSULET CORP                   | 17,000  | 191.01 | 3,247,170.00  |  |
| INTUITIVE SURGICAL INC         | 84,100  | 378.63 | 31,842,783.00 |  |
| MEDTRONIC PLC                  | 318,500 | 84.42  | 26,887,770.00 |  |
| RESMED INC                     | 34,400  | 180.46 | 6,207,824.00  |  |
| STERIS PLC                     | 23,300  | 231.23 | 5,387,659.00  |  |
| STRYKER CORP                   | 82,100  | 349.30 | 28,677,530.00 |  |
| TELEFLEX INC                   | 11,400  | 251.07 | 2,862,198.00  |  |
| THE COOPER COMPANIES, INC.     | 11,800  | 372.01 | 4,389,718.00  |  |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC     | 49,300  | 124.71 | 6,148,203.00  |  |
| CARDINAL HEALTH INC            | 60,700  | 104.45 | 6,340,115.00  |  |
| CENCORA INC                    | 40,300  | 231.72 | 9,338,316.00  |  |
| CENTENE CORP                   | 130,000 | 78.74  | 10,236,200.00 |  |
| CVS HEALTH CORP                | 305,700 | 77.10  | 23,569,470.00 |  |
| DAVITA INC                     | 12,500  | 122.22 | 1,527,750.00  |  |
| ELEVANCE HEALTH INC            | 56,600  | 512.63 | 29,014,858.00 |  |
| HCA HEALTHCARE INC             | 49,200  | 308.55 | 15,180,660.00 |  |
| HENRY SCHEIN INC               | 30,100  | 75.65  | 2,277,065.00  |  |
| HUMANA INC                     | 29,900  | 366.92 | 10,970,908.00 |  |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS   | 21,200  | 216.64 | 4,592,768.00  |  |

|                             |           |          |                |
|-----------------------------|-----------|----------|----------------|
| MCKESSON CORP               | 32,200    | 511.06   | 16,456,132.00  |
| MOLINA HEALTHCARE INC       | 14,000    | 401.72   | 5,624,080.00   |
| QUEST DIAGNOSTICS INC       | 27,000    | 124.00   | 3,348,000.00   |
| THE CIGNA GROUP             | 71,200    | 341.09   | 24,285,608.00  |
| UNITEDHEALTH GROUP INC      | 221,670   | 521.55   | 115,611,988.50 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 14,300    | 162.16   | 2,318,888.00   |
| ABBVIE INC                  | 422,400   | 177.49   | 74,971,776.00  |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 30,500    | 147.00   | 4,483,500.00   |
| AMGEN INC                   | 128,000   | 283.70   | 36,313,600.00  |
| BIOGEN INC                  | 34,300    | 219.08   | 7,514,444.00   |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 46,200    | 88.77    | 4,101,174.00   |
| EXACT SCIENCES CORP         | 43,300    | 60.97    | 2,640,001.00   |
| GILEAD SCIENCES INC         | 299,500   | 71.58    | 21,438,210.00  |
| INCYTE CORP                 | 45,000    | 57.96    | 2,608,200.00   |
| MODERNA INC                 | 77,900    | 88.37    | 6,884,023.00   |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC  | 23,000    | 132.31   | 3,043,130.00   |
| REGENERON PHARMACEUTICALS   | 25,420    | 948.05   | 24,099,431.00  |
| UNITED THERAPEUTICS CORP    | 11,000    | 214.73   | 2,362,030.00   |
| VERTEX PHARMACEUTICALS      | 61,800    | 422.20   | 26,091,960.00  |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO     | 502,000   | 49.86    | 25,029,720.00  |
| CATALENT INC                | 43,000    | 58.14    | 2,500,020.00   |
| ELI LILLY & CO.             | 193,080   | 782.06   | 151,000,144.80 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC    | 15,100    | 126.78   | 1,914,378.00   |
| JOHNSON & JOHNSON           | 576,346   | 156.55   | 90,226,966.30  |
| MERCK & CO INC              | 607,300   | 127.79   | 77,606,867.00  |
| PFIZER INC                  | 1,351,500 | 27.62    | 37,328,430.00  |
| ROYALTY PHARMA PLC-CL A     | 87,000    | 29.92    | 2,603,040.00   |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR  | 274,000   | 13.02    | 3,567,480.00   |
| VIATRIS INC                 | 292,000   | 13.06    | 3,813,520.00   |
| ZOETIS INC                  | 109,600   | 188.39   | 20,647,544.00  |
| BANK OF AMERICA CORP        | 1,712,000 | 34.09    | 58,362,080.00  |
| CITIGROUP                   | 459,000   | 54.85    | 25,176,150.00  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP    | 109,000   | 31.56    | 3,440,040.00   |
| FIFTH THIRD BANCORP         | 160,000   | 33.93    | 5,428,800.00   |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A  | 2,510     | 1,514.99 | 3,802,624.90   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC   | 341,000   | 12.87    | 4,388,670.00   |
| JPMORGAN CHASE & CO         | 695,500   | 179.03   | 124,515,365.00 |
| KEYCORP                     | 221,000   | 14.07    | 3,109,470.00   |
| M & T BANK CORP             | 39,700    | 138.31   | 5,490,907.00   |
| PNC FINANCIAL               | 95,100    | 148.85   | 14,155,635.00  |
| REGIONS FINANCIAL CORP      | 223,000   | 18.48    | 4,121,040.00   |
| TRUIST FINANCIAL CORP       | 316,000   | 36.10    | 11,407,600.00  |
| US BANCORP                  | 370,000   | 41.49    | 15,351,300.00  |



|                               |         |          |                |
|-------------------------------|---------|----------|----------------|
| WELLS FARGO CO                | 876,000 | 51.91    | 45,473,160.00  |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC  | 95,200  | 112.71   | 10,729,992.00  |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B   | 313,100 | 405.99   | 127,115,469.00 |
| BLOCK INC                     | 130,000 | 65.64    | 8,533,200.00   |
| EQUITABLE HOLDINGS INC        | 79,000  | 34.21    | 2,702,590.00   |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 144,000 | 63.65    | 9,165,600.00   |
| FISERV INC                    | 145,600 | 148.04   | 21,554,624.00  |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC     | 16,600  | 271.62   | 4,508,892.00   |
| GLOBAL PAYMENTS INC           | 63,100  | 134.19   | 8,467,389.00   |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC   | 17,500  | 172.48   | 3,018,400.00   |
| MASTERCARD INC                | 201,400 | 468.13   | 94,281,382.00  |
| PAYPAL HOLDINGS INC           | 251,000 | 59.14    | 14,844,140.00  |
| TOAST INC-CLASS A             | 72,000  | 22.42    | 1,614,240.00   |
| VISA INC-CLASS A SHARES       | 384,600 | 278.56   | 107,134,176.00 |
| AFLAC INC                     | 135,800 | 79.38    | 10,779,804.00  |
| ALLSTATE CORP                 | 62,400  | 161.78   | 10,095,072.00  |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC  | 17,500  | 123.44   | 2,160,200.00   |
| AMERICAN INTL GROUP           | 172,000 | 70.04    | 12,046,880.00  |
| AON PLC                       | 48,400  | 311.24   | 15,064,016.00  |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD        | 88,400  | 86.11    | 7,612,124.00   |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO       | 52,000  | 239.22   | 12,439,440.00  |
| ASSURANT INC                  | 12,900  | 173.72   | 2,240,988.00   |
| BROWN & BROWN INC             | 56,100  | 82.69    | 4,638,909.00   |
| CHUBB LTD                     | 98,800  | 250.90   | 24,788,920.00  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 38,500  | 111.86   | 4,306,610.00   |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A   | 6,200   | 359.81   | 2,230,822.00   |
| EVEREST GROUP LTD             | 10,600  | 367.87   | 3,899,422.00   |
| FNF GROUP                     | 64,000  | 52.39    | 3,352,960.00   |
| GLOBE LIFE INC                | 21,700  | 125.53   | 2,724,001.00   |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES   | 74,000  | 93.06    | 6,886,440.00   |
| LOEWS CORP                    | 45,300  | 74.34    | 3,367,602.00   |
| MARKEL GROUP INC              | 2,940   | 1,461.50 | 4,296,810.00   |
| MARSH & MCLENNAN COS          | 118,800 | 200.30   | 23,795,640.00  |
| METLIFE INC                   | 154,200 | 68.77    | 10,604,334.00  |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     | 57,100  | 80.04    | 4,570,284.00   |
| PROGRESSIVE CO                | 140,700 | 189.09   | 26,604,963.00  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 86,600  | 107.28   | 9,290,448.00   |
| TRAVELERS COS INC/THE         | 54,700  | 217.53   | 11,898,891.00  |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC      | 25,300  | 277.31   | 7,015,943.00   |
| WR BERKLEY CORP               | 48,600  | 82.61    | 4,014,846.00   |
| ACCENTURE PLC-CL A            | 150,200 | 369.48   | 55,495,896.00  |
| AKAMAI TECHNOLOGIES           | 35,800  | 109.19   | 3,909,002.00   |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A      | 66,600  | 98.52    | 6,561,432.00   |

|                                        |           |          |                |  |
|----------------------------------------|-----------|----------|----------------|--|
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP          | 120,400   | 77.00    | 9,270,800.00   |  |
| EPAM SYSTEMS INC                       | 13,800    | 311.98   | 4,305,324.00   |  |
| GARTNER INC                            | 18,900    | 448.61   | 8,478,729.00   |  |
| GODADDY INC - CLASS A                  | 34,500    | 109.98   | 3,794,310.00   |  |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES        | 218,000   | 187.64   | 40,905,520.00  |  |
| MONGODB INC                            | 17,300    | 465.06   | 8,045,538.00   |  |
| OKTA INC                               | 36,400    | 88.86    | 3,234,504.00   |  |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A                  | 66,500    | 230.31   | 15,315,615.00  |  |
| TWILIO INC - A                         | 41,400    | 58.59    | 2,425,626.00   |  |
| VERISIGN INC                           | 22,000    | 194.24   | 4,273,280.00   |  |
| WIX.COM LTD                            | 12,200    | 127.26   | 1,552,572.00   |  |
| ADOBE INC                              | 109,000   | 546.66   | 59,585,940.00  |  |
| ANSYS INC                              | 20,400    | 329.85   | 6,728,940.00   |  |
| ASPEN TECHNOLOGY INC                   | 7,200     | 182.75   | 1,315,800.00   |  |
| ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A             | 37,200    | 207.84   | 7,731,648.00   |  |
| AUTODESK INC.                          | 50,600    | 258.30   | 13,069,980.00  |  |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B            | 53,000    | 53.16    | 2,817,480.00   |  |
| BILL HOLDINGS INC                      | 22,400    | 63.49    | 1,422,176.00   |  |
| CADENCE DESIGN SYS INC                 | 65,400    | 290.30   | 18,985,620.00  |  |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | 21,800    | 162.77   | 3,548,386.00   |  |
| CONFLUENT INC-CLASS A                  | 47,000    | 33.96    | 1,596,120.00   |  |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A           | 54,500    | 329.24   | 17,943,580.00  |  |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL           | 10,500    | 260.43   | 2,734,515.00   |  |
| DATADOG INC - CLASS A                  | 61,700    | 129.74   | 8,004,958.00   |  |
| DOCUSIGN INC                           | 50,000    | 50.22    | 2,511,000.00   |  |
| DROPBOX INC-CLASS A                    | 66,000    | 25.08    | 1,655,280.00   |  |
| DYNATRACE INC                          | 58,000    | 51.09    | 2,963,220.00   |  |
| FAIR ISAAC CORP                        | 5,850     | 1,282.06 | 7,500,051.00   |  |
| FORTINET INC                           | 160,000   | 68.48    | 10,956,800.00  |  |
| GEN DIGITAL INC                        | 141,000   | 21.36    | 3,011,760.00   |  |
| HUBSPOT INC                            | 11,300    | 613.50   | 6,932,550.00   |  |
| INTUIT INC                             | 67,100    | 655.74   | 44,000,154.00  |  |
| MANHATTAN ASSOCIATES, INC.             | 15,300    | 243.81   | 3,730,293.00   |  |
| MICROSOFT CORP                         | 1,689,300 | 404.06   | 682,578,558.00 |  |
| MONDAY.COM LTD                         | 6,800     | 225.30   | 1,532,040.00   |  |
| ORACLE CORPORATION                     | 393,400   | 111.31   | 43,789,354.00  |  |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A            | 439,000   | 24.44    | 10,729,160.00  |  |
| PALO ALTO NETWORKS INC                 | 73,500    | 366.41   | 26,931,135.00  |  |
| PTC INC                                | 28,600    | 178.19   | 5,096,234.00   |  |
| ROPER TECHNOLOGIES INC                 | 25,500    | 545.57   | 13,912,035.00  |  |
| SALESFORCE INC                         | 232,840   | 289.72   | 67,458,404.80  |  |
| SERVICENOW INC                         | 48,900    | 765.00   | 37,408,500.00  |  |
| SPLUNK INC                             | 38,600    | 155.37   | 5,997,282.00   |  |

|                              |           |          |                |
|------------------------------|-----------|----------|----------------|
| SYNOPTICS INC                | 36,600    | 552.91   | 20,236,506.00  |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 9,800     | 440.98   | 4,321,604.00   |
| UIPATH INC - CLASS A         | 96,000    | 24.96    | 2,396,160.00   |
| UNITY SOFTWARE INC           | 62,000    | 33.90    | 2,101,800.00   |
| WORKDAY INC-CLASS A          | 49,400    | 302.67   | 14,951,898.00  |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A  | 57,900    | 62.12    | 3,596,748.00   |
| ZSCALER INC                  | 21,100    | 252.75   | 5,333,025.00   |
| ARISTA NETWORKS INC          | 62,800    | 261.75   | 16,437,900.00  |
| CISCO SYSTEMS                | 969,900   | 48.44    | 46,981,956.00  |
| F5 INC                       | 13,900    | 182.35   | 2,534,665.00   |
| JUNIPER NETWORKS INC         | 80,000    | 36.92    | 2,953,600.00   |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 39,700    | 320.49   | 12,723,453.00  |
| APPLE INC                    | 3,741,900 | 182.31   | 682,185,789.00 |
| DELL TECHNOLOGIES-C          | 62,700    | 84.21    | 5,279,967.00   |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE   | 299,000   | 14.93    | 4,464,070.00   |
| HP INC                       | 217,000   | 28.58    | 6,201,860.00   |
| NETAPP INC                   | 49,100    | 85.71    | 4,208,361.00   |
| SEAGATE TECHNOLOGY           | 48,100    | 87.52    | 4,209,712.00   |
| SUPER MICRO COMPUTER INC     | 11,600    | 803.32   | 9,318,512.00   |
| WESTERN DIGITAL CORP         | 79,000    | 54.00    | 4,266,000.00   |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 142,400   | 105.52   | 15,026,048.00  |
| CDW CORPORATION              | 32,600    | 241.37   | 7,868,662.00   |
| CORNING INC                  | 198,000   | 31.91    | 6,318,180.00   |
| JABIL INC                    | 31,000    | 138.50   | 4,293,500.00   |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC    | 42,100    | 155.22   | 6,534,762.00   |
| TE CONNECTIVITY LTD          | 75,100    | 142.40   | 10,694,240.00  |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC    | 11,400    | 432.26   | 4,927,764.00   |
| TRIMBLE INC                  | 58,000    | 60.29    | 3,496,820.00   |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 12,600    | 275.46   | 3,470,796.00   |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 386,648   | 173.87   | 67,226,487.76  |
| ANALOG DEVICES INC           | 119,800   | 188.24   | 22,551,152.00  |
| APPLIED MATERIALS            | 200,200   | 199.57   | 39,953,914.00  |
| BROADCOM INC                 | 106,217   | 1,245.48 | 132,291,149.16 |
| ENPHASE ENERGY INC           | 32,500    | 131.87   | 4,285,775.00   |
| ENTEGRIS INC                 | 35,700    | 136.81   | 4,884,117.00   |
| FIRST SOLAR INC              | 24,700    | 156.97   | 3,877,282.50   |
| INTEL CORP                   | 1,002,500 | 43.51    | 43,618,775.00  |
| KLA CORP                     | 32,500    | 661.35   | 21,493,875.00  |
| LAM RESEARCH                 | 31,470    | 926.03   | 29,142,164.10  |
| LATTICE SEMICONDUCTOR CORP   | 35,000    | 73.24    | 2,563,400.00   |
| MARVELL TECHNOLOGY INC       | 206,000   | 66.29    | 13,655,740.00  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         | 130,200   | 81.61    | 10,625,622.00  |
| MICRON TECHNOLOGY            | 261,500   | 79.50    | 20,789,250.00  |

|                              |           |        |                |  |
|------------------------------|-----------|--------|----------------|--|
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 10,900    | 730.50 | 7,962,450.00   |  |
| NVIDIA CORP                  | 591,140   | 726.13 | 429,244,488.20 |  |
| NXP SEMICONDUCTORS NV        | 61,400    | 232.16 | 14,254,624.00  |  |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 104,700   | 78.64  | 8,233,608.00   |  |
| QORVO INC                    | 22,500    | 112.17 | 2,523,825.00   |  |
| QUALCOMM INC                 | 267,100   | 152.69 | 40,783,499.00  |  |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       | 37,900    | 103.75 | 3,932,125.00   |  |
| TERADYNE INC                 | 36,500    | 102.24 | 3,731,760.00   |  |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 217,300   | 160.38 | 34,850,574.00  |  |
| AT & T INC                   | 1,711,000 | 16.97  | 29,035,670.00  |  |
| LIBERTY GLOBAL LTD-C         | 64,000    | 18.95  | 1,212,800.00   |  |
| VERIZON COMMUNICATIONS       | 1,006,000 | 40.49  | 40,732,940.00  |  |
| T-MOBILE US INC              | 127,400   | 160.41 | 20,436,234.00  |  |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 60,000    | 48.35  | 2,901,000.00   |  |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 121,900   | 81.35  | 9,916,565.00   |  |
| CONSTELLATION ENERGY         | 76,000    | 131.16 | 9,968,160.00   |  |
| DUKE ENERGY CORP             | 185,600   | 91.88  | 17,052,928.00  |  |
| EDISON INTERNATIONAL         | 93,300    | 66.31  | 6,186,723.00   |  |
| ENTERGY CORP                 | 51,200    | 100.15 | 5,127,680.00   |  |
| EVERGY INC                   | 57,000    | 50.03  | 2,851,710.00   |  |
| EVERSOURCE ENERGY            | 82,000    | 58.87  | 4,827,340.00   |  |
| EXELON CORPORATION           | 236,000   | 34.91  | 8,238,760.00   |  |
| FIRSTENERGY CORP             | 133,000   | 37.39  | 4,972,870.00   |  |
| NEXTERA ENERGY INC           | 490,900   | 57.03  | 27,996,027.00  |  |
| NRG ENERGY INC               | 55,000    | 51.90  | 2,854,500.00   |  |
| PG&E CORP                    | 482,000   | 16.43  | 7,919,260.00   |  |
| PPL CORPORATION              | 173,000   | 26.64  | 4,608,720.00   |  |
| SOUTHERN CO.                 | 259,900   | 66.48  | 17,278,152.00  |  |
| XCEL ENERGY INC              | 130,600   | 59.07  | 7,714,542.00   |  |
| ATMOS ENERGY CORP            | 36,500    | 113.95 | 4,159,175.00   |  |
| AMEREN CORPORATION           | 63,700    | 69.51  | 4,427,787.00   |  |
| CENTERPOINT ENERGY INC       | 151,000   | 27.88  | 4,209,880.00   |  |
| CMS ENERGY CORP              | 68,000    | 57.27  | 3,894,360.00   |  |
| CONSOLIDATED EDISON INC      | 82,300    | 87.32  | 7,186,436.00   |  |
| DOMINION ENERGY INC          | 198,000   | 45.86  | 9,080,280.00   |  |
| DTE ENERGY COMPANY           | 49,300    | 107.80 | 5,314,540.00   |  |
| NISOURCE INC                 | 103,000   | 25.90  | 2,667,700.00   |  |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE        | 117,200   | 59.79  | 7,007,388.00   |  |
| SEMPRA                       | 148,900   | 70.49  | 10,495,961.00  |  |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 75,100    | 78.07  | 5,863,057.00   |  |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 45,500    | 122.82 | 5,588,310.00   |  |
| ESSENTIAL UTILITIES INC      | 57,000    | 36.19  | 2,062,830.00   |  |
| ALLY FINANCIAL INC           | 66,000    | 35.98  | 2,374,680.00   |  |

|                               |         |        |               |  |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| AMERICAN EXPRESS CO           | 149,800 | 212.56 | 31,841,488.00 |  |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 90,400  | 137.23 | 12,405,592.00 |  |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES   | 59,900  | 110.49 | 6,618,351.00  |  |
| SYNCHRONY FINANCIAL           | 97,800  | 39.56  | 3,868,968.00  |  |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC      | 24,700  | 397.80 | 9,825,660.00  |  |
| ARES MANAGEMENT CORP - A      | 40,000  | 134.97 | 5,398,800.00  |  |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP   | 188,000 | 55.15  | 10,368,200.00 |  |
| BLACKROCK INC                 | 35,730  | 794.00 | 28,369,620.00 |  |
| BLACKSTONE INC                | 169,000 | 127.89 | 21,613,410.00 |  |
| CARLYLE GROUP INC/THE         | 52,000  | 44.58  | 2,318,160.00  |  |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC       | 25,800  | 186.69 | 4,816,602.00  |  |
| CME GROUP INC                 | 86,600  | 212.26 | 18,381,716.00 |  |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A  | 41,000  | 180.31 | 7,392,710.00  |  |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC  | 9,000   | 458.42 | 4,125,780.00  |  |
| FRANKLIN RESOURCES INC        | 75,000  | 27.27  | 2,045,250.00  |  |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR         | 13,000  | 52.28  | 679,705.00    |  |
| GOLDMAN SACHS GROUP           | 78,900  | 384.44 | 30,332,316.00 |  |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 136,500 | 137.12 | 18,716,880.00 |  |
| KKR & CO INC-A                | 138,900 | 95.66  | 13,287,174.00 |  |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC    | 18,400  | 257.66 | 4,740,944.00  |  |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC      | 8,500   | 219.04 | 1,861,840.00  |  |
| MOODYS CORP                   | 39,400  | 370.76 | 14,607,944.00 |  |
| MORGAN STANLEY                | 298,700 | 86.50  | 25,837,550.00 |  |
| MSCI INC                      | 18,700  | 568.75 | 10,635,625.00 |  |
| NASDAQ INC                    | 84,000  | 55.42  | 4,655,280.00  |  |
| NORTHERN TRUST CORP           | 48,200  | 79.95  | 3,853,590.00  |  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 46,700  | 118.49 | 5,533,483.00  |  |
| ROBINHOOD MARKETS INC -A      | 96,000  | 14.00  | 1,344,000.00  |  |
| S&P GLOBAL INC                | 77,895  | 423.57 | 32,993,985.15 |  |
| SCHWAB(CHARLES)CORP           | 358,100 | 64.40  | 23,061,640.00 |  |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       | 26,000  | 65.87  | 1,712,620.00  |  |
| STATE STREET CORP             | 78,900  | 72.49  | 5,719,461.00  |  |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 52,500  | 108.86 | 5,715,150.00  |  |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A  | 27,200  | 101.51 | 2,761,072.00  |  |
| AES CORP                      | 166,000 | 16.77  | 2,783,820.00  |  |
| VISTRA CORP                   | 80,000  | 45.58  | 3,646,400.00  |  |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A     | 36,500  | 219.35 | 8,006,275.00  |  |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC      | 69,300  | 134.84 | 9,344,412.00  |  |
| AVANTOR INC                   | 161,000 | 23.76  | 3,825,360.00  |  |
| BIO TECHNE CORP               | 37,900  | 71.61  | 2,714,019.00  |  |
| BIO-RAD LABORATORIES-A        | 5,100   | 340.52 | 1,736,652.00  |  |
| CHARLES RIVER LABORATORIES    | 12,600  | 244.96 | 3,086,496.00  |  |
| DANAHER CORP                  | 167,900 | 250.00 | 41,975,000.00 |  |

|                                    |         |          |               |
|------------------------------------|---------|----------|---------------|
| ILLUMINA INC                       | 37,000  | 143.41   | 5,306,170.00  |
| IQVIA HOLDINGS INC                 | 43,500  | 238.60   | 10,379,100.00 |
| METTLER-TOLEDO INTL                | 5,260   | 1,187.44 | 6,245,934.40  |
| REPLIGEN CORP                      | 12,500  | 208.42   | 2,605,250.00  |
| REVVITY INC                        | 29,700  | 102.46   | 3,043,062.00  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC       | 92,340  | 547.84   | 50,587,545.60 |
| WATERS CORP                        | 13,900  | 325.21   | 4,520,419.00  |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES       | 17,700  | 362.05   | 6,408,285.00  |
| AUTOMATIC DATA PROCESS             | 99,100  | 252.97   | 25,069,327.00 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS       | 30,900  | 145.59   | 4,498,731.00  |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 28,800  | 197.92   | 5,700,096.00  |
| DAYFORCE INC                       | 34,400  | 73.26    | 2,520,144.00  |
| EQUIFAX INC                        | 29,000  | 258.08   | 7,484,320.00  |
| JACOBS SOLUTIONS INC               | 29,300  | 147.54   | 4,322,922.00  |
| LEIDOS HOLDINGS INC                | 32,200  | 123.83   | 3,987,326.00  |
| PAYCHEX INC                        | 78,700  | 123.38   | 9,710,006.00  |
| PAYCOM SOFTWARE INC                | 12,600  | 190.82   | 2,404,332.00  |
| PAYLOCITY HOLDING CORP             | 10,500  | 177.39   | 1,862,595.00  |
| ROBERT HALF INC                    | 24,700  | 80.84    | 1,996,748.00  |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS         | 54,000  | 63.46    | 3,426,840.00  |
| TRUNSON                            | 46,200  | 75.07    | 3,468,234.00  |
| VERISK ANALYTICS INC               | 34,400  | 244.70   | 8,417,680.00  |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A       | 23,200  | 293.00   | 6,797,600.00  |
| COMCAST CORP-CL A                  | 985,100 | 41.24    | 40,625,524.00 |
| FOX CORP-CLASS A                   | 61,000  | 30.44    | 1,856,840.00  |
| FOX CORP-CLASS B                   | 30,000  | 27.95    | 838,500.00    |
| INTERPUBRIC GROUP                  | 93,000  | 32.45    | 3,017,850.00  |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C           | 27,100  | 60.37    | 1,636,027.00  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW       | 43,000  | 30.01    | 1,290,430.00  |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I             | 86,000  | 26.24    | 2,256,640.00  |
| OMNICOM GROUP                      | 48,500  | 87.51    | 4,244,235.00  |
| PARAMOUNT GLOBAL                   | 109,000 | 12.00    | 1,308,000.00  |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC             | 171,000 | 4.80     | 820,800.00    |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A        | 108,000 | 88.93    | 9,604,440.00  |
| DISNEY (WALT) CO                   | 437,900 | 111.60   | 48,869,640.00 |
| ELECTRONIC ARTS                    | 62,400  | 142.28   | 8,878,272.00  |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C       | 47,200  | 69.18    | 3,265,296.00  |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN       | 38,100  | 93.25    | 3,552,825.00  |
| NETFLIX INC                        | 106,100 | 583.95   | 61,957,095.00 |
| ROBLOX CORP -CLASS A               | 103,000 | 42.91    | 4,419,730.00  |
| ROKU INC                           | 30,500  | 72.00    | 2,196,000.00  |
| SEA LTD-ADR                        | 86,000  | 44.99    | 3,869,140.00  |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE      | 40,400  | 153.38   | 6,196,552.00  |

|       |                                |           |        |                     |  |
|-------|--------------------------------|-----------|--------|---------------------|--|
|       | INC                            |           |        |                     |  |
|       | WARNER BROS DISCOVERY INC      | 557,000   | 9.83   | 5,475,310.00        |  |
|       | ALPHABET INC-CL A              | 1,420,000 | 140.52 | 199,538,400.00      |  |
|       | ALPHABET INC-CL C              | 1,249,600 | 141.76 | 177,143,296.00      |  |
|       | MATCH GROUP INC                | 63,000    | 37.59  | 2,368,170.00        |  |
|       | META PLATFORMS INC-CLASS A     | 532,000   | 473.32 | 251,806,240.00      |  |
|       | PINTEREST INC- CLASS A         | 138,000   | 35.28  | 4,868,640.00        |  |
|       | SNAP INC-A                     | 239,000   | 11.17  | 2,669,630.00        |  |
|       | CBRE GROUP INC                 | 73,400    | 93.13  | 6,835,742.00        |  |
|       | COSTAR GROUP INC               | 98,000    | 81.40  | 7,977,200.00        |  |
|       | HONGKONG LAND HOLDINGS LTD     | 260,000   | 3.24   | 842,400.00          |  |
|       | ZILLOW GROUP INC - C           | 38,000    | 54.80  | 2,082,400.00        |  |
| 小計    | 銘柄数：588                        |           |        | 10,366,889,445.02   |  |
|       |                                |           |        | (1,555,344,423,436) |  |
|       | 組入時価比率：72.8%                   |           |        | 75.4%               |  |
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD              | 145,000   | 22.40  | 3,248,000.00        |  |
|       | CAMECO CORP                    | 106,000   | 56.86  | 6,027,160.00        |  |
|       | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 261,100   | 85.16  | 22,235,276.00       |  |
|       | CENOVUS ENERGY INC             | 333,000   | 23.50  | 7,825,500.00        |  |
|       | ENBRIDGE INC                   | 507,000   | 46.46  | 23,555,220.00       |  |
|       | IMPERIAL OIL                   | 48,000    | 80.75  | 3,876,000.00        |  |
|       | KEYERA CORP                    | 57,000    | 32.74  | 1,866,180.00        |  |
|       | MEG ENERGY CORP                | 67,000    | 25.87  | 1,733,290.00        |  |
|       | PARKLAND CORP                  | 36,000    | 45.71  | 1,645,560.00        |  |
|       | PEMBINA PIPELINE CORP          | 135,000   | 45.91  | 6,197,850.00        |  |
|       | SUNCOR ENERGY INC              | 315,000   | 44.58  | 14,042,700.00       |  |
|       | TC ENERGY CORP                 | 247,000   | 53.32  | 13,170,040.00       |  |
|       | TOURMALINE OIL CORP            | 77,000    | 57.23  | 4,406,710.00        |  |
|       | NUTRIEN LTD                    | 118,000   | 68.92  | 8,132,560.00        |  |
|       | CCL INDUSTRIES INC - CL B      | 37,000    | 58.38  | 2,160,060.00        |  |
|       | AGNICO EAGLE MINES LTD         | 116,000   | 64.46  | 7,477,360.00        |  |
|       | BARRICK GOLD                   | 413,000   | 19.74  | 8,152,620.00        |  |
|       | FIRST QUANTUM MINERALS LTD     | 138,000   | 12.12  | 1,672,560.00        |  |
|       | FRANCO-NEVADA CORP             | 45,700    | 147.12 | 6,723,384.00        |  |
|       | IVANHOE MINES LTD-CL A         | 141,000   | 14.47  | 2,040,270.00        |  |
|       | KINROSS GOLD CORP              | 300,000   | 6.83   | 2,049,000.00        |  |
|       | LUNDIN MINING CORP             | 169,000   | 11.69  | 1,975,610.00        |  |
|       | PAN AMERICAN SILVER CORP       | 81,000    | 17.67  | 1,431,270.00        |  |
|       | TECK RESOURCES LTD-CLS B       | 112,000   | 52.22  | 5,848,640.00        |  |
|       | WHEATON PRECIOUS METALS CORP   | 111,000   | 59.91  | 6,650,010.00        |  |
|       | WEST FRASER TIMBER             | 14,200    | 107.53 | 1,526,926.00        |  |
|       | CAE INC                        | 76,000    | 25.66  | 1,950,160.00        |  |
|       | STANTEC INC                    | 25,000    | 112.57 | 2,814,250.00        |  |
|       | WSP GLOBAL INC                 | 29,300    | 207.95 | 6,092,935.00        |  |

|                                     |         |          |               |  |
|-------------------------------------|---------|----------|---------------|--|
|                                     |         |          |               |  |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD             | 19,400  | 124.58   | 2,416,852.00  |  |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP       | 98,000  | 22.59    | 2,213,820.00  |  |
| GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT      | 54,000  | 49.85    | 2,691,900.00  |  |
| RB GLOBAL INC                       | 43,300  | 92.98    | 4,026,034.00  |  |
| AIR CANADA                          | 43,000  | 18.00    | 774,000.00    |  |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO            | 132,900 | 175.06   | 23,265,474.00 |  |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD    | 224,300 | 115.19   | 25,837,117.00 |  |
| TFI INTERNATIONAL INC               | 18,900  | 197.06   | 3,724,434.00  |  |
| MAGNA INTERNATIONAL INC             | 63,000  | 74.11    | 4,668,930.00  |  |
| BRP INC/CA- SUB VOTING              | 7,400   | 89.79    | 664,446.00    |  |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC               | 44,000  | 46.56    | 2,048,640.00  |  |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 69,300  | 104.11   | 7,214,823.00  |  |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A            | 11,500  | 140.01   | 1,610,115.00  |  |
| DOLLARAMA INC                       | 69,100  | 103.34   | 7,140,794.00  |  |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC        | 183,000 | 82.00    | 15,006,000.00 |  |
| EMPIRE CO LTD A                     | 39,000  | 34.66    | 1,351,740.00  |  |
| LOBLAW COMPANIES                    | 38,200  | 137.76   | 5,262,432.00  |  |
| METRO INC                           | 53,000  | 71.02    | 3,764,060.00  |  |
| WESTON(GEORGE)LTD                   | 15,200  | 173.65   | 2,639,480.00  |  |
| SAPUTO INC                          | 57,000  | 28.22    | 1,608,540.00  |  |
| BANK OF MONTREAL                    | 173,700 | 127.03   | 22,065,111.00 |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX         | 288,000 | 63.86    | 18,391,680.00 |  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE  | 221,000 | 61.93    | 13,686,530.00 |  |
| NATIONAL BANK OF CANADA             | 80,700  | 103.71   | 8,369,397.00  |  |
| ROYAL BANK OF CANADA                | 333,900 | 131.94   | 44,054,766.00 |  |
| TORONTO DOMINION BANK               | 437,000 | 80.87    | 35,340,190.00 |  |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD         | 5,220   | 1,374.97 | 7,177,343.40  |  |
| GREAT-WEST LIFE CO INC              | 64,000  | 41.78    | 2,673,920.00  |  |
| IA FINANCIAL CORP INC               | 24,100  | 92.64    | 2,232,624.00  |  |
| INTACT FINANCIAL CORP               | 41,800  | 228.67   | 9,558,406.00  |  |
| MANULIFE FINANCIAL CORP             | 440,000 | 33.30    | 14,652,000.00 |  |
| POWER CORPORATION OF CANADA         | 142,000 | 38.32    | 5,441,440.00  |  |
| SUN LIFE FINANCIAL INC              | 138,000 | 72.77    | 10,042,260.00 |  |
| CGI INC                             | 51,000  | 154.80   | 7,894,800.00  |  |
| SHOPIFY INC - CLASS A               | 286,500 | 109.62   | 31,406,130.00 |  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC          | 4,860   | 3,710.83 | 18,034,633.80 |  |
| DESCARTES SYSTEMS GRP(THE)          | 20,800  | 117.05   | 2,434,640.00  |  |
| OPEN TEXT CORP                      | 62,000  | 53.93    | 3,343,660.00  |  |
| BCE INC                             | 20,000  | 50.83    | 1,016,600.00  |  |
| QUEBECOR INC-CL B                   | 34,000  | 31.77    | 1,080,180.00  |  |
| TELUS CORP                          | 98,600  | 23.94    | 2,360,484.00  |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B          | 85,000  | 61.55    | 5,231,750.00  |  |



|     |                             |         |        |                                    |
|-----|-----------------------------|---------|--------|------------------------------------|
|     |                             |         |        |                                    |
|     | EMERA INC                   | 68,000  | 48.38  | 3,289,840.00                       |
|     | FORTIS INC                  | 118,000 | 52.95  | 6,248,100.00                       |
|     | HYDRO ONE LTD               | 78,000  | 40.58  | 3,165,240.00                       |
|     | ALTAGAS LTD                 | 72,000  | 28.25  | 2,034,000.00                       |
|     | ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 139,000 | 8.12   | 1,128,680.00                       |
|     | CANADIAN UTILITIES LTD A    | 27,000  | 30.18  | 814,860.00                         |
|     | BROOKFIELD ASSET MGMT-A     | 87,000  | 55.08  | 4,791,960.00                       |
|     | BROOKFIELD CORP             | 333,000 | 54.43  | 18,125,190.00                      |
|     | IGM FINANCIAL INC           | 21,000  | 35.10  | 737,100.00                         |
|     | ONEX CORPORATION            | 16,900  | 102.74 | 1,736,306.00                       |
|     | TMX GROUP LTD               | 66,000  | 34.18  | 2,255,880.00                       |
|     | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A  | 29,000  | 34.20  | 991,800.00                         |
|     | NORTHLAND POWER INC         | 67,000  | 24.00  | 1,608,000.00                       |
|     | THOMSON REUTERS CORP        | 38,500  | 216.26 | 8,326,010.00                       |
|     | FIRSTSERVICE CORP           | 10,000  | 222.99 | 2,229,900.00                       |
| 小計  | 銘柄数：86                      |         |        | 618,428,143.20<br>(68,886,710,871) |
|     | 組入時価比率：3.2%                 |         |        | 3.3%                               |
| ユーロ | TENARIS SA                  | 115,000 | 15.08  | 1,734,775.00                       |
|     | ENI SPA                     | 566,000 | 14.15  | 8,011,164.00                       |
|     | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 121,000 | 14.35  | 1,736,350.00                       |
|     | NESTE OYJ                   | 102,000 | 27.32  | 2,786,640.00                       |
|     | OMV AG                      | 38,000  | 40.66  | 1,545,080.00                       |
|     | REPSOL SA                   | 306,000 | 13.58  | 4,157,010.00                       |
|     | TOTALENERGIES SE            | 548,000 | 59.89  | 32,819,720.00                      |
|     | AIR LIQUIDE SA              | 124,700 | 171.10 | 21,336,170.00                      |
|     | AKZO NOBEL                  | 39,400  | 69.16  | 2,724,904.00                       |
|     | ARKEMA                      | 13,600  | 98.30  | 1,336,880.00                       |
|     | BASF SE                     | 212,000 | 46.59  | 9,877,080.00                       |
|     | COVESTRO AG                 | 47,000  | 48.17  | 2,263,990.00                       |
|     | DSM-FIRMENICH AG            | 43,000  | 103.02 | 4,429,860.00                       |
|     | EVONIK INDUSTRIES AG        | 60,000  | 17.34  | 1,040,700.00                       |
|     | OCI                         | 28,000  | 26.48  | 741,440.00                         |
|     | SYENSQO SA                  | 16,400  | 85.13  | 1,396,132.00                       |
|     | SYMRISE AG                  | 31,200  | 97.96  | 3,056,352.00                       |
|     | UMICORE                     | 53,000  | 20.67  | 1,095,510.00                       |
|     | WACKER CHEMIE AG            | 4,100   | 101.50 | 416,150.00                         |
|     | HEIDELBERG MATERIALS AG     | 33,700  | 85.32  | 2,875,284.00                       |
|     | SMURFIT KAPPA GROUP PLC     | 62,000  | 37.98  | 2,354,760.00                       |
|     | ARCELORMITTAL               | 119,000 | 25.63  | 3,049,970.00                       |
|     | VOESTALPINE AG              | 29,000  | 25.74  | 746,460.00                         |
|     | STORA ENSO OYJ-R            | 139,000 | 11.20  | 1,556,800.00                       |

|                              |         |        |               |  |
|------------------------------|---------|--------|---------------|--|
| UPM-KYMMENE OYJ              | 131,000 | 28.91  | 3,787,210.00  |  |
| AIRBUS SE                    | 142,500 | 146.34 | 20,853,450.00 |  |
| DASSAULT AVIATION SA         | 4,700   | 184.30 | 866,210.00    |  |
| LEONARDO SPA                 | 102,000 | 18.77  | 1,914,540.00  |  |
| MTU AERO ENGINES AG          | 13,100  | 227.00 | 2,973,700.00  |  |
| RHEINMETALL AG               | 10,300  | 388.20 | 3,998,460.00  |  |
| SAFRAN SA                    | 82,400  | 187.88 | 15,481,312.00 |  |
| THALES SA                    | 25,000  | 140.65 | 3,516,250.00  |  |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)   | 109,000 | 69.13  | 7,535,170.00  |  |
| KINGSPAN GROUP PLC           | 36,800  | 82.00  | 3,017,600.00  |  |
| ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV  | 53,209  | 36.39  | 1,936,275.51  |  |
| BOUYGUES                     | 43,000  | 34.30  | 1,474,900.00  |  |
| EIFFAGE SA                   | 18,100  | 96.66  | 1,749,546.00  |  |
| FERROVIAL SE                 | 119,606 | 34.81  | 4,163,484.86  |  |
| VINCI                        | 122,400 | 113.24 | 13,860,576.00 |  |
| LEGRAND SA                   | 64,500  | 92.02  | 5,935,290.00  |  |
| PRYSMIAN SPA                 | 65,000  | 43.70  | 2,840,500.00  |  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE        | 130,800 | 201.90 | 26,408,520.00 |  |
| SIEMENS ENERGY AG            | 120,000 | 13.89  | 1,667,400.00  |  |
| SIEMENS AG                   | 181,900 | 169.22 | 30,781,118.00 |  |
| ALSTOM                       | 71,000  | 11.69  | 830,345.00    |  |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG     | 129,000 | 35.55  | 4,585,950.00  |  |
| GEA GROUP AG                 | 41,000  | 37.77  | 1,548,570.00  |  |
| KNORR-BREMSE AG              | 18,600  | 58.74  | 1,092,564.00  |  |
| KONE OYJ                     | 80,000  | 47.00  | 3,760,000.00  |  |
| METSO CORPORATION            | 163,000 | 10.39  | 1,694,385.00  |  |
| RATIONAL AG                  | 1,360   | 764.50 | 1,039,720.00  |  |
| WARTSILA OYJ                 | 115,000 | 14.64  | 1,684,175.00  |  |
| BRENNTAG SE                  | 34,100  | 80.32  | 2,738,912.00  |  |
| IMCD NV                      | 12,600  | 142.65 | 1,797,390.00  |  |
| DHL GROUP                    | 237,000 | 42.72  | 10,124,640.00 |  |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG       | 137,000 | 7.41   | 1,015,307.00  |  |
| ADP                          | 9,000   | 121.30 | 1,091,700.00  |  |
| AENA SME SA                  | 18,600  | 167.20 | 3,109,920.00  |  |
| GETLINK                      | 88,000  | 15.30  | 1,346,840.00  |  |
| CONTINENTAL AG               | 26,000  | 77.06  | 2,003,560.00  |  |
| MICHELIN (CGDE)              | 164,000 | 33.28  | 5,457,920.00  |  |
| BAYER MOTOREN WERK           | 75,900  | 104.10 | 7,901,190.00  |  |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 15,000  | 98.05  | 1,470,750.00  |  |
| DR ING HC F PORSCHE AG       | 27,700  | 80.62  | 2,233,174.00  |  |
| FERRARI NV                   | 30,200  | 363.00 | 10,962,600.00 |  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG       | 191,700 | 67.38  | 12,916,746.00 |  |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 35,200  | 47.47  | 1,670,944.00  |  |

|                                     |         |          |               |  |
|-------------------------------------|---------|----------|---------------|--|
| RENAULT SA                          | 46,000  | 38.28    | 1,761,110.00  |  |
| STELLANTIS NV                       | 524,000 | 23.77    | 12,458,100.00 |  |
| VOLKSWAGEN AG                       | 6,300   | 135.75   | 855,225.00    |  |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                  | 48,600  | 119.66   | 5,815,476.00  |  |
| SEB SA                              | 5,400   | 113.20   | 611,280.00    |  |
| ADIDAS AG                           | 38,100  | 176.24   | 6,714,744.00  |  |
| HERMES INTERNATIONAL                | 7,630   | 2,199.00 | 16,778,370.00 |  |
| KERING SA                           | 17,900  | 428.10   | 7,662,990.00  |  |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 66,090  | 815.80   | 53,916,222.00 |  |
| MONCLER SPA                         | 49,000  | 62.52    | 3,063,480.00  |  |
| PUMA SE                             | 24,100  | 42.21    | 1,017,261.00  |  |
| ACCOR SA                            | 46,000  | 36.98    | 1,701,080.00  |  |
| AMADEUS IT GROUP SA                 | 108,200 | 60.50    | 6,546,100.00  |  |
| DELIVERY HERO SE                    | 38,000  | 22.59    | 858,610.00    |  |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM          | 24,000  | 39.38    | 945,120.00    |  |
| SODEXO                              | 20,400  | 76.46    | 1,559,784.00  |  |
| D'IETEREN GROUP                     | 5,400   | 172.80   | 933,120.00    |  |
| PROSUS NV                           | 354,000 | 28.94    | 10,246,530.00 |  |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA       | 261,000 | 39.60    | 10,335,600.00 |  |
| ZALANDO SE                          | 50,000  | 19.82    | 991,000.00    |  |
| CARREFOUR SUPERMARCHE               | 143,000 | 15.21    | 2,175,030.00  |  |
| HELLOFRESH SE                       | 35,000  | 12.39    | 433,825.00    |  |
| JERONIMO MARTINS                    | 64,000  | 21.80    | 1,395,200.00  |  |
| KESKO OYJ-B SHS                     | 70,000  | 17.93    | 1,255,100.00  |  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV       | 228,000 | 27.31    | 6,227,820.00  |  |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV          | 210,000 | 57.81    | 12,140,100.00 |  |
| DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV            | 158,000 | 9.97     | 1,575,576.00  |  |
| HEINEKEN HOLDING NV                 | 30,400  | 73.70    | 2,240,480.00  |  |
| HEINEKEN NV                         | 68,600  | 88.94    | 6,101,284.00  |  |
| PERNOD RICARD SA                    | 49,100  | 157.15   | 7,716,065.00  |  |
| REMY COINTREAU                      | 4,900   | 98.94    | 484,806.00    |  |
| DANONE                              | 152,500 | 61.30    | 9,348,250.00  |  |
| JDE PEET'S BV                       | 31,000  | 22.56    | 699,360.00    |  |
| KERRY GROUP PLC-A                   | 39,100  | 76.62    | 2,995,842.00  |  |
| LOTUS BAKERIES                      | 92      | 9,110.00 | 838,120.00    |  |
| HENKEL AG & CO KGAA                 | 26,400  | 63.18    | 1,667,952.00  |  |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG          | 41,000  | 70.34    | 2,883,940.00  |  |
| BEIERSDORF AG                       | 24,600  | 137.25   | 3,376,350.00  |  |
| LOREAL-ORD                          | 57,700  | 442.40   | 25,526,480.00 |  |
| BIOMERIEUX                          | 8,800   | 103.80   | 913,440.00    |  |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR            | 8,600   | 111.40   | 958,040.00    |  |
| DIASORIN ITALIA SPA                 | 6,000   | 90.26    | 541,560.00    |  |
| ESSILORLUXOTTICA                    | 71,100  | 187.42   | 13,325,562.00 |  |

|                                      |           |          |               |
|--------------------------------------|-----------|----------|---------------|
| KONINKLIJKE PHILIPS NV               | 185,998   | 18.92    | 3,519,082.16  |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG              | 66,000    | 55.08    | 3,635,280.00  |
| AMPLIFON SPA                         | 30,000    | 31.86    | 955,800.00    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG            | 51,000    | 38.99    | 1,988,490.00  |
| FRESENIUS SE & CO KGAA               | 99,000    | 26.44    | 2,617,560.00  |
| ARGENX SE                            | 14,100    | 365.60   | 5,154,960.00  |
| GRIFOLS SA                           | 63,000    | 10.60    | 668,115.00    |
| BAYER AG-REG                         | 238,000   | 28.61    | 6,809,180.00  |
| IPSEN                                | 9,000     | 104.90   | 944,100.00    |
| MERCK KGAA                           | 31,300    | 155.70   | 4,873,410.00  |
| ORION OYJ                            | 24,200    | 39.98    | 967,516.00    |
| RECORDATI SPA                        | 24,000    | 51.02    | 1,224,480.00  |
| SANOFI                               | 272,400   | 86.46    | 23,551,704.00 |
| UCB SA                               | 29,100    | 94.90    | 2,761,590.00  |
| ABN AMRO BANK NV-CVA                 | 120,000   | 14.98    | 1,798,200.00  |
| AIB GROUP PLC                        | 360,000   | 4.06     | 1,461,600.00  |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. | 1,440,000 | 9.01     | 12,983,040.00 |
| BANCO BPM SPA                        | 300,000   | 4.91     | 1,474,800.00  |
| BANCO SANTANDER SA                   | 3,900,000 | 3.67     | 14,324,700.00 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC            | 265,000   | 8.46     | 2,241,900.00  |
| BNP PARIBAS                          | 253,000   | 54.38    | 13,758,140.00 |
| CAIXABANK                            | 980,000   | 3.96     | 3,883,740.00  |
| COMMERZBANK AG                       | 256,000   | 10.82    | 2,769,920.00  |
| CREDIT AGRICOLE SA                   | 251,000   | 12.23    | 3,069,730.00  |
| ERSTE GROUP BANK AG                  | 82,000    | 39.21    | 3,215,220.00  |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA          | 139,000   | 13.08    | 1,818,815.00  |
| ING GROEP NV                         | 856,000   | 12.38    | 10,600,704.00 |
| INTESA SANPAOLO                      | 3,690,000 | 2.82     | 10,424,250.00 |
| KBC GROEP NV                         | 59,600    | 63.10    | 3,760,760.00  |
| MEDIOBANCA S.P.A.                    | 124,000   | 11.69    | 1,450,180.00  |
| NORDEA BANK ABP                      | 767,000   | 10.98    | 8,423,194.00  |
| SOCIETE GENERALE                     | 173,000   | 22.00    | 3,806,865.00  |
| UNICREDIT SPA                        | 388,000   | 29.79    | 11,558,520.00 |
| ADYEN NV                             | 5,110     | 1,507.80 | 7,704,858.00  |
| EDENRED                              | 61,000    | 55.48    | 3,384,280.00  |
| EURAZEO SE                           | 10,700    | 78.30    | 837,810.00    |
| EXOR NV                              | 24,300    | 98.36    | 2,390,148.00  |
| GROUPE BRUXELLES LAM                 | 21,400    | 70.68    | 1,512,552.00  |
| NEXI SPA                             | 130,000   | 7.21     | 938,340.00    |
| SOFINA SA                            | 3,700     | 218.20   | 807,340.00    |
| WORLDLINE SA                         | 54,000    | 12.02    | 649,350.00    |
| AEGON LTD                            | 400,000   | 5.37     | 2,149,600.00  |
| AGEAS                                | 36,000    | 39.11    | 1,407,960.00  |

|                              |           |        |               |  |
|------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
|                              |           |        |               |  |
| ALLIANZ SE-REG               | 96,900    | 247.10 | 23,943,990.00 |  |
| ASR NEDERLAND NV             | 36,000    | 43.22  | 1,555,920.00  |  |
| ASSICURAZIONI GENERALI       | 247,000   | 20.87  | 5,154,890.00  |  |
| AXA SA                       | 433,000   | 30.98  | 13,414,340.00 |  |
| HANNOVER RUECK SE            | 14,000    | 228.80 | 3,203,200.00  |  |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG   | 32,900    | 408.70 | 13,446,230.00 |  |
| NN GROUP NV                  | 67,000    | 37.42  | 2,507,140.00  |  |
| POSTE ITALIANE SPA           | 120,000   | 10.03  | 1,204,200.00  |  |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 106,000   | 41.53  | 4,402,180.00  |  |
| TALANX AG                    | 14,000    | 65.70  | 919,800.00    |  |
| BECHTLE AG                   | 20,000    | 49.23  | 984,600.00    |  |
| CAPGEMINI SA                 | 37,900    | 219.70 | 8,326,630.00  |  |
| DASSAULT SYSTEMES SE         | 159,000   | 43.45  | 6,909,345.00  |  |
| NEMETSCHEK SE                | 14,200    | 86.36  | 1,226,312.00  |  |
| SAP SE                       | 249,900   | 165.08 | 41,253,492.00 |  |
| NOKIA OYJ                    | 1,280,000 | 3.28   | 4,210,560.00  |  |
| ASM INTERNATIONAL NV         | 11,400    | 581.30 | 6,626,820.00  |  |
| ASML HOLDING NV              | 96,490    | 874.60 | 84,390,154.00 |  |
| BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES  | 17,400    | 161.90 | 2,817,060.00  |  |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG     | 315,000   | 33.46  | 10,539,900.00 |  |
| STMICROELECTRONICS NV        | 163,000   | 42.56  | 6,938,095.00  |  |
| CELLNEX TELECOM SA           | 134,000   | 33.17  | 4,444,780.00  |  |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG         | 780,000   | 22.18  | 17,304,300.00 |  |
| ELISA OYJ                    | 36,000    | 42.34  | 1,524,240.00  |  |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 72,000    | 10.65  | 766,800.00    |  |
| KONINKLIJKE KPN NV           | 830,000   | 3.31   | 2,753,940.00  |  |
| ORANGE SA                    | 455,000   | 10.76  | 4,898,530.00  |  |
| TELECOM ITALIA SPA           | 2,700,000 | 0.27   | 750,870.00    |  |
| TELEFONICA SA                | 1,200,000 | 3.56   | 4,273,200.00  |  |
| ACCIONA S.A.                 | 5,800     | 109.15 | 633,070.00    |  |
| ELIA GROUP SA/NV             | 6,626     | 105.00 | 695,730.00    |  |
| ENDESA S.A.                  | 75,000    | 16.48  | 1,236,000.00  |  |
| ENEL SPA                     | 1,962,000 | 5.87   | 11,524,788.00 |  |
| ENERGIAS DE PORTUGAL         | 730,000   | 3.76   | 2,750,640.00  |  |
| FORTUM OYJ                   | 100,000   | 11.14  | 1,114,000.00  |  |
| IBERDROLA SA                 | 1,461,777 | 10.77  | 15,750,647.17 |  |
| REDEIA CORP SA               | 89,000    | 14.72  | 1,310,080.00  |  |
| TERNA SPA                    | 332,000   | 7.35   | 2,441,528.00  |  |
| VERBUND AG                   | 16,900    | 64.20  | 1,084,980.00  |  |
| ENAGAS SA                    | 60,000    | 14.47  | 868,500.00    |  |
| NATURGY ENERGY GROUP SA      | 32,000    | 22.94  | 734,080.00    |  |
| SNAM SPA                     | 460,000   | 4.38   | 2,016,180.00  |  |

|      |                          |                                      |         |               |                   |  |
|------|--------------------------|--------------------------------------|---------|---------------|-------------------|--|
|      |                          | E.ON SE                              | 545,000 | 11.75         | 6,406,475.00      |  |
|      |                          | ENGIE                                | 443,000 | 14.32         | 6,344,646.00      |  |
|      |                          | VEOLIA ENVIRONNEMENT                 | 163,000 | 29.24         | 4,766,120.00      |  |
|      |                          | AMUNDI SA                            | 12,800  | 60.35         | 772,480.00        |  |
|      |                          | DEUTSCHE BANK AG-REG                 | 472,000 | 11.98         | 5,655,504.00      |  |
|      |                          | DEUTSCHE BOERSE AG                   | 45,100  | 187.65        | 8,463,015.00      |  |
|      |                          | EURONEXT NV                          | 21,200  | 82.15         | 1,741,580.00      |  |
|      |                          | CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES S A | 14,000  | 21.14         | 295,960.00        |  |
|      |                          | EDP RENOVAVEIS SA                    | 66,880  | 14.15         | 946,352.00        |  |
|      |                          | RWE AG                               | 149,000 | 31.80         | 4,738,200.00      |  |
|      |                          | EUROFINS SCIENTIFIC SE               | 30,600  | 57.84         | 1,769,904.00      |  |
|      |                          | QIAGEN N.V.                          | 50,440  | 39.96         | 2,015,582.40      |  |
|      |                          | SARTORIUS AG-VORZUG                  | 6,200   | 337.70        | 2,093,740.00      |  |
|      |                          | SARTORIUS STEDIM BIOTECH             | 7,000   | 253.80        | 1,776,600.00      |  |
|      |                          | BUREAU VERITAS SA                    | 68,000  | 25.27         | 1,718,360.00      |  |
|      |                          | RANDSTAD NV                          | 25,500  | 51.62         | 1,316,310.00      |  |
|      |                          | TELEPERFORMANCE                      | 13,300  | 135.30        | 1,799,490.00      |  |
|      |                          | WOLTERS KLUWER                       | 60,400  | 143.95        | 8,694,580.00      |  |
|      |                          | PUBLICIS GROUPE                      | 55,400  | 97.38         | 5,394,852.00      |  |
|      |                          | VIVENDI SE                           | 164,000 | 10.30         | 1,690,020.00      |  |
|      |                          | BOLLORE SE                           | 162,000 | 6.16          | 998,730.00        |  |
|      |                          | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV             | 196,000 | 26.87         | 5,266,520.00      |  |
|      |                          | SCOUT24 SE                           | 17,900  | 66.00         | 1,181,400.00      |  |
|      |                          | LEG IMMOBILIE SE                     | 17,000  | 71.30         | 1,212,100.00      |  |
|      |                          | VONOVIA SE                           | 179,000 | 26.66         | 4,772,140.00      |  |
|      |                          | 小計銘柄数：220                            |         |               | 1,198,479,564.10  |  |
|      |                          |                                      |         |               | (193,925,978,267) |  |
|      |                          | 組入時価比率：9.1%                          |         |               | 9.4%              |  |
| 英ボンド | BP PLC                   | 4,100,000                            | 4.72    | 19,352,000.00 |                   |  |
|      | SHELL PLC-NEW            | 1,584,000                            | 24.97   | 39,552,480.00 |                   |  |
|      | CRODA INTERNATIONAL PLC  | 35,000                               | 50.40   | 1,764,000.00  |                   |  |
|      | CRH PLC                  | 169,200                              | 61.28   | 10,368,576.00 |                   |  |
|      | ANGLO AMERICAN PLC       | 309,000                              | 18.02   | 5,568,798.00  |                   |  |
|      | ANTOFAGASTA PLC          | 89,000                               | 17.85   | 1,588,650.00  |                   |  |
|      | ENDEAVOUR MINING PLC     | 41,000                               | 13.00   | 533,000.00    |                   |  |
|      | GLENCORE PLC             | 2,490,000                            | 3.99    | 9,948,795.00  |                   |  |
|      | RIO TINTO PLC-REG        | 268,300                              | 55.15   | 14,796,745.00 |                   |  |
|      | MONDI PLC                | 102,727                              | 13.75   | 1,412,496.25  |                   |  |
|      | BAE SYSTEMS PLC          | 735,000                              | 12.42   | 9,128,700.00  |                   |  |
|      | MELROSE INDUSTRIES PLC   | 305,000                              | 6.10    | 1,862,940.00  |                   |  |
|      | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 2,020,000                            | 3.23    | 6,530,660.00  |                   |  |
|      | DCC PLC                  | 25,000                               | 57.48   | 1,437,000.00  |                   |  |
|      | SMITHS GROUP PLC         | 80,000                               | 16.44   | 1,315,600.00  |                   |  |

|                                   |            |        |               |
|-----------------------------------|------------|--------|---------------|
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC      | 17,000     | 104.55 | 1,777,350.00  |
| ASHTED GROUP PLC                  | 107,000    | 54.00  | 5,778,000.00  |
| BUNZLE                            | 84,000     | 32.15  | 2,700,600.00  |
| RENTOKIL INITIAL PLC              | 586,000    | 4.27   | 2,506,908.00  |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC          | 250,000    | 4.78   | 1,195,000.00  |
| PERSIMMON PLC                     | 77,000     | 14.22  | 1,094,940.00  |
| TAYLOR WIMPEY PLC                 | 840,000    | 1.45   | 1,223,880.00  |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS         | 24,300     | 47.20  | 1,146,960.00  |
| BURBERRY GROUP PLC                | 91,000     | 13.38  | 1,218,035.00  |
| COMPASS GROUP PLC                 | 410,000    | 21.91  | 8,983,100.00  |
| ENTAIN PLC                        | 150,000    | 9.33   | 1,400,100.00  |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI      | 41,500     | 170.85 | 7,090,275.00  |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 38,200     | 77.60  | 2,964,320.00  |
| WHITBREAD PLC                     | 46,000     | 34.82  | 1,601,720.00  |
| NEXT PLC                          | 28,600     | 84.70  | 2,422,420.00  |
| JD SPORTS FASHION PLC             | 610,000    | 1.12   | 683,810.00    |
| KINGFISHER PLC                    | 450,000    | 2.27   | 1,024,200.00  |
| OCADO GROUP PLC                   | 148,000    | 5.36   | 793,280.00    |
| SAINSBURY                         | 400,000    | 2.53   | 1,013,600.00  |
| TESCO PLC                         | 1,690,000  | 2.79   | 4,725,240.00  |
| COCA-COLA HBC AG-DI               | 54,000     | 24.62  | 1,329,480.00  |
| DIAGEO PLC                        | 541,000    | 29.27  | 15,837,775.00 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC      | 79,000     | 22.86  | 1,805,940.00  |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC      | 507,000    | 24.13  | 12,236,445.00 |
| IMPERIAL BRANDS PLC               | 207,000    | 18.45  | 3,819,150.00  |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 173,300    | 57.66  | 9,992,478.00  |
| HALEON PLC                        | 1,320,000  | 3.23   | 4,263,600.00  |
| UNILEVER PLC                      | 598,300    | 40.29  | 24,108,498.50 |
| SMITH & NEPHEW PLC                | 217,000    | 11.17  | 2,423,890.00  |
| NMC HEALTH PLC                    | 13,300     | 0.00   | 0.00          |
| ASTRAZENECA PLC                   | 370,980    | 100.94 | 37,446,721.20 |
| GSK PLC                           | 986,000    | 16.76  | 16,529,304.00 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC         | 37,000     | 19.87  | 735,375.00    |
| BARCLAYS PLC                      | 3,640,000  | 1.46   | 5,340,608.00  |
| HSBC HOLDINGS PLC                 | 4,664,000  | 6.38   | 29,793,632.00 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC          | 15,100,000 | 0.43   | 6,523,200.00  |
| NATWEST GROUP PLC                 | 1,410,000  | 2.29   | 3,235,950.00  |
| STANDARD CHARTERED PLC            | 560,000    | 5.94   | 3,329,760.00  |
| M&G PLC                           | 500,000    | 2.24   | 1,121,500.00  |
| WISE PLC - A                      | 137,000    | 8.50   | 1,164,500.00  |
| ADMIRAL GROUP PLC                 | 61,000     | 25.89  | 1,579,290.00  |
| AVIVA PLC                         | 650,000    | 4.32   | 2,811,250.00  |
| LEGAL & GENERAL                   | 1,420,000  | 2.40   | 3,410,840.00  |

|        |                                 |           |          |                                    |
|--------|---------------------------------|-----------|----------|------------------------------------|
|        |                                 |           |          |                                    |
|        | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC      | 170,000   | 5.05     | 858,500.00                         |
|        | PRUDENTIAL PLC                  | 670,000   | 8.34     | 5,590,480.00                       |
|        | SAGE GROUP PLC (THE)            | 239,000   | 11.78    | 2,815,420.00                       |
|        | HALMA PLC                       | 92,000    | 22.53    | 2,072,760.00                       |
|        | BT GROUP PLC                    | 1,510,000 | 1.06     | 1,603,620.00                       |
|        | VODAFONE GROUP PLC              | 5,380,000 | 0.65     | 3,530,894.00                       |
|        | SSE PLC                         | 263,000   | 15.95    | 4,196,165.00                       |
|        | CENTRICA PLC                    | 1,270,000 | 1.39     | 1,766,570.00                       |
|        | NATIONAL GRID PLC               | 882,000   | 10.16    | 8,961,120.00                       |
|        | SEVERN TRENT PLC                | 66,000    | 25.54    | 1,685,640.00                       |
|        | UNITED UTILITIES GROUP PLC      | 167,000   | 10.43    | 1,741,810.00                       |
|        | 3I GROUP PLC                    | 232,000   | 24.76    | 5,744,320.00                       |
|        | ABRDN PLC                       | 440,000   | 1.64     | 722,920.00                         |
|        | HARGREAVES LANSDOWN PLC         | 82,000    | 8.29     | 680,272.00                         |
|        | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 100,600   | 88.88    | 8,941,328.00                       |
|        | SCHRODERS PLC                   | 189,176   | 4.08     | 772,405.60                         |
|        | ST JAMES S PLACE PLC            | 118,000   | 6.55     | 773,136.00                         |
|        | PEARSON                         | 143,000   | 9.69     | 1,386,814.00                       |
|        | EXPERIAN PLC                    | 219,000   | 33.96    | 7,437,240.00                       |
|        | INTERTEK GROUP PLC              | 39,000    | 44.30    | 1,727,700.00                       |
|        | RELX PLC                        | 455,000   | 34.02    | 15,479,100.00                      |
|        | INFORMA PLC                     | 335,000   | 8.17     | 2,736,950.00                       |
|        | WPP PLC                         | 257,000   | 7.82     | 2,009,740.00                       |
|        | AUTO TRADER GROUP PLC           | 223,000   | 7.21     | 1,609,168.00                       |
| 小計     | 銘柄数：82                          |           |          | 450,187,437.55<br>(85,242,991,300) |
|        | 組入時価比率：4.0%                     |           |          | 4.1%                               |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG                 | 53,000    | 11.07    | 586,710.00                         |
|        | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG       | 1,630     | 624.50   | 1,017,935.00                       |
|        | GIVAUDAN-REG                    | 2,190     | 3,667.00 | 8,030,730.00                       |
|        | SIKA AG-REG                     | 36,200    | 254.30   | 9,205,660.00                       |
|        | HOLCIM LTD                      | 124,900   | 67.74    | 8,460,726.00                       |
|        | SIG GROUP AG                    | 74,000    | 18.02    | 1,333,480.00                       |
|        | GEBERIT AG-REG                  | 7,900     | 512.40   | 4,047,960.00                       |
|        | ABB LTD                         | 385,000   | 40.04    | 15,415,400.00                      |
|        | SCHINDLER HOLDING AG-REG        | 5,900     | 222.60   | 1,313,340.00                       |
|        | SCHINDLER HOLDING-PART CERT     | 9,300     | 231.20   | 2,150,160.00                       |
|        | VAT GROUP AG                    | 6,600     | 429.50   | 2,834,700.00                       |
|        | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG      | 13,200    | 282.10   | 3,723,720.00                       |
|        | CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A   | 124,500   | 137.05   | 17,062,725.00                      |
|        | THE SWATCH GROUP AG-B           | 6,900     | 217.70   | 1,502,130.00                       |
|        | THE SWATCH GROUP AG-REG         | 10,500    | 41.95    | 440,475.00                         |



|               |                              |         |            |                  |  |
|---------------|------------------------------|---------|------------|------------------|--|
|               | AVOLTA AG                    | 22,000  | 35.54      | 781,880.00       |  |
|               | BARRY CALLEBAUT AG           | 810     | 1,299.00   | 1,052,190.00     |  |
|               | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC   | 227     | 11,200.00  | 2,542,400.00     |  |
|               | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG  | 26      | 111,000.00 | 2,886,000.00     |  |
|               | NESTLE SA-REG                | 639,000 | 97.15      | 62,078,850.00    |  |
|               | ALCON INC                    | 121,000 | 68.46      | 8,283,660.00     |  |
|               | SONOVA HOLDING AG-REG        | 12,400  | 284.30     | 3,525,320.00     |  |
|               | STRAUMANN HOLDING AG-REG     | 27,000  | 144.65     | 3,905,550.00     |  |
|               | NOVARTIS AG-REG              | 490,600 | 88.44      | 43,388,664.00    |  |
|               | ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 168,200 | 228.20     | 38,383,240.00    |  |
|               | ROCHE HOLDINGS AG-BEARER     | 7,400   | 241.60     | 1,787,840.00     |  |
|               | SANDOZ GROUP AG              | 101,000 | 28.71      | 2,899,710.00     |  |
|               | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 6,500   | 106.50     | 692,250.00       |  |
|               | BALOISE HOLDING AG           | 11,300  | 143.20     | 1,618,160.00     |  |
|               | HELVETIA HOLDING AG-REG      | 8,300   | 123.20     | 1,022,560.00     |  |
|               | SWISS LIFE HOLDING AG        | 7,150   | 638.00     | 4,561,700.00     |  |
|               | SWISS RE LTD                 | 71,600  | 100.95     | 7,228,020.00     |  |
|               | ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 34,900  | 441.40     | 15,404,860.00    |  |
|               | TEMENOS AG-REG               | 16,400  | 60.62      | 994,168.00       |  |
|               | LOGITECH INTERNATIONAL-REG   | 40,500  | 76.56      | 3,100,680.00     |  |
|               | SWISSCOM AG-REG              | 6,040   | 509.40     | 3,076,776.00     |  |
|               | BKW AG                       | 4,600   | 133.20     | 612,720.00       |  |
|               | JULIUS BAER GROUP LTD        | 49,900  | 49.42      | 2,466,058.00     |  |
|               | PARTNERS GROUP HOLDING AG    | 5,410   | 1,230.00   | 6,654,300.00     |  |
|               | UBS GROUP AG                 | 791,000 | 24.48      | 19,363,680.00    |  |
|               | BACHEM HOLDING AG-REG B      | 7,900   | 65.65      | 518,635.00       |  |
|               | LONZA AG-REG                 | 18,100  | 457.10     | 8,273,510.00     |  |
|               | ADECCO GROUP AG-REG          | 38,000  | 36.65      | 1,392,700.00     |  |
|               | SGS SA-REG                   | 35,100  | 84.62      | 2,970,162.00     |  |
|               | SWISS PRIME SITE-REG         | 17,500  | 85.75      | 1,500,625.00     |  |
| 小計            | 銘柄数：45                       |         |            | 330,092,719.00   |  |
|               |                              |         |            | (56,277,507,662) |  |
|               | 組入時価比率：2.6%                  |         |            | 2.7%             |  |
| スウェーデン<br>ローナ | BOLIDEN AB                   | 66,000  | 277.50     | 18,315,000.00    |  |
|               | HOLMEN AB-B SHARES           | 24,000  | 403.30     | 9,679,200.00     |  |
|               | SVENSKA CELLULOSA AB-B       | 137,000 | 139.85     | 19,159,450.00    |  |
|               | SAAB AB-B                    | 18,000  | 792.20     | 14,259,600.00    |  |
|               | ASSA ABLOY AB-B              | 237,000 | 287.00     | 68,019,000.00    |  |
|               | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS     | 374,000 | 58.42      | 21,849,080.00    |  |
|               | SKANSKA AB-B SHS             | 77,000  | 186.75     | 14,379,750.00    |  |
|               | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS   | 33,000  | 265.00     | 8,745,000.00     |  |
|               | LIFCO AB-B SHS               | 52,000  | 273.50     | 14,222,000.00    |  |
|               | ALFA LAVAL AB                | 69,000  | 378.60     | 26,123,400.00    |  |

|               |                                  |         |          |                                      |  |
|---------------|----------------------------------|---------|----------|--------------------------------------|--|
|               | ATLAS COPCO AB-A SHS             | 643,000 | 176.80   | 113,682,400.00                       |  |
|               | ATLAS COPCO AB-B SHS             | 370,000 | 154.10   | 57,017,000.00                        |  |
|               | EPIROC AB - A                    | 164,000 | 195.85   | 32,119,400.00                        |  |
|               | EPIROC AB - B                    | 89,000  | 173.50   | 15,441,500.00                        |  |
|               | HUSQVARNA AB-B SHS               | 94,000  | 78.62    | 7,390,280.00                         |  |
|               | INDUTRADE AB                     | 64,000  | 279.00   | 17,856,000.00                        |  |
|               | SANDVIK AB                       | 250,000 | 224.10   | 56,025,000.00                        |  |
|               | SKF AB-B SHARES                  | 76,000  | 218.40   | 16,598,400.00                        |  |
|               | VOLVO AB-A SHS                   | 50,000  | 277.20   | 13,860,000.00                        |  |
|               | VOLVO AB-B SHS                   | 366,000 | 270.00   | 98,820,000.00                        |  |
|               | BEIJER REF AB                    | 94,000  | 144.70   | 13,601,800.00                        |  |
|               | SECURITAS AB-B SHS               | 110,857 | 106.95   | 11,856,156.15                        |  |
|               | VOLVO CAR AB-B                   | 120,000 | 38.60    | 4,632,000.00                         |  |
|               | EVOLUTION AB                     | 44,800  | 1,311.60 | 58,759,680.00                        |  |
|               | HENNES&MAURITZ AB-B              | 155,000 | 142.38   | 22,068,900.00                        |  |
|               | ESSITY AKTIEBOLAG-B              | 141,000 | 239.20   | 33,727,200.00                        |  |
|               | GETINGE AB-B SHS                 | 53,000  | 205.30   | 10,880,900.00                        |  |
|               | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB      | 50,143  | 254.40   | 12,756,379.20                        |  |
|               | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 388,000 | 153.80   | 59,674,400.00                        |  |
|               | SVENSKA HANDELSBANKEN-A          | 342,000 | 122.75   | 41,980,500.00                        |  |
|               | SWEDBANK AB                      | 209,000 | 217.90   | 45,541,100.00                        |  |
|               | INDUSTRIVARDEN AB-A SHS          | 31,000  | 341.60   | 10,589,600.00                        |  |
|               | INDUSTRIVARDEN AB-C SHS          | 40,000  | 341.40   | 13,656,000.00                        |  |
|               | INVESTOR AB-B SHS                | 411,000 | 255.40   | 104,969,400.00                       |  |
|               | LUNDBERGS AB-B SHS               | 20,000  | 559.80   | 11,196,000.00                        |  |
|               | ERICSSON LM-B                    | 710,000 | 55.63    | 39,497,300.00                        |  |
|               | HEXAGON AB-B SHS                 | 498,000 | 118.25   | 58,888,500.00                        |  |
|               | TELIA CO AB                      | 580,000 | 24.45    | 14,181,000.00                        |  |
|               | TELE 2 AB-B SHS                  | 116,000 | 83.44    | 9,679,040.00                         |  |
|               | EQT AB                           | 81,000  | 279.10   | 22,607,100.00                        |  |
|               | FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS      | 141,000 | 66.90    | 9,432,900.00                         |  |
|               | SAGAX AB-B                       | 50,000  | 252.60   | 12,630,000.00                        |  |
| 小計            | 銘柄数：42                           |         |          | 1,266,367,315.35<br>(18,223,025,667) |  |
|               | 組入時価比率：0.9%                      |         |          | 0.9%                                 |  |
| ノルウェーク<br>ローネ | AKER BP ASA                      | 72,000  | 261.30   | 18,813,600.00                        |  |
|               | EQUINOR ASA                      | 219,000 | 266.05   | 58,264,950.00                        |  |
|               | YARA INTERNATIONAL ASA           | 37,000  | 355.00   | 13,135,000.00                        |  |
|               | NORSK HYDRO                      | 330,000 | 58.30    | 19,239,000.00                        |  |
|               | KONGSBERG GRUPPEN ASA            | 21,000  | 655.00   | 13,755,000.00                        |  |
|               | MOWI ASA                         | 109,000 | 201.90   | 22,007,100.00                        |  |
|               | ORKLA ASA                        | 180,000 | 75.00    | 13,500,000.00                        |  |
|               | SALMAR ASA                       | 16,000  | 632.40   | 10,118,400.00                        |  |

|  |               |                             |           |           |                  |      |
|--|---------------|-----------------------------|-----------|-----------|------------------|------|
|  | 小計            | DNB BANK ASA                | 215,000   | 206.10    | 44,311,500.00    |      |
|  |               | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA   | 52,000    | 172.60    | 8,975,200.00     |      |
|  |               | TELENOR ASA                 | 165,000   | 114.15    | 18,834,750.00    |      |
|  |               | ADEVINTA ASA                | 93,000    | 114.60    | 10,657,800.00    |      |
|  |               | 銘柄数：12                      |           |           | 251,612,300.00   |      |
|  |               | 組入時価比率：0.2%                 |           |           | (3,593,023,644)  | 0.2% |
|  | デンマーク<br>クローネ | NOVOZYMES A/S-B SHARES      | 86,016    | 373.50    | 32,126,976.00    |      |
|  |               | ROCKWOOL A/S-B SHS          | 2,600     | 2,204.00  | 5,730,400.00     |      |
|  |               | VESTAS WIND SYSTEMS A/S     | 246,000   | 188.54    | 46,380,840.00    |      |
|  |               | DSV A/S                     | 44,300    | 1,143.00  | 50,634,900.00    |      |
|  |               | A P MOLLER - MAERSK A/S-A   | 720       | 10,400.00 | 7,488,000.00     |      |
|  |               | AP MOLLER-MAERSK A/S-B      | 1,220     | 10,535.00 | 12,852,700.00    |      |
|  |               | PANDORA A/S                 | 20,000    | 1,134.00  | 22,680,000.00    |      |
|  |               | CARLSBERG B                 | 23,400    | 944.80    | 22,108,320.00    |      |
|  |               | COLOPLAST-B                 | 31,500    | 894.00    | 28,161,000.00    |      |
|  |               | DEMANT A/S                  | 25,000    | 366.00    | 9,150,000.00     |      |
|  |               | GENMAB A/S                  | 15,800    | 1,989.00  | 31,426,200.00    |      |
|  |               | NOVO NORDISK A/S-B          | 781,100   | 850.90    | 664,637,990.00   |      |
|  |               | DANSKE BANK AS              | 166,000   | 193.55    | 32,129,300.00    |      |
|  |               | TRYG A/S                    | 83,000    | 145.55    | 12,080,650.00    |      |
|  |               | ORSTED A/S                  | 43,300    | 397.20    | 17,198,760.00    |      |
|  |               | 銘柄数：15                      |           |           | 994,786,036.00   |      |
|  |               | 組入時価比率：1.0%                 |           |           | (21,586,856,981) | 1.0% |
|  | 豪ドル           | AMPOL LTD                   | 59,000    | 37.59     | 2,217,810.00     |      |
|  |               | SANTOS LTD.                 | 760,000   | 7.37      | 5,601,200.00     |      |
|  |               | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD   | 460,000   | 30.70     | 14,122,000.00    |      |
|  |               | ORICA LTD                   | 99,000    | 16.73     | 1,656,270.00     |      |
|  |               | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 108,000   | 57.30     | 6,188,400.00     |      |
|  |               | BHP GROUP LIMITED           | 1,213,000 | 45.61     | 55,324,930.00    |      |
|  |               | BLUESCOPE STEEL LTD         | 104,000   | 22.85     | 2,376,400.00     |      |
|  |               | FORTESCUE LTD               | 404,000   | 28.40     | 11,473,600.00    |      |
|  |               | IGO LTD                     | 150,000   | 7.49      | 1,123,500.00     |      |
|  |               | MINERAL RESOURCES LTD       | 42,000    | 59.75     | 2,509,500.00     |      |
|  |               | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 288,000   | 13.16     | 3,790,080.00     |      |
|  |               | PILBARA MINERALS LTD        | 630,000   | 3.71      | 2,337,300.00     |      |
|  |               | RIO TINTO LTD               | 88,300    | 128.96    | 11,387,168.00    |      |
|  |               | SOUTH32 LTD                 | 1,110,000 | 2.88      | 3,196,800.00     |      |
|  |               | REECE LTD                   | 49,000    | 23.12     | 1,132,880.00     |      |
|  |               | BRAMBLES LTD                | 344,000   | 15.28     | 5,256,320.00     |      |
|  |               | QANTAS AIRWAYS LIMITED      | 220,000   | 5.82      | 1,280,400.00     |      |
|  |               | AURIZON HOLDINGS LTD        | 470,000   | 3.91      | 1,837,700.00     |      |

|            |                                          |         |        |                  |  |
|------------|------------------------------------------|---------|--------|------------------|--|
|            | TRANSURBAN GROUP                         | 743,000 | 13.09  | 9,725,870.00     |  |
|            | ARISTOCRAT LEISURE LTD                   | 144,000 | 44.32  | 6,382,080.00     |  |
|            | LOTTERY CORP LTD/THE                     | 550,000 | 5.05   | 2,777,500.00     |  |
|            | WESFARMERS LIMITED                       | 272,000 | 62.95  | 17,122,400.00    |  |
|            | COLES GROUP LTD                          | 317,000 | 16.13  | 5,113,210.00     |  |
|            | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA            | 330,000 | 5.46   | 1,801,800.00     |  |
|            | WOOLWORTHS GROUP LTD                     | 292,000 | 35.98  | 10,506,160.00    |  |
|            | TREASURY WINE ESTATES LTD                | 202,000 | 11.40  | 2,302,800.00     |  |
|            | COCHLEAR LTD                             | 15,400  | 334.54 | 5,151,916.00     |  |
|            | RAMSAY HEALTH CARE LTD                   | 41,000  | 52.23  | 2,141,430.00     |  |
|            | SONIC HEALTHCARE LTD                     | 112,000 | 31.94  | 3,577,280.00     |  |
|            | CSL LIMITED                              | 115,000 | 284.00 | 32,660,000.00    |  |
|            | ANZ GROUP HOLDINGS LTD                   | 718,000 | 28.42  | 20,405,560.00    |  |
|            | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA           | 401,200 | 116.28 | 46,651,536.00    |  |
|            | NATIONAL AUSTRALIA BANK                  | 754,000 | 33.07  | 24,934,780.00    |  |
|            | WESTPAC BANKING CORP                     | 839,000 | 24.57  | 20,614,230.00    |  |
|            | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON             | 57,000  | 34.02  | 1,939,140.00     |  |
|            | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD            | 600,000 | 6.08   | 3,648,000.00     |  |
|            | MEDIBANK PRIVATE LTD                     | 690,000 | 3.75   | 2,587,500.00     |  |
|            | QBE INSURANCE                            | 355,000 | 16.11  | 5,719,050.00     |  |
|            | SUNCORP GROUP LTD                        | 291,000 | 14.37  | 4,181,670.00     |  |
|            | WISETECH GLOBAL LTD                      | 39,000  | 80.01  | 3,120,390.00     |  |
|            | XERO LIMITED                             | 34,300  | 117.50 | 4,030,250.00     |  |
|            | TELSTRA GROUP LTD                        | 920,000 | 3.86   | 3,551,200.00     |  |
|            | ORIGIN ENERGY LTD                        | 410,000 | 8.73   | 3,579,300.00     |  |
|            | APA GROUP                                | 300,000 | 8.08   | 2,424,000.00     |  |
|            | ASX LTD                                  | 47,000  | 65.12  | 3,060,640.00     |  |
|            | MACQUARIE GROUP LIMITED                  | 88,800  | 192.70 | 17,111,760.00    |  |
|            | IDP EDUCATION LTD                        | 62,000  | 20.52  | 1,272,240.00     |  |
|            | COMPUTERSHARE LTD                        | 137,000 | 26.21  | 3,590,770.00     |  |
|            | CAR GROUP LTD                            | 90,000  | 34.54  | 3,108,600.00     |  |
|            | REA GROUP LTD                            | 12,500  | 185.08 | 2,313,500.00     |  |
|            | SEEK LTD                                 | 87,000  | 25.35  | 2,205,450.00     |  |
| 小計         | 銘柄数：51                                   |         |        | 412,124,270.00   |  |
|            |                                          |         |        | (40,487,088,284) |  |
|            | 組入時価比率：1.9%                              |         |        | 2.0%             |  |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD                | 310,000 | 8.15   | 2,526,500.00     |  |
|            | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L | 144,000 | 24.13  | 3,474,720.00     |  |
|            | EBOS GROUP LTD                           | 35,000  | 37.36  | 1,307,600.00     |  |
|            | SPARK NEW ZEALAND LTD                    | 430,000 | 5.19   | 2,231,700.00     |  |
|            | MERCURY NZ LTD                           | 137,000 | 6.78   | 928,860.00       |  |
|            | MERIDIAN ENERGY LTD                      | 300,000 | 5.72   | 1,716,000.00     |  |

|          |                                       |            |        |                  |      |
|----------|---------------------------------------|------------|--------|------------------|------|
| 小計       | 銘柄数：6                                 |            |        | 12,185,380.00    |      |
|          | 組入時価比率：0.1%                           |            |        | (1,122,273,498)  | 0.1% |
| 香港ドル     | XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD           | 430,000    | 7.16   | 3,078,800.00     |      |
|          | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD             | 620,040    | 42.40  | 26,289,696.00    |      |
|          | TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED | 325,000    | 84.70  | 27,527,500.00    |      |
|          | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS           | 280,000    | 13.50  | 3,780,000.00     |      |
|          | MTR CORP                              | 390,000    | 25.40  | 9,906,000.00     |      |
|          | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L          | 530,000    | 45.65  | 24,194,500.00    |      |
|          | SANDS CHINA LTD                       | 564,000    | 24.50  | 13,818,000.00    |      |
|          | BUDWEISER BREWING CO APAC LT          | 410,000    | 13.38  | 5,485,800.00     |      |
|          | WH GROUP LIMITED                      | 2,099,806  | 4.74   | 9,953,080.44     |      |
|          | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD            | 930,000    | 19.64  | 18,265,200.00    |      |
|          | HANG SENG BANK                        | 191,000    | 82.90  | 15,833,900.00    |      |
|          | AIA GROUP LTD                         | 2,762,000  | 64.30  | 177,596,600.00   |      |
|          | HKT TRUST AND HKT LTD                 | 849,600    | 9.13   | 7,756,848.00     |      |
|          | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD        | 134,000    | 45.10  | 6,043,400.00     |      |
|          | CLP HLDGS                             | 394,000    | 64.20  | 25,294,800.00    |      |
|          | POWER ASSETS HOLDINGS LTD             | 350,000    | 45.30  | 15,855,000.00    |      |
|          | HONG KONG & CHINA GAS                 | 2,630,383  | 5.92   | 15,571,867.36    |      |
|          | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD    | 285,000    | 251.80 | 71,763,000.00    |      |
|          | CK ASSET HOLDINGS LTD                 | 480,040    | 36.00  | 17,281,440.00    |      |
|          | ESR GROUP LTD                         | 570,000    | 9.98   | 5,688,600.00     |      |
|          | HANG LUNG PROPERTIES LTD              | 460,000    | 8.42   | 3,873,200.00     |      |
|          | HENDERSON LAND                        | 310,443    | 21.50  | 6,674,524.50     |      |
|          | NEW WORLD DEVELOPMENT                 | 309,916    | 9.62   | 2,981,391.92     |      |
|          | SINO LAND CO.LTD                      | 890,000    | 8.10   | 7,209,000.00     |      |
|          | SUN HUNG KAI PROPERTIES               | 341,000    | 73.00  | 24,893,000.00    |      |
|          | SWIRE PACIFIC-A                       | 104,000    | 63.10  | 6,562,400.00     |      |
|          | SWIRE PROPERTIES LTD                  | 230,000    | 15.34  | 3,528,200.00     |      |
|          | THE WHARF HOLDINGS LIMITED            | 250,000    | 26.30  | 6,575,000.00     |      |
|          | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT          | 383,000    | 25.60  | 9,804,800.00     |      |
| 小計       | 銘柄数：29                                |            |        | 573,085,548.22   |      |
|          | 組入時価比率：0.5%                           |            |        | (10,991,780,814) | 0.5% |
| シンガポールドル | SINGAPORE TECH ENGINEERING            | 380,000    | 3.91   | 1,485,800.00     |      |
|          | JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD            | 21,000     | 26.52  | 556,920.00       |      |
|          | KEPPEL LTD                            | 360,000    | 7.34   | 2,642,400.00     |      |
|          | SEATRIM LTD                           | 10,173,615 | 0.09   | 946,146.19       |      |
|          | SINGAPORE AIRLINES LTD                | 360,000    | 7.32   | 2,635,200.00     |      |
|          | GENTING SINGAPORE LTD                 | 1,410,000  | 1.04   | 1,466,400.00     |      |
|          | WILMAR INTERNATIONAL LTD              | 440,000    | 3.24   | 1,425,600.00     |      |

|  |      |                                      |           |        |                     |      |
|--|------|--------------------------------------|-----------|--------|---------------------|------|
|  |      | DBS GROUP HLDGS                      | 434,000   | 33.87  | 14,699,580.00       |      |
|  |      | OCBC-ORD                             | 814,000   | 13.26  | 10,793,640.00       |      |
|  |      | UNITED OVERSEAS BANK                 | 308,000   | 29.19  | 8,990,520.00        |      |
|  |      | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 2,040,000 | 2.38   | 4,855,200.00        |      |
|  |      | SEMBCORP INDUSTRIES LTD              | 200,000   | 5.76   | 1,152,000.00        |      |
|  |      | SINGAPORE EXCHANGE LTD               | 199,000   | 9.37   | 1,864,630.00        |      |
|  |      | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI         | 600,000   | 2.94   | 1,764,000.00        |      |
|  |      | CITY DEVELOPMENTS LTD                | 100,000   | 6.08   | 608,000.00          |      |
|  |      | UOL GROUP LIMITED                    | 130,000   | 6.08   | 790,400.00          |      |
|  |      | 小計 銘柄数：16                            |           |        | 56,676,436.19       |      |
|  |      | 組入時価比率：0.3%                          |           |        | (6,321,689,692)     | 0.3% |
|  | 新シケル | ICL GROUP LTD                        | 190,000   | 18.21  | 3,459,900.00        |      |
|  |      | ELBIT SYSTEMS LTD                    | 5,900     | 738.00 | 4,354,200.00        |      |
|  |      | BANK HAPOALIM BM                     | 291,000   | 31.82  | 9,259,620.00        |      |
|  |      | BANK LEUMI LE-ISRAEL                 | 364,000   | 27.56  | 10,031,840.00       |      |
|  |      | ISRAEL DISCOUNT BANK-A               | 280,000   | 17.62  | 4,933,600.00        |      |
|  |      | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD             | 39,000    | 133.80 | 5,218,200.00        |      |
|  |      | NICE LTD                             | 14,800    | 808.10 | 11,959,880.00       |      |
|  |      | AZRIELI GROUP                        | 12,000    | 234.90 | 2,818,800.00        |      |
|  |      | 小計 銘柄数：8                             |           |        | 52,036,040.00       |      |
|  |      | 組入時価比率：0.1%                          |           |        | (2,162,368,049)     | 0.1% |
|  | 合計   |                                      |           |        | 2,064,165,718,165   |      |
|  |      |                                      |           |        | (2,064,165,718,165) |      |

(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(2024年2月19日現在)

| 種類      | 通貨    | 銘柄                             | 券面総額     | 評価額           | 備考   |
|---------|-------|--------------------------------|----------|---------------|------|
| 新株予約権証券 | カナダドル | CONSTELLATION SOFTWARE WARRANT | 4,480.00 | 0.00          |      |
|         | 小計    | 銘柄数：1                          | 4,480.00 | 0.00          |      |
|         |       | 組入時価比率：0.0%                    |          | (0)           | 0.0% |
|         | 合計    |                                |          | 0             | (0)  |
| 投資証券    | 米ドル   | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT   | 39,800   | 4,747,344.00  |      |
|         |       | AMERICAN HOMES 4 RENT-A        | 75,000   | 2,582,250.00  |      |
|         |       | AMERICAN TOWER CORP            | 111,000  | 20,771,430.00 |      |
|         |       | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT      | 116,000  | 2,164,560.00  |      |
|         |       | AVALONBAY COMMUNITIES INC      | 33,400   | 5,915,808.00  |      |
|         |       | BOSTON PROPERTIES              | 33,600   | 2,263,296.00  |      |
|         |       | CAMDEN PROPERTY TRUST          | 24,700   | 2,375,152.00  |      |

|       |                              |           |                  |  |
|-------|------------------------------|-----------|------------------|--|
| 小計    | CROWN CASTLE INC             | 102,700   | 11,114,194.00    |  |
|       | DIGITAL REALTY TRUST INC     | 71,900    | 9,794,218.00     |  |
|       | EQUINIX INC                  | 22,300    | 19,093,929.00    |  |
|       | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES  | 40,600    | 2,686,908.00     |  |
|       | EQUITY RESIDENTIAL           | 87,000    | 5,222,610.00     |  |
|       | ESSEX PROPERTY TRUST INC     | 15,300    | 3,601,161.00     |  |
|       | EXTRA SPACE STORAGE INC      | 51,300    | 7,262,541.00     |  |
|       | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 61,000    | 2,756,590.00     |  |
|       | HEALTHPEAK PROPERTIES INC    | 136,000   | 2,333,760.00     |  |
|       | HOST HOTELS & RESORTS INC    | 173,000   | 3,411,560.00     |  |
|       | INVITATION HOMES INC         | 143,000   | 4,676,100.00     |  |
|       | IRON MOUNTAIN INC            | 70,000    | 4,758,600.00     |  |
|       | KIMCO REALTY CORP            | 164,000   | 3,219,320.00     |  |
|       | MID-AMERICA APARTMENT COMM   | 28,700    | 3,707,179.00     |  |
|       | PROLOGIS INC                 | 221,100   | 29,492,529.00    |  |
|       | PUBLIC STORAGE               | 38,200    | 10,754,064.00    |  |
|       | REALTY INCOME CORP           | 199,000   | 10,413,670.00    |  |
|       | REGENCY CENTERS CORP         | 39,000    | 2,371,590.00     |  |
|       | SBA COMMUNICATIONS CORP      | 25,600    | 5,294,080.00     |  |
|       | SIMON PROPERTY GROUP INC     | 78,300    | 11,741,868.00    |  |
|       | SUN COMMUNITIES INC          | 29,000    | 3,770,000.00     |  |
|       | UDR INC                      | 73,000    | 2,633,840.00     |  |
|       | VENTAS INC                   | 97,000    | 4,244,720.00     |  |
|       | VICI PROPERTIES INC          | 246,000   | 7,264,380.00     |  |
|       | WELLTOWER INC                | 123,100   | 11,464,303.00    |  |
|       | WEYERHAEUSER CO              | 175,000   | 5,773,250.00     |  |
|       | WP CAREY INC                 | 49,100    | 2,818,340.00     |  |
|       | 銘柄数：34                       | 2,993,700 | 232,495,144.00   |  |
|       |                              |           | (34,881,246,454) |  |
|       | 組入時価比率：1.6%                  |           | 86.1%            |  |
| カナダドル | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 21,000    | 1,057,350.00     |  |
|       | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR  | 28,000    | 518,840.00       |  |
| 小計    | 銘柄数：2                        | 49,000    | 1,576,190.00     |  |
|       |                              |           | (175,571,804)    |  |
|       | 組入時価比率：0.0%                  |           | 0.4%             |  |
| ユーロ   | COVIVIO                      | 11,300    | 469,628.00       |  |
|       | GECINA SA                    | 11,700    | 1,091,025.00     |  |
|       | KLEPIERRE                    | 49,000    | 1,160,320.00     |  |
|       | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD    | 27,300    | 1,911,546.00     |  |
|       | WAREHOUSES DE PAUW SCA       | 45,000    | 1,159,200.00     |  |
|       | 銘柄数：5                        | 144,300   | 5,791,719.00     |  |
| 小計    |                              |           | (937,158,051)    |  |
|       | 組入時価比率：0.0%                  |           | 2.3%             |  |

|          |                                        |           |                  |      |
|----------|----------------------------------------|-----------|------------------|------|
| 英ポンド     | LAND SECURITIES GROUP PLC              | 180,000   | 1,161,720.00     |      |
|          | SEGRO PLC                              | 289,000   | 2,454,766.00     |      |
| 小計       | 銘柄数：2                                  | 469,000   | 3,616,486.00     |      |
|          | 組入時価比率：0.0%                            |           | (684,781,624)    | 1.7% |
| 豪ドル      | DEXUS/AU                               | 252,000   | 1,980,720.00     |      |
|          | GOODMAN GROUP                          | 416,000   | 11,901,760.00    |      |
|          | GPT GROUP                              | 440,000   | 2,002,000.00     |      |
|          | MIRVAC GROUP                           | 890,000   | 2,047,000.00     |      |
|          | SCENTRE GROUP                          | 1,210,000 | 3,690,500.00     |      |
|          | STOCKLAND TRUST GROUP                  | 540,000   | 2,532,600.00     |      |
|          | VICINITY CENTRES                       | 980,000   | 2,009,000.00     |      |
|          | 銘柄数：7                                  | 4,728,000 | 26,163,580.00    |      |
| 小計       | 組入時価比率：0.1%                            |           | (2,570,310,099)  | 6.3% |
|          |                                        |           |                  |      |
| 香港ドル     | LINK REIT                              | 630,000   | 24,318,000.00    |      |
| 小計       | 銘柄数：1                                  | 630,000   | 24,318,000.00    |      |
|          | 組入時価比率：0.0%                            |           | (466,419,240)    | 1.2% |
| シンガポールドル | CAPITALAND ASCENDAS REIT               | 890,040   | 2,474,311.20     |      |
|          | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 1,320,021 | 2,587,241.16     |      |
|          | MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | 860,029   | 1,333,044.95     |      |
|          | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST    | 490,000   | 690,900.00       |      |
|          | 銘柄数：4                                  | 3,560,090 | 7,085,497.31     |      |
| 小計       | 組入時価比率：0.0%                            |           | (790,316,369)    | 2.0% |
|          |                                        |           |                  |      |
| 合計       |                                        |           | 40,505,803,641   |      |
|          |                                        |           | (40,505,803,641) |      |
| 合計       |                                        |           | 40,505,803,641   |      |
|          |                                        |           | (40,505,803,641) |      |

(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        | 2024年 2月19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        | 29,301,491,176 | —     | 29,970,954,924 | 669,463,748 |
| 市場取引以外の取引 |                |       |                |             |
| 為替予約取引    |                |       |                |             |
| 買建        | 2,601,704,946  | —     | 2,598,246,305  | △3,458,641  |
| 米ドル       | 1,998,903,690  | —     | 1,994,853,840  | △4,049,850  |



|        |             |   |             |             |
|--------|-------------|---|-------------|-------------|
| カナダドル  | 89,136,952  | — | 89,086,640  | △50,312     |
| ユーロ    | 161,663,410 | — | 161,771,400 | 107,990     |
| 英ポンド   | 170,395,973 | — | 170,376,360 | △19,613     |
| スイスフラン | 93,446,501  | — | 93,764,385  | 317,884     |
| 豪ドル    | 88,158,420  | — | 88,393,680  | 235,260     |
| 売建     | 195,240,500 | — | 195,008,970 | 231,530     |
| 米ドル    | 195,240,500 | — | 195,008,970 | 231,530     |
| 合計     | —           | — | —           | 666,236,637 |

（注）時価の算定方法

#### 1 先物取引

##### 外国先物取引について

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

#### 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

（2024年 2月19日現在）

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 資産の部            |                 |
| 流動資産            |                 |
| 預金              | 1,912,797,596   |
| コール・ローン         | 2,453,459,000   |
| 国債証券            | 822,190,531,462 |
| 派生商品評価勘定        | 7,810,200       |
| 未収利息            | 7,687,738,759   |
| 前払費用            | 957,693,197     |
| その他未収収益         | 9,643,192       |
| 流動資産合計          | 835,219,673,406 |
| 資産合計            | 835,219,673,406 |
| 負債の部            |                 |
| 流動負債            |                 |
| 派生商品評価勘定        | 730,577         |
| 未払金             | 1,667,471,797   |
| 未払解約金           | 687,591,344     |
| 未払利息            | 258             |
| その他未払費用         | 5,212,335       |
| 流動負債合計          | 2,361,006,311   |
| 負債合計            | 2,361,006,311   |
| 純資産の部           |                 |
| 元本等             |                 |
| 元本              | 288,983,684,987 |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 543,874,982,108 |
| 元本等合計           | 832,858,667,095 |

|         |                 |
|---------|-----------------|
| 純資産合計   | 832,858,667,095 |
| 負債純資産合計 | 835,219,673,406 |

## 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<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。<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。</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<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。</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。<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。</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）

| 2024年 2月19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                        | 2.8820円          |
| (10,000口当たり純資産額)                 | (28,820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       |                  |
|                                  | 243,496,036,282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                             | 256,425,041,413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 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針<br/>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<br/>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。<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、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。<br/>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<br/>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。</p> <p>○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。</p> <p>○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。</p> <p>○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。</p> |

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

| 2024年 2月19日現在                                                                                          |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額<br/>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

| 2024年 2月19日現在                                       |                  |
|-----------------------------------------------------|------------------|
| 期首                                                  | 2023年 2月21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                    | 271,284,561,193円 |
| 同期中における追加設定元本額                                      | 51,798,326,857円  |
| 同期中における一部解約元本額                                      | 34,099,203,063円  |
| 期末元本額                                               | 288,983,684,987円 |
| 期末元本額の内訳※                                           |                  |
| バランスセレクト30                                          | 71,496,964円      |
| バランスセレクト50                                          | 73,669,148円      |
| バランスセレクト70                                          | 82,313,757円      |
| 野村外国債券インデックスファンド                                    | 240,108,933円     |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース）                                  | 3,238,496,512円   |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース）                                  | 22,658,926,788円  |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース）                                  | 2,994,833,560円   |
| 野村資産設計ファンド2015                                      | 18,595,178円      |
| 野村資産設計ファンド2020                                      | 20,478,572円      |
| 野村資産設計ファンド2025                                      | 31,919,299円      |
| 野村資産設計ファンド2030                                      | 48,034,109円      |
| 野村資産設計ファンド2035                                      | 39,410,409円      |
| 野村資産設計ファンド2040                                      | 63,280,463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）                       | 79,447,901,511円  |
| のむラップ・ファンド（保守型）                                     | 4,922,234,127円   |
| のむラップ・ファンド（普通型）                                     | 32,011,073,163円  |
| のむラップ・ファンド（積極型）                                     | 11,207,841,103円  |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA向け）                               | 372,688,503円     |
| 野村資産設計ファンド2045                                      | 12,598,882円      |
| 野村インデックスファンド・外国債券                                   | 1,050,722,157円   |
| マイ・ロード                                              | 6,088,808,849円   |
| ネクストコア                                              | 75,044,485円      |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス                              | 356,435,192円     |
| 野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）                        | 6,869,970,372円   |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース）                                | 859,506,676円     |
| 野村資産設計ファンド2050                                      | 11,540,290円      |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型                    | 3,876,756円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型                    | 2,863,974円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型                    | 1,955,111円       |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型                    | 1,743,572円       |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                                   | 1,032,503,514円   |
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                                   | 2,076,051,602円   |
| インデックス・ブレンド（タイプⅠ）                                   | 1,372,623円       |
| インデックス・ブレンド（タイプⅡ）                                   | 1,466,500円       |
| インデックス・ブレンド（タイプⅢ）                                   | 4,678,314円       |
| インデックス・ブレンド（タイプⅣ）                                   | 1,663,809円       |
| インデックス・ブレンド（タイプⅤ）                                   | 4,500,015円       |
| 野村6資産均等バランス                                         | 4,212,202,981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）                | 8,606,053,980円   |
| 世界6資産分散ファンド                                         | 86,442,329円      |
| 野村資産設計ファンド2060                                      | 6,167,693円       |
| NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信 | 12,051,347,038円  |
| ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券                              | 7,182,785,179円   |
| 野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）                       | 5,350,952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）                    | 815,344,854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）                    | 165,241,039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）                    | 796,288,496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）                    | 268,257,029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）                    | 1,540,100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）                  | 6,002,714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）                    | 79,120円          |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）                        | 2,325,577,265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）                   | 895,485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）                   | 10,401,232円      |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）                      | 5,560,320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）                  | 151,806,925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）             | 116,976,117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）             | 1,893,285,236円  |
| 野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）                        | 46,295,636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）                 | 885,402,472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）             | 2,229,307,584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） | 4,864,629円      |
| バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）                           | 3,681,003円      |
| バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）                           | 8,336,008円      |
| バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）                           | 7,426,844円      |
| 野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）                       | 658,590,794円    |
| マイバランス３０（確定拠出年金向け）                             | 5,348,221,345円  |
| マイバランス５０（確定拠出年金向け）                             | 7,277,359,542円  |
| マイバランス７０（確定拠出年金向け）                             | 6,317,569,174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）                     | 26,308,397,426円 |
| マイバランスＤＣ３０                                     | 2,327,753,673円  |
| マイバランスＤＣ５０                                     | 1,921,074,656円  |
| マイバランスＤＣ７０                                     | 1,556,406,671円  |
| 野村ＤＣ外国債券インデックスファンド                             | 11,133,115,505円 |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド                                   | 3,770,397,382円  |
| 野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）                             | 460,920,295円    |
| マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）                          | 509,084,882円    |
| マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）                          | 1,166,607,696円  |
| マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）                          | 491,910,922円    |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース                           | 30,807,384円     |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース                         | 76,591,147円     |
| 野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース                           | 41,107,710円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０３０                    | 30,935,686円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０４０                    | 24,016,410円     |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０５０                    | 12,712,466円     |
| マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）                          | 428,830,044円    |
| マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）                          | 230,765,751円    |
| マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）                          | 153,706,541円    |
| マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）                          | 208,309,341円    |
| 野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）２０６０                    | 6,530,874円      |
| マイターゲット２０６５（確定拠出年金向け）                          | 81,207,313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）                  | 61,150,093円     |
| みらいバランス・株式１０（富士通企業年金基金ＤＣ向け）                    | 348,933,435円    |
| 野村ＤＣバランスファンド（年金運用戦略タイプ）                        | 107,108,862円    |
| マイターゲット２０７０（確定拠出年金向け）                          | 36,915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(2024年2月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2024年2月19日現在)

| 種類   | 通貨  | 銘柄               | 券面総額          | 評価額           | 備考 |
|------|-----|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY BOND | 70,850,000.00 | 72,729,182.89 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 38,050,000.00 | 40,318,133.86 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 84,200,000.00 | 87,541,687.50 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 100,000.00    | 100,423.82    |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 7,100,000.00  | 5,540,634.10  |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 200,000.00    | 177,898.42    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 100,000.00    | 97,672.44     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 300,000.00    | 289,958.61    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 100,000.00    | 99,156.87     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 28,450,000.00 | 27,624,491.95 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 900,000.00    | 869,666.67    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 100,000.00    | 97,778.29     |    |

|                 |               |               |
|-----------------|---------------|---------------|
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 288,494.82    |
| US TREASURY N/B | 20,400,000.00 | 19,718,670.60 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,527.34     |
| US TREASURY N/B | 900,000.00    | 857,408.13    |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,453.12     |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,671.87     |
| US TREASURY N/B | 49,800,000.00 | 47,214,677.82 |
| US TREASURY N/B | 8,850,000.00  | 8,560,473.13  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,455.07     |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,552.73     |
| US TREASURY N/B | 62,300,000.00 | 58,772,505.47 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,500.00     |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,298.82     |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 188,046.86    |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,558.59     |
| US TREASURY N/B | 2,700,000.00  | 2,628,175.68  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,708.98     |
| US TREASURY N/B | 38,800,000.00 | 37,260,125.00 |
| US TREASURY N/B | 40,800,000.00 | 39,584,763.84 |
| US TREASURY N/B | 56,850,000.00 | 53,084,796.07 |
| US TREASURY N/B | 48,500,000.00 | 47,184,243.50 |
| US TREASURY N/B | 350,000.00    | 325,752.91    |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,214.84     |
| US TREASURY N/B | 53,000,000.00 | 51,515,581.30 |
| US TREASURY N/B | 44,000,000.00 | 40,820,309.20 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 100,412.10    |
| US TREASURY N/B | 56,500,000.00 | 54,200,269.20 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,630.85     |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,896.48     |
| US TREASURY N/B | 67,200,000.00 | 62,288,620.80 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,787.10     |
| US TREASURY N/B | 170,000.00    | 163,887.29    |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 184,871.08    |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,583.98     |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,285.15     |
| US TREASURY N/B | 35,180,000.00 | 32,404,762.37 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,255.85     |
| US TREASURY N/B | 4,500,000.00  | 4,245,116.85  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 197,605.46    |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 95,933.59     |
| US TREASURY N/B | 20,400,000.00 | 18,786,327.36 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 200,023.42    |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 95,367.18     |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 184,773.42    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,294.92     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 95,445.31     |  |
| US TREASURY N/B | 22,100,000.00 | 20,355,306.66 |  |
| US TREASURY N/B | 1,800,000.00  | 1,688,554.62  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,015.62     |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 284,449.20    |  |
| US TREASURY N/B | 1,700,000.00  | 1,561,376.90  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,078.12     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 94,164.06     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,962.89     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,935.54     |  |
| US TREASURY N/B | 6,200,000.00  | 5,825,820.08  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,082.03     |  |
| US TREASURY N/B | 41,930,000.00 | 38,991,621.07 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,677.73     |  |
| US TREASURY N/B | 48,400,000.00 | 44,826,715.12 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,136.71     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 100,302.73    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,078.12     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,271.48     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 100,337.89    |  |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00  | 1,392,949.20  |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 274,757.79    |  |
| US TREASURY N/B | 64,600,000.00 | 60,532,215.52 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 100,386.71    |  |
| US TREASURY N/B | 2,750,000.00  | 2,549,550.57  |  |
| US TREASURY N/B | 7,020,000.00  | 6,438,244.87  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,796.87     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 92,855.46     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,556.64     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,804.68     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,994.14     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,964.84     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 90,775.39     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 92,837.89     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 89,119.14     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 94,501.95     |  |
| US TREASURY N/B | 71,200,000.00 | 63,000,871.44 |  |
| US TREASURY N/B | 350,000.00    | 332,800.75    |  |
| US TREASURY N/B | 750,000.00    | 704,340.75    |  |
| US TREASURY N/B | 50,200,000.00 | 44,270,125.00 |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 472,929.65    |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 22,200,000.00 | 19,524,724.61 |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 289,359.36    |  |
| US TREASURY N/B | 16,400,000.00 | 14,311,881.48 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 94,767.57     |  |
| US TREASURY N/B | 600,000.00    | 558,855.42    |  |
| US TREASURY N/B | 28,550,000.00 | 24,961,733.22 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 95,880.85     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 86,777.34     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,136.71     |  |
| US TREASURY N/B | 12,350,000.00 | 10,735,574.65 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,115.23     |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 927,636.70    |  |
| US TREASURY N/B | 300,000.00    | 261,345.69    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,257.81     |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 434,218.75    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,250.00     |  |
| US TREASURY N/B | 10,600,000.00 | 9,226,761.52  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,898.43     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 94,201.17     |  |
| US TREASURY N/B | 63,100,000.00 | 55,650,003.85 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,681.64     |  |
| US TREASURY N/B | 17,200,000.00 | 15,212,928.72 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,298.82     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 88,242.18     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,785.15     |  |
| US TREASURY N/B | 3,600,000.00  | 3,397,500.00  |  |
| US TREASURY N/B | 46,850,000.00 | 41,248,126.76 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,244.14     |  |
| US TREASURY N/B | 25,700,000.00 | 22,576,846.05 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,697.26     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 86,669.92     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,208.98     |  |
| US TREASURY N/B | 150,000.00    | 141,202.14    |  |
| US TREASURY N/B | 10,100,000.00 | 8,783,053.93  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 100,232.42    |  |
| US TREASURY N/B | 11,800,000.00 | 10,298,956.22 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 101,257.81    |  |
| US TREASURY N/B | 3,300,000.00  | 2,891,173.56  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 102,357.42    |  |
| US TREASURY N/B | 28,500,000.00 | 27,063,865.04 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 87,960.93     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 100,332.03    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 87,259.76     |  |

|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,609.37     |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 177,429.68    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,726.56     |  |
| US TREASURY N/B | 36,250,000.00 | 33,548,240.37 |  |
| US TREASURY N/B | 18,000,000.00 | 16,042,500.00 |  |
| US TREASURY N/B | 15,600,000.00 | 14,230,125.00 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,396.48     |  |
| US TREASURY N/B | 28,900,000.00 | 26,317,062.50 |  |
| US TREASURY N/B | 9,100,000.00  | 8,437,050.44  |  |
| US TREASURY N/B | 9,800,000.00  | 9,307,319.70  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 91,925.78     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 87,300.78     |  |
| US TREASURY N/B | 41,000,000.00 | 38,634,488.60 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,839.84     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,429.68     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 87,519.53     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,779.29     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,742.18     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 80,257.81     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 95,781.25     |  |
| US TREASURY N/B | 6,200,000.00  | 5,290,343.44  |  |
| US TREASURY N/B | 50,000,000.00 | 49,160,155.00 |  |
| US TREASURY N/B | 45,200,000.00 | 43,531,482.68 |  |
| US TREASURY N/B | 40,600,000.00 | 38,809,475.04 |  |
| US TREASURY N/B | 86,650,000.00 | 95,748,250.00 |  |
| US TREASURY N/B | 47,250,000.00 | 37,818,455.85 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,892.57     |  |
| US TREASURY N/B | 7,700,000.00  | 7,458,171.49  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,224.60     |  |
| US TREASURY N/B | 23,330,000.00 | 18,511,806.74 |  |
| US TREASURY N/B | 18,200,000.00 | 17,997,026.32 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 101,734.37    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 103,183.59    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 100,312.50    |  |
| US TREASURY N/B | 82,500,000.00 | 88,229,880.75 |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 81,343.75     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 83,544.92     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 80,677.73     |  |
| US TREASURY N/B | 150,000.00    | 121,294.92    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 83,679.68     |  |
| US TREASURY N/B | 64,230,000.00 | 57,870,973.08 |  |
| US TREASURY N/B | 49,400,000.00 | 43,938,014.90 |  |
| US TREASURY N/B | 87,650,000.00 | 86,444,812.50 |  |



|                 |               |               |  |
|-----------------|---------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 93,978.51     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 92,917.96     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 96,640.62     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 101,515.62    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 102,832.03    |  |
| US TREASURY N/B | 150,000.00    | 160,810.54    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 101,466.79    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 90,189.45     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,101.56     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 100,712.89    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 99,126.95     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 101,816.40    |  |
| US TREASURY N/B | 3,500,000.00  | 3,456,523.35  |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 121,925.78    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 92,697.26     |  |
| US TREASURY N/B | 4,100,000.00  | 2,475,614.85  |  |
| US TREASURY N/B | 1,400,000.00  | 1,356,578.02  |  |
| US TREASURY N/B | 24,100,000.00 | 15,137,812.50 |  |
| US TREASURY N/B | 4,100,000.00  | 4,216,273.13  |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 136,441.40    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 98,107.42     |  |
| US TREASURY N/B | 20,600,000.00 | 14,895,971.24 |  |
| US TREASURY N/B | 34,300,000.00 | 31,022,741.33 |  |
| US TREASURY N/B | 15,300,000.00 | 10,098,000.00 |  |
| US TREASURY N/B | 3,400,000.00  | 2,805,796.62  |  |
| US TREASURY N/B | 7,300,000.00  | 5,013,188.86  |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 82,236.32     |  |
| US TREASURY N/B | 600,000.00    | 437,437.50    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 80,398.43     |  |
| US TREASURY N/B | 500,000.00    | 417,265.60    |  |
| US TREASURY N/B | 200,000.00    | 154,218.74    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 84,867.18     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 76,839.84     |  |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00  | 926,523.40    |  |
| US TREASURY N/B | 290,000.00    | 235,953.51    |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 90,902.34     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 90,851.56     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 87,453.12     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 97,289.06     |  |
| US TREASURY N/B | 100,000.00    | 87,259.76     |  |
| US TREASURY N/B | 7,600,000.00  | 6,375,687.12  |  |
| US TREASURY N/B | 39,450,000.00 | 31,748,772.19 |  |
| US TREASURY N/B | 34,100,000.00 | 26,813,788.21 |  |

|       |                     |                  |                   |  |
|-------|---------------------|------------------|-------------------|--|
| 小計    | US TREASURY N/B     | 45,200,000.00    | 32,445,125.00     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 22,900,000.00    | 17,929,983.23     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 17,500,000.00    | 13,376,219.50     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 3,200,000.00     | 2,496,124.80      |  |
|       | US TREASURY N/B     | 55,700,000.00    | 39,538,294.09     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 26,700,000.00    | 18,902,243.64     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 39,000,000.00    | 26,186,366.70     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 11,200,000.00    | 8,476,562.08      |  |
|       | US TREASURY N/B     | 2,000,000.00     | 1,545,742.00      |  |
|       | US TREASURY N/B     | 2,000,000.00     | 1,542,929.60      |  |
|       | US TREASURY N/B     | 11,400,000.00    | 8,376,327.84      |  |
|       | US TREASURY N/B     | 6,300,000.00     | 4,622,132.34      |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 76,841.79         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 78,560.54         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 500,000.00       | 383,281.25        |  |
|       | US TREASURY N/B     | 200,000.00       | 164,187.50        |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 76,529.29         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 4,100,000.00     | 3,060,585.63      |  |
|       | US TREASURY N/B     | 250,000.00       | 163,325.17        |  |
|       | US TREASURY N/B     | 300,000.00       | 201,392.55        |  |
|       | US TREASURY N/B     | 5,200,000.00     | 3,189,875.00      |  |
|       | US TREASURY N/B     | 96,900,000.00    | 48,393,216.60     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 102,200,000.00   | 52,746,769.04     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 32,600,000.00    | 18,007,040.32     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 22,600,000.00    | 13,310,604.48     |  |
|       | US TREASURY N/B     | 150,000.00       | 99,670.89         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 60,585.93         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 58,552.73         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 64,349.60         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 74,140.62         |  |
|       | US TREASURY N/B     | 100,000.00       | 76,125.00         |  |
|       | 銘柄数：258             | 2,957,850,000.00 | 2,600,142,798.90  |  |
|       | 組入時価比率：46.8%        |                  | (390,099,424,118) |  |
|       |                     |                  | 47.4%             |  |
| カナダドル | CANADIAN GOVERNMENT | 1,600,000.00     | 1,584,416.48      |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 34,000,000.00    | 32,827,911.20     |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00       | 96,546.44         |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 3,100,000.00     | 3,067,028.09      |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 4,500,000.00     | 4,368,977.10      |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 2,100,000.00     | 1,978,067.07      |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 1,400,000.00     | 1,367,921.94      |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 350,000.00       | 323,444.90        |  |
|       | CANADIAN GOVERNMENT | 650,000.00       | 634,403.64        |  |
|       |                     |                  |                   |  |

|  |        |                         |                |                  |  |
|--|--------|-------------------------|----------------|------------------|--|
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 300,000.00     | 283,029.21       |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 13,050,000.00  | 12,102,652.21    |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 2,950,000.00   | 2,726,918.93     |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 200,000.00     | 182,891.60       |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 3,100,000.00   | 2,988,860.34     |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 800,000.00     | 791,976.56       |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 250,000.00     | 233,448.15       |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 7,680,000.00   | 8,458,523.90     |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 100,000.00     | 93,581.08        |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 100,000.00     | 93,151.88        |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 10,700,000.00  | 9,292,871.88     |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 750,000.00     | 611,892.37       |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 6,550,000.00   | 5,670,322.55     |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 100,000.00     | 85,787.16        |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 100,000.00     | 88,569.02        |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 900,000.00     | 825,788.61       |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 21,200,000.00  | 24,766,323.36    |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 6,730,000.00   | 7,728,164.66     |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 100,000.00     | 106,017.00       |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 9,400,000.00   | 9,408,836.00     |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 600,000.00     | 529,722.96       |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 15,600,000.00  | 11,577,022.08    |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 100,000.00     | 68,871.80        |  |
|  |        | CANADIAN GOVERNMENT     | 4,700,000.00   | 4,068,445.49     |  |
|  | 小計     | 銘柄数：33                  | 153,860,000.00 | 149,032,385.66   |  |
|  |        |                         |                | (16,600,717,438) |  |
|  |        | 組入時価比率：2.0%             |                | 2.0%             |  |
|  | メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT | 70,500,000.00  | 66,914,370.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 149,000,000.00 | 137,167,045.80   |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 24,500,000.00  | 22,957,235.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 35,000,000.00  | 31,304,700.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 83,200,000.00  | 78,619,008.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 77,300,000.00  | 75,042,840.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 106,600,000.00 | 98,289,464.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6,000,000.00   | 5,356,200.00     |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 400,000.00     | 360,192.00       |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 56,300,000.00  | 59,642,531.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 94,600,000.00  | 88,823,724.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 68,200,000.00  | 58,448,764.00    |  |
|  |        | MEX BONOS DESARR FIX RT | 109,500,000.00 | 95,174,115.00    |  |
|  | 小計     | 銘柄数：13                  | 881,100,000.00 | 818,100,188.80   |  |
|  |        |                         |                | (7,208,280,763)  |  |
|  |        | 組入時価比率：0.9%             |                | 0.9%             |  |
|  | ユーロ    | BELGIUM KINGDOM         | 600,000.00     | 581,402.40       |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
|                          |               |               |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 9,600,000.00  | 9,908,697.60  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00    | 95,860.40     |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 4,000,000.00  | 3,756,600.00  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00    | 92,510.20     |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00    | 91,306.50     |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 11,400,000.00 | 10,083,482.40 |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 9,100,000.00  | 9,961,770.00  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00    | 87,440.00     |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 2,800,000.00  | 2,293,496.80  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 100,000.00    | 85,500.80     |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 1,000,000.00  | 644,000.00    |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 4,100,000.00  | 4,635,455.90  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 3,600,000.00  | 3,840,728.40  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 5,550,000.00  | 4,002,965.25  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 3,400,000.00  | 2,427,195.40  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 3,300,000.00  | 3,237,220.80  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 2,600,000.00  | 2,026,544.00  |  |
| BELGIUM KINGDOM          | 2,200,000.00  | 1,654,741.00  |  |
| BELGIUM KINGDOM GOVT     | 12,830,000.00 | 14,219,784.09 |  |
| BELGIUM KINGDOM GOVT     | 12,150,000.00 | 14,423,107.05 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 98,026.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 24,100,000.00 | 23,124,916.41 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,750,000.00  | 5,865,937.25  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 98,525.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 94,360.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 97,787.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,000,000.00  | 4,976,500.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 51,600,000.00 | 55,060,249.54 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 95,808.17     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 91,755.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 95,670.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 93,220.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 94,981.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 89,400.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 94,116.28     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 93,850.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 40,300,000.00 | 44,231,265.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 92,950.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2,900,000.00  | 2,976,133.70  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 89,215.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 86,104.70     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 93,919.14     |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 95,432.20     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 99,520.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 93,073.60     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,300,000.00  | 1,332,253.00  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 85,868.00     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 71,762.10     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,600,000.00  | 5,775,276.08  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 10,400,000.00 | 11,993,529.60 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 10,600,000.00 | 12,029,516.00 |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 95,901.80     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,000,000.00  | 3,609,209.70  |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 87,080.40     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00    | 82,684.44     |  |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 19,400,000.00 | 17,501,244.40 |  |
| BUNDES Obligation        | 200,000.00    | 188,710.00    |  |
| BUNDES Obligation        | 100,000.00    | 93,378.00     |  |
| BUNDES Obligation        | 3,600,000.00  | 3,597,696.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 97,286.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 97,074.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 95,585.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 93,693.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 93,453.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 42,150,000.00 | 47,406,105.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 93,487.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,400,000.00  | 1,564,220.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 92,785.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,100,000.00  | 1,203,059.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 91,020.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 89,483.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 90,204.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 700,000.00    | 689,731.00    |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 20,800,000.00 | 25,136,592.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,200,000.00  | 3,207,136.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 34,900,000.00 | 41,739,004.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 18,100,000.00 | 21,932,566.40 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 20,400,000.00 | 23,711,348.40 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 81,546.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 35,400,000.00 | 42,834,000.00 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 12,600,000.00 | 16,200,676.80 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 15,230,000.00 | 16,646,633.68 |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 98,480.30     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 98,826.00     |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 76,648.00     |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 19,100,000.00 | 9,446,096.00  |  |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00    | 84,841.00     |  |
| BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 2,250,000.00  | 2,231,077.50  |  |
| BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 650,000.00    | 646,964.50    |  |
| BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 3,000,000.00  | 3,002,040.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 97,118.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 17,500,000.00 | 17,762,500.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 23,800,000.00 | 23,778,380.08 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 97,220.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 97,641.51     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 97,990.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 96,877.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 50,950,000.00 | 51,163,990.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 98,780.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 97,900.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 100,450.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 94,900.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 102,470.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 101,217.50    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 96,560.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 97,590.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 44,950,000.00 | 45,660,210.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 110,450.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 94,980.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 93,885.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 194,020.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 192,720.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 16,250,000.00 | 18,107,375.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 98,040.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 191,120.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 41,750,000.00 | 41,992,150.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,000,000.00  | 2,042,000.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 106,120.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 97,930.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,000,000.00 | 10,343,000.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 98,240.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 150,000.00    | 164,625.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 54,000,000.00 | 55,204,200.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 100,530.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 22,800,000.00 | 23,073,600.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00    | 514,200.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 88,890.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4,000,000.00  | 3,989,200.00  |  |

|                          |               |               |  |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 115,850.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 150,000.00    | 129,765.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 81,030.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 91,170.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 43,850,000.00 | 50,532,740.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 600,000.00    | 630,900.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 89,750.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 32,800,000.00 | 35,938,960.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 14,000,000.00 | 13,269,200.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,100,000.00  | 2,117,640.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 82,790.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 100,120.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 90,770.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 86,900.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,800,000.00  | 3,050,600.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00    | 174,620.00    |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,800,000.00 | 13,959,680.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,800,000.00  | 1,834,200.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,300,000.00  | 8,807,130.00  |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 85,770.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 88,630.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 93,310.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00    | 71,900.00     |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 15,800,000.00 | 16,111,260.00 |  |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 9,500,000.00  | 6,849,690.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 600,000.00    | 606,492.00    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 100,000.00    | 96,740.71     |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 2,000,000.00  | 1,902,780.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 3,300,000.00  | 3,307,157.04  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 2,400,000.00  | 2,126,628.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 1,300,000.00  | 1,132,588.60  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 2,000,000.00  | 1,692,580.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 4,500,000.00  | 3,186,846.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 3,000,000.00  | 2,885,019.00  |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 400,000.00    | 374,108.00    |  |
| FINNISH GOVERNMENT       | 1,000,000.00  | 726,672.00    |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 100,000.00    | 96,750.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 100,000.00    | 96,490.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 150,000.00    | 145,200.00    |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 200,000.00    | 190,200.00    |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 18,250,000.00 | 18,097,043.10 |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 100,000.00    | 93,338.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)         | 150,000.00    | 138,133.05    |  |

|                         |               |               |  |
|-------------------------|---------------|---------------|--|
| FRANCE (GOVT OF)        | 150,000.00    | 143,370.00    |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 92,668.87     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 92,283.80     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 91,445.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 17,410,000.00 | 17,445,112.48 |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 89,403.50     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 99,630.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 4,000,000.00  | 4,052,928.00  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 85,500.30     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 81,930.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 83,677.60     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 78,840.70     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 200,000.00    | 137,961.60    |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 54,104.00     |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 43,100,000.00 | 22,821,837.90 |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 9,950,000.00  | 9,326,960.85  |  |
| FRANCE (GOVT OF)        | 100,000.00    | 67,505.90     |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 30,420,000.00 | 31,865,284.62 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 100,000.00    | 96,603.00     |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 100,000.00    | 94,393.06     |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 100,000.00    | 101,265.00    |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 7,450,000.00  | 7,451,862.50  |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 57,950,000.00 | 65,655,321.75 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 100,000.00    | 92,107.80     |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 43,150,000.00 | 52,747,897.65 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 56,600,000.00 | 66,151,250.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 10,200,000.00 | 11,267,042.40 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 16,250,000.00 | 19,074,250.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 100,000.00    | 99,939.30     |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 15,350,000.00 | 17,331,071.00 |  |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 840,000.00    | 961,979.76    |  |
| IRISH GOVERNMENT        | 730,000.00    | 745,634.26    |  |
| IRISH GOVERNMENT        | 200,000.00    | 186,726.40    |  |
| IRISH TSY 1.10% 2029    | 600,000.00    | 556,953.00    |  |
| IRISH TSY 1.3% 2033     | 9,100,000.00  | 8,069,206.60  |  |
| IRISH TSY 1.35% 2031    | 100,000.00    | 91,978.30     |  |
| IRISH TSY 1.5% 2050     | 2,900,000.00  | 2,102,157.80  |  |
| IRISH TSY 1.7% 2037     | 3,100,000.00  | 2,690,071.50  |  |
| IRISH TSY 1% 2026       | 100,000.00    | 96,232.40     |  |
| IRISH TSY 2.4% 2030     | 8,300,000.00  | 8,204,574.90  |  |
| IRISH TSY 2% 2045       | 1,600,000.00  | 1,347,201.60  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 9,100,000.00  | 8,749,049.40  |  |
| NETHERLANDS GOVERNMENT  | 1,400,000.00  | 1,330,000.00  |  |



|      |                        |                  |                                       |  |
|------|------------------------|------------------|---------------------------------------|--|
| 小計   | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00       | 94,815.00                             |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00       | 94,590.00                             |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 18,130,000.00    | 20,015,520.00                         |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00       | 92,390.00                             |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00       | 88,257.20                             |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00       | 88,486.20                             |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 250,000.00       | 247,615.00                            |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 21,400,000.00    | 24,174,039.20                         |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 15,000,000.00    | 10,198,425.00                         |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 500,000.00       | 354,052.50                            |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 300,000.00       | 339,386.70                            |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3,800,000.00     | 3,795,236.32                          |  |
|      | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3,400,000.00     | 2,898,840.00                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 800,000.00       | 607,548.00                            |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 900,000.00       | 867,146.94                            |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 5,500,000.00     | 5,339,820.75                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 7,900,000.00     | 8,192,300.00                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 2,000,000.00     | 1,896,392.00                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 8,800,000.00     | 9,774,732.00                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 12,900,000.00    | 11,557,110.00                         |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 700,000.00       | 595,172.90                            |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 11,350,000.00    | 10,834,218.54                         |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3,450,000.00     | 3,849,058.05                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 3,100,000.00     | 3,098,648.40                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 7,500,000.00     | 5,535,750.00                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 2,000,000.00     | 1,161,776.00                          |  |
|      | REPUBLIC OF AUSTRIA    | 2,650,000.00     | 3,043,490.55                          |  |
|      | SPANISH GOVERNMENT     | 38,500,000.00    | 43,920,222.50                         |  |
|      | SPANISH GOVERNMENT     | 36,500,000.00    | 43,570,050.00                         |  |
|      | SPANISH GOVERNMENT     | 15,650,000.00    | 16,870,634.27                         |  |
|      | 銘柄数：245                | 1,559,790,000.00 | 1,624,807,443.19<br>(262,910,092,382) |  |
|      | 組入時価比率：31.6%           |                  | 32.0%                                 |  |
| 英ポンド | UK TREASURY            | 100,000.00       | 95,845.50                             |  |
|      | UK TREASURY            | 120,000.00       | 120,188.01                            |  |
|      | UK TREASURY            | 200,000.00       | 190,070.12                            |  |
|      | UK TREASURY            | 100,000.00       | 96,225.00                             |  |
|      | UK TREASURY            | 100,000.00       | 93,815.00                             |  |
|      | UK TREASURY            | 100,000.00       | 90,385.00                             |  |
|      | UK TREASURY            | 400,000.00       | 401,800.40                            |  |
|      | UK TREASURY            | 200,000.00       | 179,998.00                            |  |
|      | UK TREASURY            | 100,000.00       | 108,582.50                            |  |
|      | UK TREASURY            | 12,050,000.00    | 10,164,175.00                         |  |
|      |                        |                  |                                       |  |

|               |                            |                |                                    |
|---------------|----------------------------|----------------|------------------------------------|
| 小計            | UK TREASURY                | 200,000.00     | 168,829.20                         |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 104,476.68                         |
|               | UK TREASURY                | 160,000.00     | 162,472.00                         |
|               | UK TREASURY                | 15,150,000.00  | 15,530,446.80                      |
|               | UK TREASURY                | 13,280,000.00  | 13,245,857.12                      |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 73,351.30                          |
|               | UK TREASURY                | 29,550,000.00  | 27,498,402.60                      |
|               | UK TREASURY                | 4,250,000.00   | 4,392,177.80                       |
|               | UK TREASURY                | 22,100,000.00  | 21,525,311.60                      |
|               | UK TREASURY                | 500,000.00     | 483,750.00                         |
|               | UK TREASURY                | 320,000.00     | 316,960.00                         |
|               | UK TREASURY                | 9,890,000.00   | 8,404,423.10                       |
|               | UK TREASURY                | 8,400,000.00   | 7,943,496.96                       |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 55,564.00                          |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 57,800.00                          |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 94,134.00                          |
|               | UK TREASURY                | 11,550,000.00  | 5,548,721.64                       |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 86,180.00                          |
|               | UK TREASURY                | 1,600,000.00   | 802,891.52                         |
|               | UK TREASURY                | 1,550,000.00   | 796,987.68                         |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 52,240.00                          |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 90,010.00                          |
|               | UK TREASURY                | 100,000.00     | 62,613.80                          |
|               | UK TREASURY                | 200,000.00     | 161,880.00                         |
|               | UK TSY 0 1/2% 2061         | 9,500,000.00   | 2,754,951.55                       |
|               | UK TSY 0 5/8% 2050         | 52,400,000.00  | 20,703,984.08                      |
|               | UK TSY 3 1/4% 2044         | 5,000,000.00   | 4,114,812.00                       |
|               | UNITED KINGDOM GILT        | 31,570,000.00  | 31,011,905.54                      |
|               | UNITED KINGDOM GILT        | 31,800,000.00  | 31,680,750.00                      |
|               | UNITED KINGDOM GILT        | 1,070,000.00   | 1,053,669.01                       |
|               | UNITED KINGDOM GILT        | 9,400,000.00   | 9,538,350.13                       |
|               | UNITED KINGDOM GILT        | 1,600,000.00   | 1,658,258.56                       |
|               | UNITED KINGDOM GILT        | 4,500,000.00   | 4,578,642.00                       |
|               | UNITED KINGDOM GILT        | 140,000.00     | 68,348.00                          |
|               | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 170,000.00     | 159,528.00                         |
|               | 銘柄数：45                     | 280,220,000.00 | 226,523,261.20<br>(42,892,179,508) |
|               | 組入時価比率：5.1%                |                | 5.2%                               |
| スウェーデン<br>ローナ | SWEDISH GOVERNMENT         | 41,350,000.00  | 40,969,580.00                      |
|               | SWEDISH GOVERNMENT         | 17,000,000.00  | 16,248,642.50                      |
|               | SWEDISH GOVERNMENT         | 18,300,000.00  | 17,046,409.74                      |
|               | SWEDISH GOVERNMENT         | 4,100,000.00   | 3,745,039.22                       |
|               | SWEDISH GOVERNMENT         | 13,100,000.00  | 11,150,792.05                      |
|               |                            |                |                                    |

|           |                        |                |                 |      |
|-----------|------------------------|----------------|-----------------|------|
| 小計        | SWEDISH GOVERNMENT     | 3,000,000.00   | 2,963,917.50    |      |
|           | SWEDISH GOVERNMENT     | 21,300,000.00  | 23,697,102.00   |      |
|           | 銘柄数：7                  | 118,150,000.00 | 115,821,483.01  |      |
|           | 組入時価比率：0.2%            |                | (1,666,671,140) | 0.2% |
| ノルウェークローネ | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 22,300,000.00  | 21,711,837.50   |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 9,400,000.00   | 8,950,351.00    |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 5,500,000.00   | 5,178,250.00    |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 9,400,000.00   | 8,769,730.00    |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 28,000,000.00  | 25,226,320.00   |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 8,200,000.00   | 7,085,780.72    |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 22,500,000.00  | 19,852,605.00   |      |
|           | NORWEGIAN GOVERNMENT   | 5,500,000.00   | 5,168,304.35    |      |
|           | 銘柄数：8                  | 110,800,000.00 | 101,943,178.57  |      |
| 小計        | 組入時価比率：0.2%            |                | (1,455,748,589) | 0.2% |
| デンマーククローネ | KINGDOM OF DENMARK     | 23,400,000.00  | 22,939,020.00   |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 3,300,000.00   | 3,069,062.04    |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 15,850,000.00  | 14,214,280.00   |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 4,600,000.00   | 4,479,940.00    |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 43,800,000.00  | 54,364,866.60   |      |
|           | KINGDOM OF DENMARK     | 7,500,000.00   | 4,013,362.50    |      |
| 小計        | 銘柄数：6                  | 98,450,000.00  | 103,080,531.14  |      |
|           | 組入時価比率：0.3%            |                | (2,236,847,525) | 0.3% |
| ズロチ       | POLAND GOVERNMENT BOND | 8,300,000.00   | 7,906,679.60    |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 5,300,000.00   | 5,169,545.80    |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 56,800,000.00  | 51,878,848.00   |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 10,700,000.00  | 11,672,833.30   |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 10,300,000.00  | 10,534,963.60   |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 3,300,000.00   | 2,915,596.20    |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 7,400,000.00   | 5,777,091.20    |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 2,900,000.00   | 2,222,531.00    |      |
|           | POLAND GOVERNMENT BOND | 16,300,000.00  | 16,977,587.74   |      |
| 小計        | 銘柄数：9                  | 121,300,000.00 | 115,055,676.44  |      |
|           | 組入時価比率：0.5%            |                | (4,288,757,867) | 0.5% |
| 豪ドル       | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 7,750,000.00   | 7,684,297.05    |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 14,130,000.00  | 14,255,577.54   |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,350,000.00   | 1,388,692.21    |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3,200,000.00   | 3,084,605.12    |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 300,000.00     | 286,070.67      |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,700,000.00   | 1,651,663.22    |      |
|           | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 9,300,000.00   | 8,737,350.00    |      |

|                |                        |                |                  |  |
|----------------|------------------------|----------------|------------------|--|
| 小計             | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 22,200,000.00  | 20,426,517.48    |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 4,600,000.00   | 3,778,857.68     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3,300,000.00   | 2,768,830.68     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 1,100,000.00   | 873,510.00       |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 600,000.00     | 480,006.90       |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2,500,000.00   | 2,060,729.00     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 20,900,000.00  | 21,412,591.31    |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 300,000.00     | 271,481.52       |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 100,000.00     | 96,192.66        |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 400,000.00     | 346,279.80       |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 12,300,000.00  | 11,596,694.61    |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 2,250,000.00   | 1,949,400.00     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 3,250,000.00   | 2,575,699.75     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 5,700,000.00   | 4,415,220.00     |  |
|                | AUSTRALIAN GOVERNMENT  | 7,000,000.00   | 3,888,500.00     |  |
|                | 銘柄数：22                 | 124,230,000.00 | 114,028,767.20   |  |
|                |                        |                | (11,202,186,089) |  |
|                | 組入時価比率：1.3%            |                | 1.4%             |  |
| ニュージーランド<br>ドル | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4,100,000.00   | 3,973,720.00     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 3,100,000.00   | 3,074,270.00     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 900,000.00     | 748,261.80       |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2,100,000.00   | 1,936,620.00     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 100,000.00     | 98,670.00        |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 300,000.00     | 243,150.00       |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4,000,000.00   | 3,614,081.20     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 6,450,000.00   | 5,064,518.71     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2,600,000.00   | 1,609,356.58     |  |
|                | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1,000,000.00   | 654,000.00       |  |
|                | 銘柄数：10                 | 24,650,000.00  | 21,016,648.29    |  |
|                |                        |                | (1,935,633,307)  |  |
|                | 組入時価比率：0.2%            |                | 0.2%             |  |
| シンガポールドル       | SINGAPORE GOVERNMENT   | 1,100,000.00   | 1,085,464.27     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 4,530,000.00   | 4,423,998.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 500,000.00     | 476,000.00       |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 5,050,000.00   | 5,111,610.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 200,000.00     | 196,720.00       |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 300,000.00     | 297,750.00       |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 5,260,000.00   | 5,201,088.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 400,000.00     | 361,880.00       |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3,930,000.00   | 4,031,649.45     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 3,220,000.00   | 2,952,740.00     |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 850,000.00     | 821,329.50       |  |
|                | SINGAPORE GOVERNMENT   | 2,500,000.00   | 2,401,250.00     |  |
|                |                        |                |                  |  |

|     |                       |                |                 |      |
|-----|-----------------------|----------------|-----------------|------|
| 小計  | SINGAPORE GOVERNMENT  | 3,500,000.00   | 2,808,750.00    |      |
|     | 銘柄数：13                | 31,340,000.00  | 30,170,229.22   |      |
|     | 組入時価比率：0.4%           |                | (3,365,187,367) | 0.4% |
| リング | MALAYSIA GOVERNMENT   | 1,000,000.00   | 1,006,232.50    |      |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT   | 100,000.00     | 106,404.40      |      |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT   | 3,300,000.00   | 3,282,558.84    |      |
|     | MALAYSIA GOVERNMENT   | 7,000,000.00   | 7,544,651.80    |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 800,000.00     | 806,493.76      |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 16,900,000.00  | 17,228,421.08   |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 4,600,000.00   | 4,649,518.54    |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 12,000,000.00  | 12,003,987.60   |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 3,700,000.00   | 3,716,749.53    |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 500,000.00     | 520,381.60      |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 280,000.00     | 283,224.03      |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 15,400,000.00  | 16,057,097.98   |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 400,000.00     | 370,703.52      |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 5,800,000.00   | 5,948,391.26    |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 10,200,000.00  | 10,145,431.02   |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 11,100,000.00  | 11,386,668.60   |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 14,350,000.00  | 15,804,072.58   |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 10,500,000.00  | 11,350,715.25   |      |
|     | MALAYSIAN GOVERNMENT  | 7,100,000.00   | 7,849,701.78    |      |
| 小計  | 銘柄数：19                | 125,030,000.00 | 130,061,405.67  |      |
|     | 組入時価比率：0.5%           |                | (4,082,588,505) | 0.5% |
| 人民元 | CHINA GOVERNMENT BOND | 142,100,000.00 | 142,469,388.95  |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 13,500,000.00  | 13,547,200.05   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 49,900,000.00  | 49,934,136.59   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 118,500,000.00 | 118,201,723.65  |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 73,500,000.00  | 73,523,836.05   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 81,800,000.00  | 81,878,560.72   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 156,500,000.00 | 156,846,037.15  |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 48,300,000.00  | 48,480,231.45   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 64,000,000.00  | 64,383,558.40   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 68,500,000.00  | 68,654,720.95   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 89,500,000.00  | 90,632,237.65   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 95,000,000.00  | 94,971,880.00   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 123,500,000.00 | 124,151,845.35  |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 33,000,000.00  | 33,176,863.50   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 84,800,000.00  | 85,475,041.92   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 54,000,000.00  | 54,370,321.20   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 16,500,000.00  | 16,576,894.95   |      |
|     | CHINA GOVERNMENT BOND | 93,900,000.00  | 95,181,209.16   |      |

|       |                       |                  |                          |
|-------|-----------------------|------------------|--------------------------|
|       |                       |                  |                          |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 63,000,000.00    | 63,837,616.50            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 109,500,000.00   | 109,829,759.25           |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 17,700,000.00    | 17,846,692.29            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 70,000,000.00    | 71,928,101.00            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 98,100,000.00    | 98,879,620.32            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 43,000,000.00    | 43,166,883.00            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 54,200,000.00    | 55,376,579.02            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 74,000,000.00    | 75,410,432.60            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 93,500,000.00    | 94,684,860.05            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 49,200,000.00    | 50,239,182.72            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 73,000,000.00    | 74,406,929.00            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 156,000,000.00   | 157,397,619.60           |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 114,800,000.00   | 115,350,730.04           |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 23,800,000.00    | 24,655,288.70            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 20,000,000.00    | 20,558,610.00            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 20,000,000.00    | 20,441,768.00            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 31,500,000.00    | 32,078,995.20            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 63,300,000.00    | 64,181,699.37            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 49,400,000.00    | 50,514,750.52            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 70,300,000.00    | 72,452,065.78            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 76,000,000.00    | 77,024,715.60            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 106,000,000.00   | 105,971,570.80           |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 87,200,000.00    | 88,948,237.92            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 15,000,000.00    | 17,883,142.50            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 36,000,000.00    | 41,895,601.20            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 87,700,000.00    | 98,781,763.23            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 66,100,000.00    | 71,452,850.71            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 72,800,000.00    | 81,039,736.96            |
|       | CHINA GOVERNMENT BOND | 26,000,000.00    | 27,915,427.80            |
| 小計    | 銘柄数：47                | 3,273,900,000.00 | 3,336,606,917.37         |
|       | 組入時価比率：8.3%           |                  | (69,514,534,855)<br>8.5% |
| 新シェケル | ISRAEL FIXED BOND     | 700,000.00       | 673,266.23               |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 15,400,000.00    | 14,937,282.36            |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 5,600,000.00     | 5,264,130.48             |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 6,500,000.00     | 6,887,355.80             |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 5,000,000.00     | 4,731,709.00             |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 7,600,000.00     | 7,094,485.24             |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 6,900,000.00     | 5,771,476.71             |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 5,900,000.00     | 4,125,579.13             |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 10,300,000.00    | 11,354,586.10            |
|       | ISRAEL FIXED BOND     | 5,700,000.00     | 4,896,354.72             |

|    |                       |               |                                          |  |
|----|-----------------------|---------------|------------------------------------------|--|
| 小計 | 銘柄数：10<br>組入時価比率：0.3% | 69,600,000.00 | 65,736,225.77<br>(2,731,682,009)<br>0.3% |  |
| 合計 |                       |               | 822,190,531,462<br>(822,190,531,462)     |  |

(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(2024年 2月19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  | 40,700,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 37,500,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 45,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 27,700,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 17,900,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,000,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 38,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 40,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 9,000,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 19,400,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 20,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 33,500,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 29,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 85,000     |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 85,000     |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 50,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 15,400,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 45,877,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 24,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 50,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 9,000,000  |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 1,222,000  |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 2,000,000  |    |
|      |     | US TREASURY BOND | 19,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 50,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 20,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 2,500,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 45,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 36,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 40,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 34,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 170,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 11,985,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 7,225,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 43,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 1,000,000  |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 40,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 26,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 27,000,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 13,900,000 |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 425,000    |    |
|      |     | US TREASURY N/B  | 39,000,000 |    |

|            |                          |            |  |
|------------|--------------------------|------------|--|
|            | US TREASURY N/B          | 40,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 1,000,000  |  |
|            | US TREASURY N/B          | 32,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 17,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 85,000     |  |
|            | US TREASURY N/B          | 15,300,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 20,300,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 24,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 50,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 3,000,000  |  |
|            | US TREASURY N/B          | 5,605,000  |  |
|            | US TREASURY N/B          | 38,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 20,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 85,000     |  |
|            | US TREASURY N/B          | 85,000     |  |
|            | US TREASURY N/B          | 28,700,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 27,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 34,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 85,000     |  |
|            | US TREASURY N/B          | 50,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 41,200,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 28,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 1,400,000  |  |
|            | US TREASURY N/B          | 24,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 34,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 2,400,000  |  |
|            | US TREASURY N/B          | 5,930,000  |  |
|            | US TREASURY N/B          | 9,000,000  |  |
|            | US TREASURY N/B          | 28,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 85,000     |  |
|            | US TREASURY N/B          | 85,000     |  |
|            | US TREASURY N/B          | 11,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 31,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 85,000     |  |
|            | US TREASURY N/B          | 18,800,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 50,000,000 |  |
|            | US TREASURY N/B          | 8,000,000  |  |
| 豪ドル        | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 2,000,000  |  |
|            | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 100,000    |  |
|            | AUSTRALIAN GOVERNMENT    | 10,000,000 |  |
| ニュージーランドドル | NEW ZEALAND GOVERNMENT   | 3,400,000  |  |
| ノルウェークローネ  | NORWEGIAN GOVERNMENT     | 4,000,000  |  |
| ユーロ        | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN  | 950,000    |  |
|            | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1,000,000  |  |
|            | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,126,000  |  |
|            | FRANCE GOVERNMENT O.A.T  | 1,000,000  |  |
|            | BELGIUM KINGDOM          | 1,000,000  |  |
|            | SPANISH GOVERNMENT       | 7,800,000  |  |
|            | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 8,000,000  |  |
|            | NETHERLANDS GOVERNMENT   | 7,700,000  |  |
|            | FINNISH GOVERNMENT       | 1,700,000  |  |
|            | BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,400,000 |  |
|            |                          |            |  |



|  |                          |            |
|--|--------------------------|------------|
|  | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,625,000  |
|  | BUONI POLIENNALI DEL TES | 10,000,000 |

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類        | 2024年 2月19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        | 1,678,861,077 | —     | 1,685,940,700 | 7,079,623 |
| 米ドル       | 480,607,327   | —     | 479,922,750   | △684,577  |
| カナダドル     | 55,438,090    | —     | 55,687,050    | 248,960   |
| メキシコペソ    | 44,053,500    | —     | 44,007,500    | △46,000   |
| ユーロ       | 258,455,200   | —     | 258,811,080   | 355,880   |
| ノルウェークローネ | 49,818,510    | —     | 49,958,300    | 139,790   |
| デンマーククローネ | 43,193,000    | —     | 43,395,800    | 202,800   |
| 人民元       | 747,295,450   | —     | 754,158,220   | 6,862,770 |
| 合計        | 1,678,861,077 | —     | 1,685,940,700 | 7,079,623 |

(注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 世界REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2024年 2月19日現在)

|          |                 |
|----------|-----------------|
| 資産の部     |                 |
| 流動資産     |                 |
| 預金       | 820,789,802     |
| コール・ローン  | 674,088,720     |
| 投資証券     | 156,507,920,181 |
| 派生商品評価勘定 | 3,539,212       |
| 未収入金     | 14,930,759      |
| 未収配当金    | 325,068,222     |
| 差入委託証拠金  | 269,397,797     |
| 流動資産合計   | 158,615,734,693 |
| 資産合計     | 158,615,734,693 |
| 負債の部     |                 |
| 流動負債     |                 |
| 派生商品評価勘定 | 31,620,558      |
| 未払金      | 582,214,903     |
| 未払解約金    | 181,274,507     |
| 未払利息     | 71              |
| その他未払費用  | 382,200         |
| 流動負債合計   | 795,492,239     |
| 負債合計     | 795,492,239     |
| 純資産の部    |                 |

(2024年 2月19日現在)

|                 |                 |
|-----------------|-----------------|
| 元本等             |                 |
| 元本              | 59,000,888,985  |
| 剰余金             |                 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（△） | 98,819,353,469  |
| 元本等合計           | 157,820,242,454 |
| 純資産合計           | 157,820,242,454 |
| 負債純資産合計         | 158,615,734,693 |

## 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。<br>先物取引<br>国内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。<br>外国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。<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>配当株式<br>配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。                                                                          |
| 4. 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>為替差損益<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)

|                            |           |
|----------------------------|-----------|
| 2024年 2月19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                  | 2.6749円   |
| (10,000口当たり純資産額)           | (26,749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 2023年 2月21日<br>至 2024年 2月19日                                                                      |  |
| 1. 金融商品に対する取組方針                                                                                     |  |
| 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |  |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク                                                                            |  |
| 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。                                          |  |
| 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。                                                                  |  |
| これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。                                          |  |
| 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。                                              |  |
| 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。                                                 |  |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制                                                                                   |  |

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

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

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

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

**(2)金融商品の時価等に関する事項**

2024年 2月19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**

2024年 2月19日現在

|                                  |                 |
|----------------------------------|-----------------|
| 期首                               | 2023年 2月21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 | 52,895,570,153円 |
| 同期中における追加設定元本額                   | 12,333,836,704円 |
| 同期中における一部解約元本額                   | 6,228,517,872円  |
| 期末元本額                            | 59,000,888,985円 |
| 期末元本額の内訳＊                        |                 |
| 野村世界REITインデックス Bコース（野村投資一任口座向け）  | 9,052,951,008円  |
| のむラップ・ファンド（保守型）                  | 1,614,780,928円  |
| のむラップ・ファンド（普通型）                  | 15,453,826,338円 |
| のむラップ・ファンド（積極型）                  | 10,199,636,971円 |
| マイ・ロード                           | 791,629,081円    |
| 野村世界REITインデックス（野村SMA・EW向け）       | 1,618,301,165円  |
| のむラップ・ファンド（やや保守型）                | 350,955,281円    |
| のむラップ・ファンド（やや積極型）                | 1,333,108,141円  |
| 野村世界REITインデックスファンド（確定拠出年金向け）     | 18,585,700,072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(2024年2月19日現在)**

該当事項はありません。

**(2)株式以外の有価証券(2024年2月19日現在)**

| 種類   | 通貨  | 銘柄                      | 券面総額  | 評価額         | 備考 |
|------|-----|-------------------------|-------|-------------|----|
| 投資証券 | 日本円 | エスコンジャパンリート投資法人 投資証券    | 276   | 31,712,400  |    |
|      |     | サンケイリアルエステート投資法人 投資証券   | 368   | 32,641,600  |    |
|      |     | SOSiLA物流リート投資法人 投資証券    | 512   | 57,497,600  |    |
|      |     | 東海道リート投資法人 投資証券         | 144   | 18,043,200  |    |
|      |     | 日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券 | 371   | 217,035,000 |    |
|      |     | 森ヒルズリート投資法人 投資証券        | 1,194 | 155,100,600 |    |
|      |     | 産業ファンド投資法人 投資証券         | 1,553 | 194,901,500 |    |
|      |     | アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券    | 1,052 | 321,386,000 |    |
|      |     | アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券 | 521   | 201,106,000 |    |
|      |     | GLP投資法人 投資証券            | 3,640 | 451,360,000 |    |

|                          |       |             |  |
|--------------------------|-------|-------------|--|
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券  | 514   | 150,859,000 |  |
| 日本プロロジスリート投資法人 投資証券      | 1,797 | 456,977,100 |  |
| 星野リゾート・リート投資法人 投資証券      | 186   | 100,068,000 |  |
| Oneリート投資法人 投資証券          | 184   | 48,392,000  |  |
| イオンリート投資法人 投資証券          | 1,290 | 169,893,000 |  |
| ヒューリックリート投資法人 投資証券       | 935   | 139,876,000 |  |
| 日本リート投資法人 投資証券           | 325   | 104,650,000 |  |
| 積水ハウス・リート投資法人 投資証券       | 3,191 | 235,495,800 |  |
| トーセイ・リート投資法人 投資証券        | 208   | 28,454,400  |  |
| ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券     | 278   | 35,945,400  |  |
| サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券    | 517   | 52,992,500  |  |
| 野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券   | 3,467 | 519,356,600 |  |
| いちごホテルリート投資法人 投資証券       | 262   | 29,029,600  |  |
| ラサールロジポート投資法人 投資証券       | 1,383 | 197,215,800 |  |
| スターアジア不動産投資法人 投資証券       | 1,691 | 95,034,200  |  |
| マリモ地方創生リート投資法人 投資証券      | 159   | 19,223,100  |  |
| 三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券 | 422   | 179,561,000 |  |
| 大江戸温泉リート投資法人 投資証券        | 161   | 11,833,500  |  |
| 投資法人みらい 投資証券             | 1,292 | 56,783,400  |  |
| 三菱地所物流リート投資法人 投資証券       | 378   | 132,678,000 |  |
| CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券  | 442   | 62,940,800  |  |
| ザイマックス・リート投資法人 投資証券      | 176   | 20,451,200  |  |
| タカラレーベン不動産投資法人 投資証券      | 483   | 48,155,100  |  |
| アドバンス・ロジスティクス投資法人        | 493   | 60,047,400  |  |
| 日本ビルファンド投資法人 投資証券        | 1,254 | 726,066,000 |  |
| ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券    | 1,041 | 555,894,000 |  |
| 日本都市ファンド投資法人 投資証券        | 5,117 | 473,322,500 |  |
| オリックス不動産投資法人 投資証券        | 2,017 | 326,350,600 |  |
| 日本プライムリアルティ投資法人 投資証券     | 738   | 242,433,000 |  |
| NTT都市開発リート投資法人           | 1,080 | 129,924,000 |  |
| 東急リアル・エステート投資法人 投資証券     | 686   | 110,720,400 |  |
| グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券     | 741   | 78,027,300  |  |
| ユナイテッド・アーバン投資法人          | 2,297 | 321,350,300 |  |

|     |                               |         |                |  |
|-----|-------------------------------|---------|----------------|--|
|     | 投資証券                          |         |                |  |
|     | 森トラストリート投資法人 投資証券             | 1,937   | 136,558,500    |  |
|     | インヴィンシブル投資法人 投資証券             | 4,996   | 308,253,200    |  |
|     | フロンティア不動産投資法人 投資証券            | 374     | 156,332,000    |  |
|     | 平和不動産リート投資法人 投資証券             | 742     | 97,944,000     |  |
|     | 日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券        | 692     | 177,774,800    |  |
|     | 福岡リート投資法人 投資証券                | 515     | 85,747,500     |  |
|     | KDX不動産投資法人 投資証券               | 3,035   | 449,787,000    |  |
|     | いちごオフィスリート投資法人 投資証券           | 742     | 58,098,600     |  |
|     | 大和証券オフィス投資法人 投資証券             | 212     | 124,868,000    |  |
|     | 阪急阪神リート投資法人 投資証券              | 514     | 70,418,000     |  |
|     | スターツプロシード投資法人 投資証券            | 182     | 35,126,000     |  |
|     | 大和ハウスリート投資法人 投資証券             | 1,558   | 372,050,400    |  |
|     | ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券         | 3,446   | 252,247,200    |  |
|     | 大和証券リビング投資法人 投資証券             | 1,761   | 178,565,400    |  |
|     | ジャパンエクセレント投資法人 投資証券           | 928     | 108,761,600    |  |
| 小計  | 銘柄数：58                        | 66,470  | 10,213,317,100 |  |
|     | 組入時価比率：6.5%                   |         | 6.5%           |  |
| 米ドル | ACADIA REALTY TRUST           | 70,000  | 1,179,500.00   |  |
|     | AGREE REALTY CORP             | 73,700  | 4,203,111.00   |  |
|     | ALEXANDER & BALDWIN INC       | 53,000  | 919,550.00     |  |
|     | ALEXANDERS INC                | 1,500   | 336,390.00     |  |
|     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT  | 115,000 | 13,717,200.00  |  |
|     | ALPINE INCOME PROPERTY TRUST  | 8,000   | 127,360.00     |  |
|     | AMERICAN ASSETS TRUST INC     | 36,000  | 784,080.00     |  |
|     | AMERICAN HOMES 4 RENT-A       | 234,100 | 8,060,063.00   |  |
|     | AMERICOLD REALTY TRUST INC    | 196,000 | 5,327,280.00   |  |
|     | APARTMENT INCOME REIT CO      | 107,900 | 3,418,272.00   |  |
|     | APARTMENT INVT&MGMT CO-A      | 100,000 | 766,000.00     |  |
|     | APPLE HOSPITALITY REIT INC    | 155,000 | 2,469,150.00   |  |
|     | ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 48,000  | 547,680.00     |  |
|     | ASHFORD HOSPITALITY TRUST     | 22,000  | 35,640.00      |  |
|     | AVALONBAY COMMUNITIES INC     | 104,400 | 18,491,328.00  |  |
|     | BOSTON PROPERTIES             | 105,600 | 7,113,216.00   |  |
|     | BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC  | 46,000  | 110,860.00     |  |
|     | BRANDYWINE REALTY TRUST       | 129,000 | 545,670.00     |  |
|     | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC    | 220,000 | 5,088,600.00   |  |
|     | BROADSTONE NET LEASE INC-A    | 136,000 | 2,125,680.00   |  |
|     | BRT APARTMENTS CORP           | 8,000   | 131,440.00     |  |

|                                    |         |               |  |
|------------------------------------|---------|---------------|--|
| CAMDEN PROPERTY TRUST              | 78,600  | 7,558,176.00  |  |
| CARETRUST REIT INC                 | 88,000  | 1,994,960.00  |  |
| CBL & ASSOCIATES PROPERTIES        | 19,000  | 444,030.00    |  |
| CENTERSPACE                        | 10,600  | 594,448.00    |  |
| CHATHAM LODGING TRUST              | 37,000  | 388,500.00    |  |
| CITY OFFICE REIT INC               | 26,000  | 123,500.00    |  |
| CLIPPER REALTY INC                 | 10,000  | 49,200.00     |  |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I       | 18,200  | 494,858.00    |  |
| COPT DEFENSE PROPERTIES            | 83,000  | 1,998,640.00  |  |
| COUSINS PROPERTIES INC             | 111,000 | 2,620,710.00  |  |
| CTO REALTY GROWTH INC              | 14,000  | 230,020.00    |  |
| CUBESMART                          | 164,900 | 7,163,256.00  |  |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO         | 153,000 | 1,406,070.00  |  |
| DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT       | 570,000 | 353,400.00    |  |
| DIGITAL REALTY TRUST INC           | 222,500 | 30,308,950.00 |  |
| DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST       | 150,000 | 444,000.00    |  |
| DOUGLAS EMMETT INC                 | 122,000 | 1,677,500.00  |  |
| EAGLE HOSPITALITY TRUST            | 240,000 | 0.00          |  |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 68,000  | 794,240.00    |  |
| EASTGROUP PROPERTIES               | 33,900  | 6,193,869.00  |  |
| ELME COMMUNITIES                   | 64,000  | 903,040.00    |  |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN       | 96,000  | 966,720.00    |  |
| EPR PROPERTIES                     | 54,700  | 2,307,246.00  |  |
| EQUINIX INC                        | 68,960  | 59,045,620.80 |  |
| EQUITY COMMONWEALTH                | 78,000  | 1,447,680.00  |  |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES        | 137,200 | 9,079,896.00  |  |
| EQUITY RESIDENTIAL                 | 254,100 | 15,253,623.00 |  |
| ESSENTIAL PROPERTIES REALTY        | 115,000 | 2,839,350.00  |  |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC           | 47,200  | 11,109,464.00 |  |
| EXTRA SPACE STORAGE INC            | 155,300 | 21,985,821.00 |  |
| FARMLAND PARTNERS INC              | 32,000  | 368,960.00    |  |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST          | 54,100  | 5,432,722.00  |  |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR         | 97,500  | 5,337,150.00  |  |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST        | 66,000  | 1,554,300.00  |  |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C       | 65,000  | 153,400.00    |  |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE       | 196,500 | 8,879,835.00  |  |
| GETTY REALTY CORP                  | 35,000  | 949,200.00    |  |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP          | 29,000  | 368,300.00    |  |
| GLADSTONE LAND CORP                | 23,000  | 310,270.00    |  |
| GLOBAL MEDICAL REIT INC            | 46,000  | 440,680.00    |  |
| GLOBAL NET LEASE INC               | 145,000 | 1,168,700.00  |  |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC        | 278,000 | 3,992,080.00  |  |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC          | 401,000 | 6,881,160.00  |  |

|                                          |           |               |  |
|------------------------------------------|-----------|---------------|--|
|                                          |           |               |  |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC                 | 77,000    | 1,821,050.00  |  |
| HOST HOTELS & RESORTS INC                | 519,000   | 10,234,680.00 |  |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN             | 95,000    | 688,750.00    |  |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN             | 164,000   | 2,551,840.00  |  |
| INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES          | 38,000    | 154,660.00    |  |
| INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC     | 20,600    | 1,895,200.00  |  |
| INVENTRUST PROPERTIES CORP               | 50,000    | 1,282,000.00  |  |
| INVITATION HOMES INC                     | 423,000   | 13,832,100.00 |  |
| IRON MOUNTAIN INC                        | 214,700   | 14,595,306.00 |  |
| JBG SMITH PROPERTIES                     | 64,000    | 1,048,960.00  |  |
| KEPPEL PACIFIC OAK US REIT               | 570,000   | 84,360.00     |  |
| KILROY REALTY CORP                       | 77,600    | 2,813,776.00  |  |
| KIMCO REALTY CORP                        | 487,000   | 9,559,810.00  |  |
| KITE REALTY GROUP TRUST                  | 160,000   | 3,436,800.00  |  |
| LTC PROPERTIES INC                       | 30,300    | 954,753.00    |  |
| LXP INDUSTRIAL TRUST                     | 213,000   | 1,838,190.00  |  |
| MACERICH CO /THE                         | 158,000   | 2,720,760.00  |  |
| MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 1,139,999 | 64,979.94     |  |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC             | 441,000   | 1,569,960.00  |  |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM               | 85,500    | 11,044,035.00 |  |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES              | 56,200    | 2,063,102.00  |  |
| NATL HEALTH INVESTORS INC                | 32,300    | 1,720,298.00  |  |
| NET LEASE OFFICE PROPERTY                | 10,430    | 282,235.80    |  |
| NETSTREIT CORP                           | 51,000    | 883,830.00    |  |
| NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST   | 21,522    | 145,919.16    |  |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC           | 16,300    | 506,604.00    |  |
| NNN REIT INC                             | 134,500   | 5,487,600.00  |  |
| OFFICE PROPERTIES INCOME                 | 32,000    | 120,640.00    |  |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS               | 179,900   | 5,567,905.00  |  |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC               | 11,000    | 225,940.00    |  |
| ORION OFFICE REIT INC                    | 39,000    | 188,370.00    |  |
| PARAMOUNT GROUP INC                      | 123,000   | 597,780.00    |  |
| PARK HOTELS & RESORTS INC                | 156,000   | 2,349,360.00  |  |
| PEAKSTONE REALTY TRUST                   | 25,000    | 366,500.00    |  |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST                  | 87,000    | 1,398,960.00  |  |
| PHILLIPS EDISON & CO INC                 | 87,800    | 3,033,490.00  |  |
| PHYSICIANS REALTY TRUST                  | 173,000   | 2,003,340.00  |  |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A             | 92,000    | 622,840.00    |  |
| PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC             | 26,000    | 580,060.00    |  |
| POSTAL REALTY TRUST INC-A                | 15,000    | 210,450.00    |  |
| PRIME US REIT                            | 340,000   | 40,460.00     |  |

|       |                                  |            |                   |  |
|-------|----------------------------------|------------|-------------------|--|
| 小計    | PROLOGIS INC                     | 678,600    | 90,518,454.00     |  |
|       | PUBLIC STORAGE                   | 116,300    | 32,740,776.00     |  |
|       | REALTY INCOME CORP               | 611,000    | 31,973,630.00     |  |
|       | REGENCY CENTERS CORP             | 120,500    | 7,327,605.00      |  |
|       | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN     | 92,000     | 1,179,440.00      |  |
|       | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC    | 155,400    | 8,247,078.00      |  |
|       | RLJ LODGING TRUST                | 114,000    | 1,333,800.00      |  |
|       | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES     | 44,000     | 5,114,560.00      |  |
|       | SABRA HEALTH CARE REIT INC       | 168,000    | 2,310,000.00      |  |
|       | SAFEHOLD INC                     | 32,000     | 679,680.00        |  |
|       | SAUL CENTERS INC                 | 9,700      | 361,228.00        |  |
|       | SERVICE PROPERTIES TRUST         | 124,000    | 961,000.00        |  |
|       | SIMON PROPERTY GROUP INC         | 239,700    | 35,945,412.00     |  |
|       | SITE CENTERS CORP                | 134,000    | 1,900,120.00      |  |
|       | SL GREEN REALTY CORP             | 47,000     | 2,205,240.00      |  |
|       | STAG INDUSTRIAL INC              | 133,800    | 5,231,580.00      |  |
|       | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC      | 80,000     | 519,200.00        |  |
|       | SUN COMMUNITIES INC              | 91,200     | 11,856,000.00     |  |
|       | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC     | 149,000    | 1,625,590.00      |  |
|       | TANGER INC                       | 78,000     | 2,233,920.00      |  |
|       | TERRENO REALTY CORP              | 61,700     | 3,868,590.00      |  |
|       | UDR INC                          | 222,800    | 8,038,624.00      |  |
|       | UMH PROPERTIES INC               | 46,000     | 673,900.00        |  |
|       | UNITI GROUP INC                  | 177,000    | 902,700.00        |  |
|       | UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME     | 9,100      | 361,361.00        |  |
|       | URBAN EDGE PROPERTIES            | 86,000     | 1,489,520.00      |  |
|       | VENTAS INC                       | 295,900    | 12,948,584.00     |  |
|       | VERIS RESIDENTIAL INC            | 58,000     | 908,860.00        |  |
|       | VICI PROPERTIES INC              | 760,000    | 22,442,800.00     |  |
|       | VORNADO REALTY TRUST             | 118,000    | 3,077,440.00      |  |
|       | WELLTOWER INC                    | 406,600    | 37,866,658.00     |  |
|       | WHITESTONE REIT                  | 36,000     | 448,560.00        |  |
|       | WP CAREY INC                     | 160,900    | 9,235,660.00      |  |
|       | XENIA HOTELS & RESORTS INC       | 77,000     | 1,018,710.00      |  |
|       | 銘柄数：139                          | 19,197,311 | 759,245,548.70    |  |
|       |                                  |            | (113,909,609,671) |  |
|       | 組入時価比率：72.2%                     |            | 72.7%             |  |
| カナダドル | ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT     | 46,000     | 821,100.00        |  |
|       | ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT     | 36,000     | 221,760.00        |  |
|       | BOARDWALK REAL ESTATE INVEST     | 18,600     | 1,360,218.00      |  |
|       | BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 13,000     | 200,720.00        |  |
|       | BTB REAL ESTATE INVESTMENT T     | 36,000     | 108,900.00        |  |
|       | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA     | 60,900     | 3,066,315.00      |  |
|       |                                  |            |                   |  |



|     |                                          |           |                 |  |
|-----|------------------------------------------|-----------|-----------------|--|
| 小計  | CHOICE PROPERTIES REIT                   | 117,000   | 1,583,010.00    |  |
|     | CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT           | 38,000    | 530,860.00      |  |
|     | CT REAL ESTATE INVESTMENT TR             | 43,000    | 620,920.00      |  |
|     | DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT  | 99,000    | 1,337,490.00    |  |
|     | DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 11,000    | 88,220.00       |  |
|     | FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT     | 75,000    | 1,233,000.00    |  |
|     | GRANITE REAL ESTATE INVESTME             | 22,600    | 1,688,220.00    |  |
|     | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS             | 91,000    | 873,600.00      |  |
|     | INTERRENT REAL ESTATE INVEST             | 54,000    | 750,600.00      |  |
|     | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE             | 41,000    | 804,830.00      |  |
|     | MINTO APARTMENT REAL ESTATE              | 13,000    | 221,780.00      |  |
|     | MORGUARD NORTH AMERICAN RESI             | 12,100    | 190,696.00      |  |
|     | NEXUS INDUSTRIAL REIT                    | 22,000    | 175,120.00      |  |
|     | NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT             | 86,000    | 378,400.00      |  |
|     | PRIMARIS REIT                            | 37,500    | 522,000.00      |  |
|     | PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST         | 17,000    | 93,330.00       |  |
|     | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR              | 110,000   | 2,038,300.00    |  |
|     | SLATE GROCERY REIT                       | 19,000    | 228,570.00      |  |
|     | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV             | 53,000    | 1,274,120.00    |  |
|     | TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E             | 4,522     | 41,828.50       |  |
|     | 銘柄数：26                                   | 1,176,222 | 20,453,907.50   |  |
|     |                                          |           | (2,278,360,756) |  |
|     | 組入時価比率：1.4%                              |           | 1.5%            |  |
| ユーロ | AEDIFICA                                 | 34,700    | 1,932,790.00    |  |
|     | ALTAREA                                  | 3,200     | 246,080.00      |  |
|     | CARE PROPERTY INVEST                     | 27,000    | 341,820.00      |  |
|     | CARMILA                                  | 40,000    | 596,000.00      |  |
|     | COFINIMMO                                | 26,900    | 1,682,595.00    |  |
|     | COVIVIO                                  | 35,900    | 1,492,004.00    |  |
|     | CROMWELL REIT EUR                        | 240,000   | 331,200.00      |  |
|     | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV             | 30,306    | 606,120.00      |  |
|     | GECINA SA                                | 37,800    | 3,524,850.00    |  |
|     | HAMBORNER REIT AG                        | 52,000    | 333,320.00      |  |
|     | ICADE                                    | 23,000    | 705,180.00      |  |
|     | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ             | 41,000    | 88,765.00       |  |
|     | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA          | 206,000   | 1,066,050.00    |  |
|     | INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES           | 21,200    | 442,020.00      |  |
|     | IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES             | 320,000   | 331,520.00      |  |
|     | KLEPIERRE                                | 141,000   | 3,338,880.00    |  |
|     | LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM             | 34,000    | 212,160.00      |  |
|     | MERCIALYS                                | 70,000    | 712,600.00      |  |
|     | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA              | 248,000   | 2,272,920.00    |  |
|     |                                          |           |                 |  |

|      |                                        |           |                 |  |
|------|----------------------------------------|-----------|-----------------|--|
| 小計   | MONTEA                                 | 11,400    | 869,820.00      |  |
|      | NSI NV                                 | 13,700    | 269,068.00      |  |
|      | RETAIL ESTATES                         | 8,700     | 519,390.00      |  |
|      | SHURGARD SELF STORAGE LTD              | 22,700    | 935,580.50      |  |
|      | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 74,700    | 5,230,494.00    |  |
|      | VASTNED RETAIL NV                      | 12,000    | 251,400.00      |  |
|      | WAREHOUSES DE PAUW SCA                 | 128,000   | 3,297,280.00    |  |
|      | WERELDHAVE NV                          | 31,000    | 419,120.00      |  |
|      | XIOR STUDENT HOUSING NV                | 20,200    | 528,230.00      |  |
|      | 銘柄数：28                                 | 1,954,406 | 32,577,256.50   |  |
|      |                                        |           | (5,271,325,874) |  |
| 英ボンド | 組入時価比率：3.3%                            |           | 3.4%            |  |
|      | ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED    | 280,000   | 141,400.00      |  |
|      | AEW UK REIT PLC                        | 120,000   | 109,200.00      |  |
|      | ASSURA PLC                             | 2,170,000 | 912,702.00      |  |
|      | BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD | 490,000   | 384,650.00      |  |
|      | BIG YELLOW GROUP PLC                   | 146,000   | 1,562,200.00    |  |
|      | BRITISH LAND                           | 691,000   | 2,589,868.00    |  |
|      | CLS HOLDINGS PLC                       | 90,000    | 83,700.00       |  |
|      | CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT PLC     | 330,000   | 222,750.00      |  |
|      | DERWENT LONDON PLC                     | 84,000    | 1,666,560.00    |  |
|      | EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC           | 430,000   | 390,870.00      |  |
|      | GREAT PORTLAND ESTATES PLC             | 185,000   | 700,040.00      |  |
|      | HAMMERSON PLC                          | 2,830,000 | 738,064.00      |  |
|      | HELICAL PLC                            | 73,000    | 137,824.00      |  |
|      | HOME REIT PLC                          | 540,000   | 102,735.00      |  |
|      | IMPACT HEALTHCARE REIT PLC             | 333,750   | 268,335.00      |  |
|      | INTU PROPERTIES PLC                    | 335,000   | 0.00            |  |
|      | LAND SECURITIES GROUP PLC              | 548,000   | 3,536,792.00    |  |
|      | LIFE SCIENCE REIT PLC                  | 230,000   | 111,090.00      |  |
|      | LONDONMETRIC PROPERTY PLC              | 790,000   | 1,485,990.00    |  |
|      | LXI REIT PLC                           | 1,290,000 | 1,308,060.00    |  |
|      | NEWRIVER REIT PLC                      | 210,000   | 158,760.00      |  |
|      | PICTON PROPERTY INCOME LTD             | 440,000   | 279,400.00      |  |
|      | PRIMARY HEALTH PROPERTIES              | 980,000   | 895,230.00      |  |
|      | PRS REIT PLC/THE                       | 370,000   | 281,200.00      |  |
|      | REGIONAL REIT LTD                      | 280,000   | 61,740.00       |  |
|      | SAFESTORE HOLDINGS PLC                 | 157,000   | 1,275,625.00    |  |
|      | SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST  | 340,000   | 154,190.00      |  |
|      | SEGRO PLC                              | 902,000   | 7,661,588.00    |  |
|      | SHAFTESBURY CAPITAL PLC                | 1,450,000 | 1,914,000.00    |  |
|      | SUPERMARKET INCOME REIT PLC            | 900,000   | 691,200.00      |  |

|     |                                         |            |                 |      |
|-----|-----------------------------------------|------------|-----------------|------|
| 小計  | TARGET HEALTHCARE REIT PLC              | 450,000    | 349,200.00      |      |
|     | TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING             | 240,000    | 132,000.00      |      |
|     | TRITAX BIG BOX REIT PLC                 | 1,380,000  | 2,176,260.00    |      |
|     | UK COMMERCIAL PROPERTY REIT             | 680,000    | 459,000.00      |      |
|     | UNITE GROUP PLC                         | 295,000    | 2,955,900.00    |      |
|     | URBAN LOGISTICS REIT PLC                | 350,000    | 445,900.00      |      |
|     | WAREHOUSE REIT PLC                      | 320,000    | 267,520.00      |      |
|     | WORKSPACE GROUP PLC                     | 99,000     | 504,900.00      |      |
|     | 銘柄数：38                                  | 21,828,750 | 37,116,443.00   |      |
|     | 組入時価比率：4.5%                             |            | (7,027,998,482) | 4.5% |
| 豪ドル | ABACUS GROUP                            | 360,000    | 388,800.00      |      |
|     | ABACUS STORAGE KING                     | 380,000    | 469,300.00      |      |
|     | ARENA REIT                              | 270,000    | 977,400.00      |      |
|     | BWP TRUST                               | 340,000    | 1,196,800.00    |      |
|     | CENTURIA CAPITAL GROUP                  | 620,000    | 1,125,300.00    |      |
|     | CENTURIA INDUSTRIAL REIT                | 410,000    | 1,394,000.00    |      |
|     | CENTURIA OFFICE REIT                    | 300,000    | 375,000.00      |      |
|     | CHARTER HALL GROUP                      | 347,000    | 4,309,740.00    |      |
|     | CHARTER HALL LONG WALE REIT             | 490,000    | 1,866,900.00    |      |
|     | CHARTER HALL RETAIL REIT                | 368,000    | 1,405,760.00    |      |
|     | CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT | 230,000    | 632,500.00      |      |
|     | CROMWELL PROPERTY GROUP                 | 920,000    | 368,000.00      |      |
|     | DEXUS INDUSTRIA REIT                    | 170,000    | 493,000.00      |      |
|     | DEXUS/AU                                | 800,000    | 6,288,000.00    |      |
|     | GDI PROPERTY GROUP                      | 362,730    | 233,960.85      |      |
|     | GOODMAN GROUP                           | 1,267,000  | 36,248,870.00   |      |
|     | GPT GROUP                               | 1,400,000  | 6,370,000.00    |      |
|     | GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR            | 210,000    | 493,500.00      |      |
|     | HEALTHCO REIT                           | 380,000    | 520,600.00      |      |
|     | HMC CAPITAL LTD                         | 181,325    | 1,182,239.00    |      |
|     | HOMEKO DAILY NEEDS REIT                 | 1,280,000  | 1,625,600.00    |      |
|     | HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L            | 130,000    | 387,400.00      |      |
|     | INGENIA COMMUNITIES GROUP               | 280,000    | 1,349,600.00    |      |
|     | MIRVAC GROUP                            | 2,930,000  | 6,739,000.00    |      |
|     | NATIONAL STORAGE REIT                   | 910,000    | 2,120,300.00    |      |
|     | REGION RE LTD                           | 870,000    | 1,983,600.00    |      |
|     | RURAL FUNDS GROUP                       | 260,000    | 553,800.00      |      |
|     | SCENTRE GROUP                           | 3,800,000  | 11,590,000.00   |      |
|     | STOCKLAND TRUST GROUP                   | 1,760,000  | 8,254,400.00    |      |
|     | VICINITY CENTRES                        | 2,840,000  | 5,822,000.00    |      |
|     | WAYPOINT REIT                           | 490,000    | 1,254,400.00    |      |
|     | 銘柄数：31                                  | 25,356,055 | 108,019,769.85  |      |
| 小計  |                                         |            |                 |      |

|                |                                        |            |                  |  |
|----------------|----------------------------------------|------------|------------------|--|
|                |                                        |            | (10,611,862,190) |  |
|                | 組入時価比率：6.7%                            |            | 6.8%             |  |
| ニュージーランド<br>ドル | ARGOSY PROPERTY LTD                    | 670,000    | 763,800.00       |  |
|                | GOODMAN PROPERTY TRUST                 | 740,000    | 1,591,000.00     |  |
|                | KIWI PROPERTY GROUP LTD                | 1,130,000  | 954,850.00       |  |
|                | PRECINCT PROPERTIES GROUP              | 960,000    | 1,171,200.00     |  |
| 小計             | 銘柄数：4                                  | 3,500,000  | 4,480,850.00     |  |
|                |                                        |            | (412,686,285)    |  |
|                | 組入時価比率：0.3%                            |            | 0.3%             |  |
| 香港ドル           | CHAMPION REIT                          | 1,400,000  | 2,464,000.00     |  |
|                | FORTUNE REIT                           | 1,060,000  | 4,759,400.00     |  |
|                | LINK REIT                              | 1,890,100  | 72,957,860.00    |  |
|                | PROSPERITY REIT                        | 840,000    | 1,058,400.00     |  |
|                | SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT        | 798,000    | 1,484,280.00     |  |
|                | YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST    | 1,589,700  | 1,716,876.00     |  |
|                | 銘柄数：6                                  | 7,577,800  | 84,440,816.00    |  |
| 小計             |                                        |            | (1,619,574,850)  |  |
|                | 組入時価比率：1.0%                            |            | 1.0%             |  |
| シンガポールドル       | AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD          | 540,000    | 691,200.00       |  |
|                | CAPITALAND ASCENDAS REIT               | 2,609,982  | 7,255,749.96     |  |
|                | CAPITALAND ASCOTT TRUST                | 1,780,044  | 1,655,440.92     |  |
|                | CAPITALAND CHINA TRUST                 | 880,012    | 677,609.24       |  |
|                | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 3,750,028  | 7,350,054.88     |  |
|                | CDL HOSPITALITY TRUSTS                 | 500,040    | 490,039.20       |  |
|                | EC WORLD REIT                          | 120,000    | 33,600.00        |  |
|                | ESR-LOGOS REIT                         | 4,499,989  | 1,439,996.48     |  |
|                | FAR EAST HOSPITALITY TRUST             | 740,000    | 481,000.00       |  |
|                | FRASERS CENTREPOINT TRUST              | 810,007    | 1,806,315.61     |  |
|                | FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST   | 2,159,990  | 2,419,188.80     |  |
|                | KEPPEL DC REIT                         | 979,983    | 1,734,569.91     |  |
|                | KEPPEL REIT                            | 1,670,000  | 1,494,650.00     |  |
|                | LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL            | 1,250,000  | 750,000.00       |  |
|                | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST             | 1,500,000  | 3,585,000.00     |  |
|                | MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | 2,419,991  | 3,750,986.05     |  |
|                | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST    | 1,680,024  | 2,368,833.84     |  |
|                | PARAGON REIT                           | 870,000    | 730,800.00       |  |
|                | PARKWAY LIFE REAL ESTATE               | 300,000    | 1,113,000.00     |  |
|                | SASSEUR REAL ESTATE INVESTME           | 360,000    | 243,000.00       |  |
|                | STARHILL GLOBAL REIT                   | 960,000    | 465,600.00       |  |
|                | SUNTEC REIT                            | 1,600,000  | 1,872,000.00     |  |
|                | 銘柄数：22                                 | 31,980,090 | 42,408,634.89    |  |
| 小計             |                                        |            | (4,730,259,135)  |  |

|    |       |                                |         |                   |  |
|----|-------|--------------------------------|---------|-------------------|--|
|    |       | 組入時価比率：3.0%                    |         | 3.0%              |  |
|    | ウォン   | D&D PLATFORM REIT CO LTD       | 44,000  | 145,640,000.00    |  |
|    |       | ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD | 122,000 | 473,360,000.00    |  |
|    |       | JR REIT XXVII                  | 116,000 | 470,960,000.00    |  |
|    |       | KORAMCO LIFE INFRA REIT        | 36,346  | 176,278,100.00    |  |
|    |       | LOTTE REIT CO LTD              | 83,000  | 261,035,000.00    |  |
|    |       | NH ALL-ONE REIT CO LTD         | 34,170  | 113,956,950.00    |  |
|    |       | SHINHAN ALPHA REIT CO LTD      | 53,214  | 348,019,560.00    |  |
|    |       | SK REITS CO LTD                | 83,248  | 318,423,600.00    |  |
|    | 小計    | 銘柄数：8                          | 571,978 | 2,307,673,210.00  |  |
|    |       |                                |         | (260,305,538)     |  |
|    |       | 組入時価比率：0.2%                    |         | 0.2%              |  |
|    | 新シェケル | MENIVIM-THE NEW REIT LTD       | 480,000 | 828,000.00        |  |
|    |       | REIT 1 LTD                     | 130,000 | 2,054,000.00      |  |
|    |       | SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD  | 160,000 | 1,272,000.00      |  |
|    | 小計    | 銘柄数：3                          | 770,000 | 4,154,000.00      |  |
|    |       |                                |         | (172,620,300)     |  |
|    |       | 組入時価比率：0.1%                    |         | 0.1%              |  |
| 合計 |       |                                |         | 156,507,920,181   |  |
|    |       |                                |         | (146,294,603,081) |  |

(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         | 2024年 2月19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         | 1,252,156,008 | —     | 1,224,334,042 | △27,827,576 |
| 市場取引以外の取引  |               |       |               |             |
| 為替予約取引     |               |       |               |             |
| 買建         | 472,575,600   | —     | 472,295,520   | △280,080    |
| 米ドル        | 450,405,000   | —     | 450,020,700   | △384,300    |
| カナダドル      | 22,170,600    | —     | 22,274,820    | 104,220     |
| 売建         | 15,027,000    | —     | 15,000,690    | 26,310      |
| 米ドル        | 15,027,000    | —     | 15,000,690    | 26,310      |
| 合計         | —             | —     | —             | △28,081,346 |

(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。

#### 外国先物取引について

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

### 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## のむラップ・ファンド（保守型）

2024年3月29日現在

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| I 資産総額              | 62,132,521,475円 |
| II 負債総額             | 176,597,216円    |
| III 純資産総額（I－II）     | 61,955,924,259円 |
| IV 発行済口数            | 36,109,311,438口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.7158円         |

## のむラップ・ファンド（やや保守型）

2024年3月29日現在

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| I 資産総額              | 10,959,660,302円 |
| II 負債総額             | 40,780,724円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 10,918,879,578円 |
| IV 発行済口数            | 7,416,640,580口  |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.4722円         |

## のむラップ・ファンド（普通型）

2024年3月29日現在

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| I 資産総額              | 372,581,335,514円 |
| II 負債総額             | 1,089,137,429円   |
| III 純資産総額（I－II）     | 371,492,198,085円 |
| IV 発行済口数            | 136,598,026,911口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 2.7196円          |

## のむラップ・ファンド（やや積極型）

2024年3月29日現在

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| I 資産総額              | 28,612,529,209円 |
| II 負債総額             | 67,679,073円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 28,544,850,136円 |
| IV 発行済口数            | 14,645,724,672口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.9490円         |

## のむラップ・ファンド（積極型）

2024年3月29日現在

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| I 資産総額              | 222,512,520,821円 |
| II 負債総額             | 658,920,326円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 221,853,600,495円 |
| IV 発行済口数            | 59,404,261,007口  |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 3.7346円          |

## （参考）国内株式マザーファンド

2024年3月29日現在

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| I 資産総額              | 770,302,403,785円 |
| II 負債総額             | 62,318,145,087円  |
| III 純資産総額（I－II）     | 707,984,258,698円 |
| IV 発行済口数            | 227,304,834,357口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 3.1147円          |

## （参考）国内債券NOMURA－BPI総合 マザーファンド

2024年3月29日現在

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| I 資産総額              | 1,153,030,446,794円 |
| II 負債総額             | 12,098,118,540円    |
| III 純資産総額（I－II）     | 1,140,932,328,254円 |
| IV 発行済口数            | 905,815,383,296口   |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 1.2596円            |

## （参考）外国株式MSCI－KOKUSAIマザーファンド

2024年3月29日現在

|                     |                    |
|---------------------|--------------------|
| I 資産総額              | 2,294,904,264,969円 |
| II 負債総額             | 7,194,815,103円     |
| III 純資産総額（I－II）     | 2,287,709,449,866円 |
| IV 発行済口数            | 338,566,374,879口   |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 6.7570円            |

## （参考）外国債券マザーファンド

2024年3月29日現在

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| I 資産総額              | 868,256,409,222円 |
| II 負債総額             | 1,569,404,272円   |
| III 純資産総額（I－II）     | 866,687,004,950円 |
| IV 発行済口数            | 294,889,459,681口 |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 2.9390円          |

## （参考）世界REITインデックス マザーファンド

2024年3月29日現在

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| I 資産総額              | 170,999,464,188円 |
| II 負債総額             | 1,367,602,909円   |
| III 純資産総額（I－II）     | 169,631,861,279円 |
| IV 発行済口数            | 60,963,005,127口  |
| V 1口当たり純資産額（III／IV） | 2.7825円          |

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1)受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。



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

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

## (2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3)受益権の譲渡

- ①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ③上記①の振替について、委託者は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めたときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## (4)受益権の譲渡の対抗要件

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

## (5)受益権の再分割

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

## (6)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額

2024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。

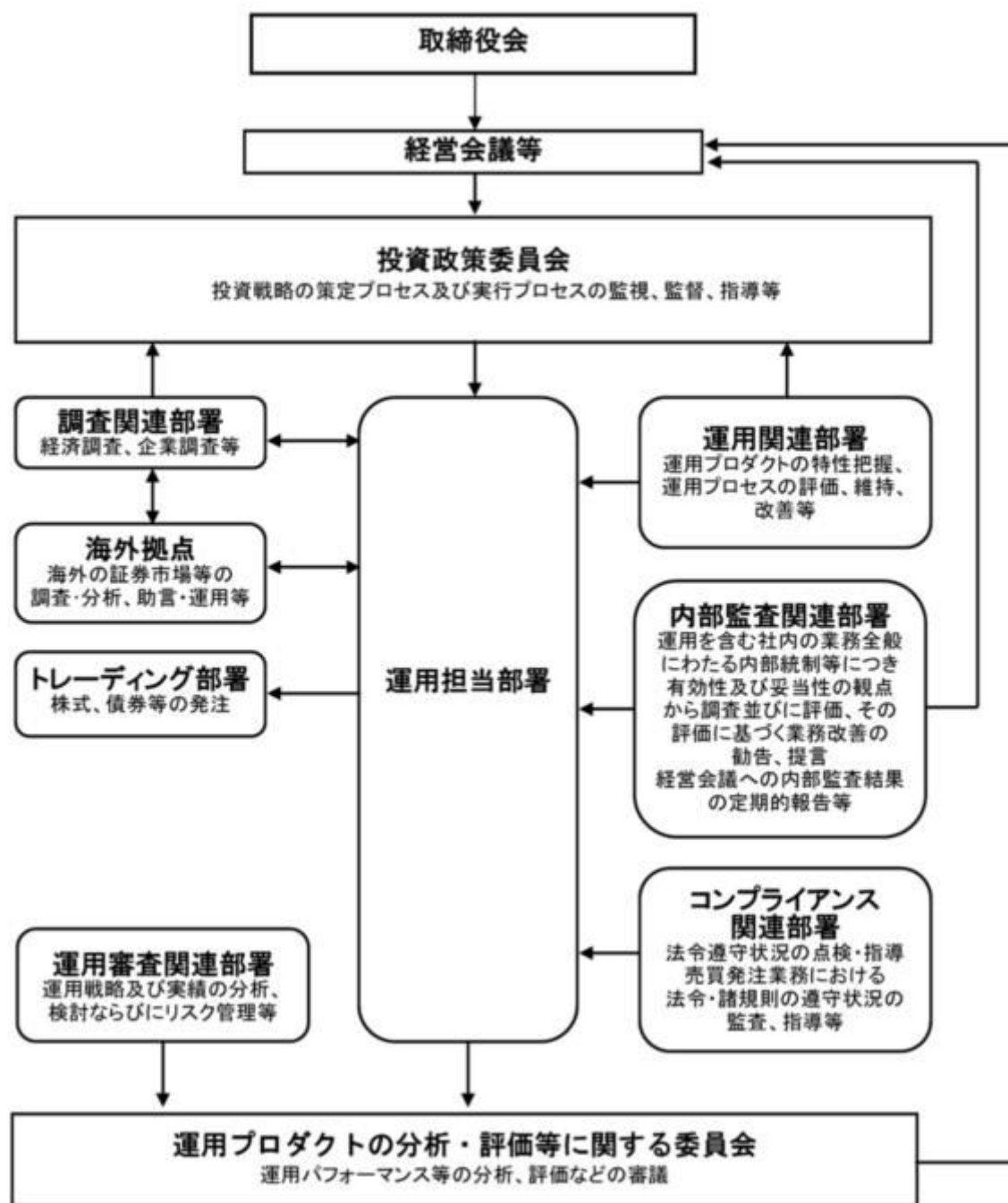
###### 代表取締役・業務執行取締役

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2024年2月29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 | 999 | 52,216,440 |

|            |       |            |
|------------|-------|------------|
| 単位型株式投資信託  | 175   | 644,663    |
| 追加型公社債投資信託 | 14    | 7,157,804  |
| 単位型公社債投資信託 | 457   | 907,593    |
| 合計         | 1,645 | 60,926,501 |

### 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(2022年4月1日から2023年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2023年4月1日から2023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>(2022年3月31日) | 当事業年度<br>(2023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    |          | 2,006                 | 1,865                 |
| 金銭の信託    |          | 35,894                | 42,108                |
| 有価証券     |          | 29,300                | 21,900                |
| 前払金      |          | 11                    | 11                    |
| 前払費用     |          | 454                   | 775                   |
| 未収入金     |          | 694                   | 1,775                 |
| 未収委託者報酬  |          | 27,176                | 26,116                |
| 未収運用受託報酬 |          | 4,002                 | 3,780                 |
| 短期貸付金    |          | 1,835                 | 1,001                 |
| 未収還付法人税等 |          | -                     | 2,083                 |
| その他      |          | 57                    | 84                    |
| 貸倒引当金    |          | △15                   | △15                   |
| 流動資産計    |          | 101,417               | 101,486               |
| 固定資産     |          |                       |                       |
| 有形固定資産   |          | 1,744                 | 1,335                 |
| 建物       | ※ 2      | 1,219                 | 906                   |

|          |     |       |         |        |         |
|----------|-----|-------|---------|--------|---------|
| 器具備品     | ※ 2 | 525   |         | 428    |         |
| 無形固定資産   |     |       | 5,210   |        | 5,563   |
| ソフトウェア   |     | 5,209 |         | 5,562  |         |
| その他      |     | 0     |         | 0      |         |
| 投資その他の資産 |     |       | 16,067  |        | 16,336  |
| 投資有価証券   |     | 2,201 |         | 1,793  |         |
| 関係会社株式   |     | 9,214 |         | 10,025 |         |
| 長期差入保証金  |     | 443   |         | 520    |         |
| 長期前払費用   |     | 13    |         | 10     |         |
| 前払年金費用   |     | 1,297 |         | 1,553  |         |
| 繰延税金資産   |     | 2,784 |         | 2,340  |         |
| その他      |     | 112   |         | 92     |         |
| 固定資産計    |     |       | 23,023  |        | 23,235  |
| 資産合計     |     |       | 124,440 |        | 124,722 |

|              |          | 前事業年度<br>(2022年3月31日) |        | 当事業年度<br>(2023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          |          |                       | 120    |                       | 124    |
| 未払金          |          |                       | 17,615 |                       | 17,879 |
| 未払収益分配金      |          | 0                     |        | 0                     |        |
| 未払償還金        |          | 17                    |        | 57                    |        |
| 未払手数料        |          | 8,357                 |        | 8,409                 |        |
| 関係会社未払金      |          | 8,149                 |        | 8,911                 |        |
| その他未払金       |          | 1,089                 |        | 500                   |        |
| 未払費用         | ※ 1      |                       | 9,512  |                       | 9,682  |
| 未払法人税等       |          |                       | 1,319  |                       | 1,024  |
| 前受収益         |          |                       | 22     |                       | 22     |
| 賞与引当金        |          |                       | 4,416  |                       | 3,635  |
| その他          |          |                       | 121    |                       | 46     |
| 流動負債計        |          |                       | 33,127 |                       | 32,414 |
| 固定負債         |          |                       |        |                       |        |
| 退職給付引当金      |          |                       | 3,194  |                       | 2,940  |
| 時効後支払損引当金    |          |                       | 588    |                       | 595    |
| 資産除去債務       |          |                       | 1,123  |                       | 1,123  |
| 固定負債計        |          |                       | 4,905  |                       | 4,659  |
| 負債合計         |          |                       | 38,033 |                       | 37,074 |
| (純資産の部)      |          |                       |        |                       |        |
| 株主資本         |          |                       | 86,232 |                       | 87,419 |
| 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        |          |                       | 55,322 |                       | 56,509 |
| 利益準備金        |          | 685                   |        | 685                   |        |
| その他利益剰余金     |          | 54,637                |        | 55,823                |        |
| 別途積立金        |          | 24,606                |        | 24,606                |        |
| 繰越利益剰余金      |          | 30,030                |        | 31,217                |        |
| 評価・換算差額等     |          |                       | 174    |                       | 229    |
| その他有価証券評価差額金 |          |                       | 174    |                       | 229    |

|          |  |  |         |  |         |
|----------|--|--|---------|--|---------|
| 純資産合計    |  |  | 86,407  |  | 87,648  |
| 負債・純資産合計 |  |  | 124,440 |  | 124,722 |

## (2) 【損益計算書】

|           |          | 前事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日) |         | 当事業年度<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023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     |          |                                        | 115,733 |                                        | 113,491 |
| 運用受託報酬    |          |                                        | 17,671  |                                        | 18,198  |
| その他営業収益   |          |                                        | 530     |                                        | 331     |
| 営業収益計     |          |                                        | 133,935 |                                        | 132,021 |
| 営業費用      |          |                                        |         |                                        |         |
| 支払手数料     |          |                                        | 39,087  |                                        | 38,684  |
| 広告宣伝費     |          |                                        | 804     |                                        | 1,187   |
| 公告費       |          |                                        | 0       |                                        | 0       |
| 調査費       |          |                                        | 26,650  |                                        | 29,050  |
| 調査費       |          | 4,867                                  |         | 6,045                                  |         |
| 委託調査費     |          | 21,783                                 |         | 23,004                                 |         |
| 委託計算費     |          |                                        | 1,384   |                                        | 1,363   |
| 営業雑経費     |          |                                        | 3,094   |                                        | 3,302   |
| 通信費       |          | 72                                     |         | 89                                     |         |
| 印刷費       |          | 918                                    |         | 903                                    |         |
| 協会費       |          | 79                                     |         | 83                                     |         |
| 諸経費       |          | 2,023                                  |         | 2,225                                  |         |
| 営業費用計     |          |                                        | 71,021  |                                        | 73,587  |
| 一般管理費     |          |                                        |         |                                        |         |
| 給料        |          |                                        | 12,033  |                                        | 11,316  |
| 役員報酬      |          | 229                                    |         | 226                                    |         |
| 給料・手当     |          | 7,375                                  |         | 7,752                                  |         |
| 賞与        |          | 4,427                                  |         | 3,337                                  |         |
| 交際費       |          |                                        | 47      |                                        | 78      |
| 寄付金       |          |                                        | 73      |                                        | 115     |
| 旅費交通費     |          |                                        | 65      |                                        | 283     |
| 租税公課      |          |                                        | 1,049   |                                        | 963     |
| 不動産賃借料    |          |                                        | 1,432   |                                        | 1,232   |
| 退職給付費用    |          |                                        | 1,212   |                                        | 829     |
| 固定資産減価償却費 |          |                                        | 2,525   |                                        | 2,409   |
| 諸経費       |          |                                        | 11,116  |                                        | 12,439  |
| 一般管理費計    |          |                                        | 29,556  |                                        | 29,669  |
| 営業利益      |          |                                        | 33,357  |                                        | 28,763  |

|  |  | 前事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日) |  | 当事業年度<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023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        | ※ 1      |         |        |         |        |
| 受取配当金        |          | 3,530   |        | 7,645   |        |
| 受取利息         |          | 10      |        | 45      |        |
| 為替差益         |          | -       |        | 49      |        |
| その他          |          | 1,268   |        | 637     |        |
| 営業外収益計       |          |         | 4,809  |         | 8,377  |
| 営業外費用        |          |         |        |         |        |
| 金銭の信託運用損     |          | 1,387   |        | 1,736   |        |
| 時効後支払損引当金繰入額 |          | 12      |        | 10      |        |
| 為替差損         |          | 23      |        | -       |        |
| その他          |          | 266     |        | 8       |        |
| 営業外費用計       |          |         | 1,689  |         | 1,755  |
| 経常利益         |          |         | 36,477 |         | 35,385 |
| 特別利益         |          |         |        |         |        |
| 投資有価証券等売却益   |          | 26      |        | 10      |        |
| 株式報酬受入益      |          | 53      |        | 46      |        |
| 固定資産売却益      |          | 9       |        | -       |        |
| 資産除去債務履行差額   |          | 141     |        | -       |        |
| 特別利益計        |          |         | 230    |         | 57     |
| 特別損失         |          |         |        |         |        |
| 投資有価証券等売却損   | ※ 2      | 0       |        | 16      |        |
| 関係会社株式評価損    |          | 727     |        | -       |        |
| 固定資産除却損      |          | 374     |        | 52      |        |
| 資産除去債務履行差額   |          | 0       |        | -       |        |
| 事務所移転費用      |          | 54      |        | -       |        |
| 特別損失計        |          |         | 1,158  |         | 69     |
| 税引前当期純利益     |          |         | 35,549 |         | 35,374 |
| 法人税、住民税及び事業税 |          |         | 10,474 |         | 8,890  |
| 法人税等調整額      |          |         | 171    |         | 419    |
| 当期純利益        |          |         | 24,904 |         | 26,064 |

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位：百万円)

|        | 株主資本   |            |                   |                   |            |            |                   |                   | 株 主<br>資 本<br>合 計 |
|--------|--------|------------|-------------------|-------------------|------------|------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|        | 資本金    | 資本剰余金      |                   |                   | 利益剰余金      |            |                   | 利 益<br>剰余金<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   |                   |                   |                   |
|        |        |            |                   |                   |            | 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 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） |        |        |       |        |     |        |        |        |        |
| 当期変動額合計             | —      | —      | —     | —      | —   | —      | △1,364 | △1,364 | △1,364 |
| 当期末残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 30,030 | 55,322 | 86,232 |

(単位：百万円)

|                     | 評価・換算差額等     |            | 純資産合計   |
|---------------------|--------------|------------|---------|
|                     | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 |         |
| 当期首残高               | 57           | 57         | 87,654  |
| 当期変動額               |              |            |         |
| 剰余金の配当              |              |            | △26,268 |
| 当期純利益               |              |            | 24,904  |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） | 116          | 116        | 116     |
| 当期変動額合計             | 116          | 116        | △1,247  |
| 当期末残高               | 174          | 174        | 86,407  |

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

(単位：百万円)

|                     | 株主資本   |        |          |         |       |          |         |         | 株主資本合計  |
|---------------------|--------|--------|----------|---------|-------|----------|---------|---------|---------|
|                     | 資本金    | 資本剰余金  |          |         | 利益剰余金 |          |         |         |         |
|                     |        | 資本準備金  | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 |         | 利益剰余金合計 |         |
|                     |        |        |          |         |       | 別途積立金    | 繰越利益剰余金 |         |         |
| 当期首残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 30,030  | 55,322  | 86,232  |
| 当期変動額               |        |        |          |         |       |          |         |         |         |
| 剰余金の配当              |        |        |          |         |       |          | △24,877 | △24,877 | △24,877 |
| 当期純利益               |        |        |          |         |       |          | 26,064  | 26,064  | 26,064  |
| 株主資本以外の項目の当期変動額（純額） |        |        |          |         |       |          |         |         |         |
| 当期変動額合計             | —      | —      | —        | —       | —     | —        | 1,186   | 1,186   | 1,186   |
| 当期末残高               | 17,180 | 11,729 | 2,000    | 13,729  | 685   | 24,606   | 31,217  | 56,509  | 87,419  |

(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                   | 174              | 174            | 86,407  |
| 当期変動額                   |                  |                |         |
| 剰余金の配当                  |                  |                | △24,877 |
| 当期純利益                   |                  |                | 26,064  |
| 株主資本以外の項目の<br>当期変動額（純額） | 54               | 54             | 54      |
| 当期変動額合計                 | 54               | 54             | 1,240   |
| 当期末残高                   | 229              | 229            | 87,648  |

## [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 (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)<br/> 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、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。<br/> 主な耐用年数は以下の通りであります。<br/> 建物 6年<br/> 附属設備 6～15年<br/> 器具備品 4～15年</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> |
| 6. 引当金の計上基準              | <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>7. 収益及び費用の計上基準</p> | <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>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。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>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。</p> <p>② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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>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>① 委託者報酬</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>② 運用受託報酬</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>③ 成功報酬</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> |
|-----------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## [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]

## （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。）を当事業年度の期首から適用し、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。

これにより、「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。

なお、「金融商品関係」注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27－3項に従って、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]

該当事項はありません。

## [注記事項]

## ◇ 貸借対照表関係

| 前事業年度末<br>(2022年3月31日)                                                        | 当事業年度末<br>(2023年3月31日)                                                        |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------|
| ※ 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。<br>未払費用 1,223百万円 | ※ 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。<br>未払費用 1,350百万円 |
| ※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額<br>建物 589百万円<br>器具備品 618<br>合計 1,207                 | ※ 2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額<br>建物 901百万円<br>器具備品 657<br>合計 1,559                 |

## ◇ 損益計算書関係

| 前事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日)                                  | 当事業年度<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023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 3,525百万円 | ※ 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 7,634百万円 |
| ※ 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              | ※ 2. 固定資産除却損<br>建物 0百万円<br>器具備品 0<br>ソフトウェア 52<br>合計 52                 |

## ◇ 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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 |

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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

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 |

### （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

2023年5月23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   | 55,782百万円  |
| 配当の原資    | 利益剰余金      |
| 1株当たり配当額 | 10,830円    |
| 基準日      | 2023年3月31日 |
| 効力発生日    | 2023年6月30日 |

## ◇ 金融商品関係

前事業年度（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。

|                   | 前事業年度（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、前事業年度において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）<br>（※） | -                | 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）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）で構成されています。

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。

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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

2023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         | 42,108       | 42,108 | -  |
| 資産計              | 42,108       | 42,108 | -  |
| (2)その他（デリバティブ取引） | 46           | 46     | -  |
| 負債計              | 46           | 46     | -  |

(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（※） | 10,261     |
| 組合出資金等        | 1,557      |
| 合計            | 11,819     |

(※) 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。

(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           | 1,865  | -           | -            | -    |
| 金銭の信託        | 42,108 | -           | -            | -    |
| 未収委託者報酬      | 26,116 | -           | -            | -    |
| 未収運用受託報酬     | 3,780  | -           | -            | -    |
| 有価証券及び投資有価証券 |        |             |              |      |
| その他有価証券      | 21,900 | -           | -            | -    |
| 短期貸付金        | 1,001  |             |              |      |
| 合計           | 96,772 | -           | -            | -    |

## 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） | -                | 42,108 | -    | 42,108 |
| 資産計             | -                | 42,108 | -    | 42,108 |
| デリバティブ取引（通貨関連）  | -                | 46     | -    | 46     |
| 負債計             | -                | 46     | -    | 46     |

（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

前事業年度（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     | 前事業年度<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。

#### 当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

##### 1. 売買目的有価証券(2023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(2023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(2023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  | 9,919          |
| 関連会社株式 | 106            |

##### 4. その他有価証券(2023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                | 21,900                | 21,900        | -           |
| 小計                   | 21,900                | 21,900        | -           |
| 合計                   | 21,900                | 21,900        | -           |

※市場価格のない株式等（貸借対照表計上額235百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額1,557百万円）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 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

| 区分 | 売却額(百万円) | 売却益の合計額(百万円) | 売却損の合計額(百万円) |
|----|----------|--------------|--------------|
| 株式 | 66       | -            | 16           |
| 合計 | 66       | -            | 16           |

## ◇ 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 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          |

当事業年度（自 2022年4月1日 至 2023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 | 952           | -                       | △46         | △46           |

## ◇ 退職給付関係

| 前事業年度(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<br>当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。 |            |
| 2. 確定給付制度                                                                                 |            |
| (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表                                                                  |            |
| 退職給付債務の期首残高                                                                               | 23,270 百万円 |
| 勤務費用                                                                                      | 961        |
| 利息費用                                                                                      | 176        |
| 数理計算上の差異の発生額                                                                              | △1,521     |
| 退職給付の支払額                                                                                  | △904       |
| その他                                                                                       | △14        |
| 退職給付債務の期末残高                                                                               | 21,967     |

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

|              |            |
|--------------|------------|
| 年金資産の期首残高    | 19,349 百万円 |
| 期待運用収益       | 454        |
| 数理計算上の差異の発生額 | △258       |
| 事業主からの拠出額    | 814        |
| 退職給付の支払額     | △672       |
| 年金資産の期末残高    | 19,687     |

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

|                      |            |
|----------------------|------------|
| 積立型制度の退職給付債務         | 18,807 百万円 |
| 年金資産                 | △19,687    |
|                      | △879       |
| 非積立型制度の退職給付債務        | 3,159      |
| 未積立退職給付債務            | 2,279      |
| 未認識数理計算上の差異          | △489       |
| 未認識過去勤務費用            | 106        |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 1,896      |
| 退職給付引当金              | 3,194      |
| 前払年金費用               | △1,297     |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 1,896      |

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                 |         |
|-----------------|---------|
| 勤務費用            | 961 百万円 |
| 利息費用            | 176     |
| 期待運用収益          | △454    |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 322     |
| 過去勤務費用の費用処理額    | △45     |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 959     |

## (5) 年金資産に関する事項

## ①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

|        |      |
|--------|------|
| 債券     | 51%  |
| 株式     | 32%  |
| 生保一般勘定 | 10%  |
| 生保特別勘定 | 6%   |
| その他    | 1%   |
| 合計     | 100% |

## ②長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

|                 |       |
|-----------------|-------|
| 確定給付型企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       | 2.35% |

## 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。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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  | 21,967 百万円 |
| 勤務費用         | 853        |
| 利息費用         | 188        |
| 数理計算上の差異の発生額 | △1,476     |
| 退職給付の支払額     | △1,133     |
| その他          | △83        |
| 退職給付債務の期末残高  | 20,314     |

## (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    | 19,687 百万円 |
| 期待運用収益       | 462        |
| 数理計算上の差異の発生額 | △716       |
| 事業主からの拠出額    | 819        |
| 退職給付の支払額     | △874       |
| 年金資産の期末残高    | 19,378     |

## (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         | 17,386 百万円 |
| 年金資産                 | △19,378    |
|                      | △1,991     |
| 非積立型制度の退職給付債務        | 2,927      |
| 未積立退職給付債務            | 935        |
| 未認識数理計算上の差異          | 398        |
| 未認識過去勤務費用            | 53         |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 1,387      |
| 退職給付引当金              | 2,940      |
| 前払年金費用               | △1,553     |
| 貸借対照表上に計上された負債と資産の純額 | 1,387      |

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

|                 |         |
|-----------------|---------|
| 勤務費用            | 853 百万円 |
| 利息費用            | 188     |
| 期待運用収益          | △462    |
| 数理計算上の差異の費用処理額  | 127     |
| 過去勤務費用の費用処理額    | △52     |
| 確定給付制度に係る退職給付費用 | 653     |

## (5) 年金資産に関する事項

## ①年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

|        |      |
|--------|------|
| 債券     | 34%  |
| 株式     | 27%  |
| 生保一般勘定 | 11%  |
| 生保特別勘定 | 7%   |
| その他    | 21%  |
| 合計     | 100% |

## ②長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

|                             |       |
|-----------------------------|-------|
| (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項        |       |
| 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎     |       |
| 確定給付型企业年金制度の割引率             | 1.4%  |
| 退職一時金制度の割引率                 | 1.1%  |
| 長期期待運用収益率                   | 2.35% |
| 3. 確定拠出制度                   |       |
| 当社の確定拠出制度への要拠出額は、202百万円でした。 |       |

## ◇ 税効果会計関係

## 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

| 前事業年度末<br>(2022年3月31日)                         |        | 当事業年度末<br>(2023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                                          | 1,381  | 賞与引当金                                          | 1,138  |
| 退職給付引当金                                        | 990    | 退職給付引当金                                        | 911    |
| 関係会社株式評価減                                      | 1,010  | 関係会社株式評価減                                      | 1,010  |
| 未払事業税                                          | 285    | 未払事業税                                          | 227    |
| 投資有価証券評価減                                      | 110    | 投資有価証券評価減                                      | 11     |
| 減価償却超過額                                        | 272    | 減価償却超過額                                        | 331    |
| 時効後支払損引当金                                      | 182    | 時効後支払損引当金                                      | 184    |
| 関係会社株式売却損                                      | 505    | 関係会社株式売却損                                      | 505    |
| ゴルフ会員権評価減                                      | 92     | ゴルフ会員権評価減                                      | 78     |
| 資産除去債務                                         | 348    | 資産除去債務                                         | 348    |
| 未払社会保険料                                        | 114    | 未払社会保険料                                        | 85     |
| その他                                            | 84     | その他                                            | 44     |
| 繰延税金資産小計                                       | 5,376  | 繰延税金資産小計                                       | 4,878  |
| 評価性引当額                                         | △1,795 | 評価性引当額                                         | △1,696 |
| 繰延税金資産合計                                       | 3,581  | 繰延税金資産合計                                       | 3,181  |
| 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                                | △233   | 資産除去債務に対応する除去費用                                | △171   |
| 関係会社株式評価益                                      | △81    | 関係会社株式評価益                                      | △84    |
| その他有価証券評価差額金                                   | △78    | その他有価証券評価差額金                                   | △102   |
| 前払年金費用                                         | △402   | 前払年金費用                                         | △481   |
| 繰延税金負債合計                                       | △796   | 繰延税金負債合計                                       | △840   |
| 繰延税金資産の純額                                      | 2,784  | 繰延税金資産の純額                                      | 2,340  |
| 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                             | 0.3%   |
| 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                           | △2.9%  | 受取配当金等永久に益金に算入されない項目                           | △6.4%  |
| タックスヘイブン税制                                     | 1.8%   | タックスヘイブン税制                                     | 2.1%   |
| 外国税額控除                                         | △0.5%  | 外国税額控除                                         | △0.6%  |
| 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税                           | 0.4%   | 外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税                           | 0.7%   |
| その他                                            | 0.1%   | その他                                            | △0.8%  |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率                              | 29.9%  | 税効果会計適用後の法人税等の負担率                              | 26.3%  |

## 2. 法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、当事業年度から、グループ通算制度を適用しております。また、「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）に従って、法人税及び地方人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

#### ◇ 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 2021年4月 1日<br>至 2022年3月31日 | 自 2022年4月 1日<br>至 2023年3月31日 |
| 期首残高           | 1,371                        | 1,123                        |
| 有形固定資産の取得に伴う増加 | 48                           | -                            |
| 資産除去債務の履行による減少 | △296                         | -                            |
| 期末残高           | 1,123                        | 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

前事業年度（自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日）

| 区分      | 前事業年度<br>(自 2021年4月 1日<br>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。

当事業年度（自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日）

| 区分      | 当事業年度<br>(自 2022年4月 1日<br>至 2023年3月31日) |
|---------|-----------------------------------------|
| 委託者報酬   | 113,491百万円                              |
| 運用受託報酬  | 17,245百万円                               |
| 成功報酬（注） | 952百万円                                  |
| その他営業収益 | 331百万円                                  |
| 合計      | 132,021百万円                              |

（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 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

① 売上高

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

② 有形固定資産

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



## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ◇ 関連当事者情報

前事業年度(自 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<br>ム・ファイ<br>ナンス・イン<br>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 | 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(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2022年4月1日 至 2023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<br>ム・ファイ<br>ナンス・イン<br>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 | 5,736         | 短期貸付金 | 1,001         |
|     |                                |      |                |       |                    |           | 資金の返済 | 6,489         |       |               |
|     |                                |      |                |       |                    |           | 貸付金利息 | 44            | 未収利息  | 11            |

### (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) | 27,180        | 未払手数料 | 5,773         |

### (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

野村ホールディングス(株)（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## ◇ 1株当たり情報

| 前事業年度<br>(自 2021年4月1日<br>至 2022年3月31日)        |            | 当事業年度<br>(自 2022年4月1日<br>至 2023年3月31日)        |            |
|-----------------------------------------------|------------|-----------------------------------------------|------------|
| 1株当たり純資産額                                     | 16,775円81銭 | 1株当たり純資産額                                     | 17,016円74銭 |
| 1株当たり当期純利益                                    | 4,835円10銭  | 1株当たり当期純利益                                    | 5,060円34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                                  | 24,904百万円  | 損益計算書上の当期純利益                                  | 26,064百万円  |
| 普通株式に係る当期純利益                                  | 24,904百万円  | 普通株式に係る当期純利益                                  | 26,064百万円  |
| 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳<br>該当事項はありません。             |            | 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳<br>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

|          |          | 2023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    |          | 7,755        |
| 金銭の信託    |          | 42,741       |
| 未収委託者報酬  |          | 28,981       |
| 未収運用受託報酬 |          | 5,565        |
| 短期貸付金    |          | 747          |
| その他      |          | 1,398        |
| 貸倒引当金    |          | △17          |
| 流動資産計    |          | 87,173       |
| 固定資産     |          |              |
| 有形固定資産   | ※ 1      | 1,140        |
| 無形固定資産   |          | 5,519        |
| ソフトウェア   |          | 5,518        |
| その他      |          | 0            |
| 投資その他の資産 |          | 16,784       |
| 投資有価証券   |          | 1,862        |
| 関係会社株式   |          | 10,025       |
| 長期差入保証金  |          | 519          |
| 前払年金費用   |          | 1,721        |
| 繰延税金資産   |          | 1,761        |
| その他      |          | 893          |
| 固定資産計    |          | 23,444       |
| 資産合計     |          | 110,617      |

|         |          | 2023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    |          |              |
| 短期借入金   |          | 29,900       |
| 未払金     |          | 12,829       |
| 未払収益分配金 |          | 1            |
| 未払償還金   |          | 40           |
| 未払手数料   |          | 9,305        |

|              |     |         |
|--------------|-----|---------|
| 関係会社未払金      |     | 2,395   |
| その他未払金       | ※ 2 | 1,085   |
| 未払費用         |     | 10,122  |
| 未払法人税等       |     | 2,521   |
| 賞与引当金        |     | 1,993   |
| その他          |     | 201     |
| 流動負債計        |     | 57,568  |
| 固定負債         |     |         |
| 退職給付引当金      |     | 2,855   |
| 時効後支払損引当金    |     | 601     |
| 資産除去債務       |     | 1,123   |
| 固定負債計        |     | 4,579   |
| 負債合計         |     | 62,148  |
| (純資産の部)      |     |         |
| 株主資本         |     | 48,142  |
| 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        |     | 17,232  |
| 利益準備金        |     | 685     |
| その他利益剰余金     |     | 16,547  |
| 繰越利益剰余金      |     | 16,547  |
| 評価・換算差額等     |     | 325     |
| その他有価証券評価差額金 |     | 325     |
| 純資産合計        |     | 48,468  |
| 負債・純資産合計     |     | 110,617 |

## ◇ 中間損益計算書

|         |          | 自 2023年4月 1日<br>至 2023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   |          | 59,892                       |
| 運用受託報酬  |          | 10,062                       |
| その他営業収益 |          | 156                          |
| 営業収益計   |          | 70,111                       |
| 営業費用    |          |                              |
| 支払手数料   |          | 20,743                       |
| 調査費     |          | 15,670                       |
| その他営業費用 |          | 2,845                        |
| 営業費用計   |          | 39,259                       |
| 一般管理費   | ※ 1      | 15,475                       |
| 営業利益    |          | 15,376                       |
| 営業外収益   | ※ 2      | 7,161                        |
| 営業外費用   | ※ 3      | 715                          |
| 経常利益    |          | 21,822                       |

|              |     |        |
|--------------|-----|--------|
| 特別利益         | ※ 4 | 11     |
| 特別損失         | ※ 5 | 10     |
| 税引前中間純利益     |     | 21,823 |
| 法人税、住民税及び事業税 |     | 4,781  |
| 法人税等調整額      |     | 536    |
| 中間純利益        |     | 16,505 |

## ◇ 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

(単位：百万円)

|                               | 株主資本   |            |                   |                   |            |            |                   |                   | 株 主<br>資 本<br>合 計 |
|-------------------------------|--------|------------|-------------------|-------------------|------------|------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|                               | 資本金    | 資本剰余金      |                   |                   | 利益剰余金      |            |                   |                   |                   |
|                               |        | 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     | 31,217            | 56,509            | 87,419            |
| 当中間期変動額                       |        |            |                   |                   |            |            |                   |                   |                   |
| 剰余金の配当                        |        |            |                   |                   |            |            | △55,782           | △55,782           | △55,782           |
| 中間純利益                         |        |            |                   |                   |            |            | 16,505            | 16,505            | 16,505            |
| 別途積立金の取崩                      |        |            |                   |                   |            | △24,606    | 24,606            | —                 | —                 |
| 株主資本以外の<br>項目の当中間期<br>変動額（純額） |        |            |                   |                   |            |            |                   |                   |                   |
| 当中間期変動額<br>合計                 | —      | —          | —                 | —                 | —          | △24,606    | △14,669           | △39,276           | △39,276           |
| 当中間期末残高                       | 17,180 | 11,729     | 2,000             | 13,729            | 685        | —          | 16,547            | 17,232            | 48,142            |

(単位：百万円)

|          | 評価・換算差額等         |                | 純資産合計   |
|----------|------------------|----------------|---------|
|          | その他有価証<br>券評価差額金 | 評価・換算<br>差額等合計 |         |
| 当期首残高    | 229              | 229            | 87,648  |
| 当中間期変動額  |                  |                |         |
| 剰余金の配当   |                  |                | △55,782 |
| 中間純利益    |                  |                | 16,505  |
| 別途積立金の取崩 |                  |                | —       |

|                               |     |     |         |
|-------------------------------|-----|-----|---------|
| 株主資本以外の項目の<br>当中間期変動額（純<br>額） | 96  | 96  | 96      |
| 当中間期変動額合計                     | 96  | 96  | △39,179 |
| 当中間期末残高                       | 325 | 325 | 48,468  |

## [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)</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          | <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。<br/>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> <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> | 建物 | 6年 | 附属設備 | 6～15年 | 器具備品 | 4～15年 |
| 建物                       | 6年                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |    |      |       |      |       |
| 附属設備                     | 6～15年                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |    |      |       |      |       |
| 器具備品                     | 4～15年                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |    |      |       |      |       |
| 6. 引当金の計上基準              | <p>(1) 貸倒引当金<br/>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。</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。</p>                                                                                                                                                                                                      |    |    |      |       |      |       |

|                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>7. 収益及び費用の計上基準</p> | <p>(3) 退職給付引当金</p> <p>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、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。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>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。</p> <p>② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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>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>① 委託者報酬</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>② 運用受託報酬</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>③ 成功報酬</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> |
|-----------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## [注記事項]

### ◇ 中間貸借対照表関係

| 2023年9月30日現在                                                  |          |
|---------------------------------------------------------------|----------|
| ※1 有形固定資産の減価償却累計額                                             | 1,754百万円 |
| ※2 消費税等の取扱い                                                   |          |
| 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。 |          |

## ◇ 中間損益計算書関係

|     |               | 自 2023年4月 1日<br>至 2023年9月30日 |
|-----|---------------|------------------------------|
| ※ 1 | 減価償却実施額       |                              |
|     | 有形固定資産        | 196百万円                       |
|     | 無形固定資産        | 958百万円                       |
| ※ 2 | 営業外収益のうち主要なもの |                              |
|     | 受取配当金         | 6,692百万円                     |
| ※ 3 | 営業外費用のうち主要なもの |                              |
|     | 金銭の信託運用損      | 627百万円                       |
| ※ 4 | 特別利益の内訳       |                              |
|     | 株式報酬受入益       | 11百万円                        |
| ※ 5 | 特別損失の内訳       |                              |
|     | 固定資産除却損       | 10百万円                        |

## ◇ 中間株主資本等変動計算書関係

|       |                                                                                                                                                                               |                              |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|-------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------|---------|------------|----|----------|------|------------|---|---|------------|--|
|       |                                                                                                                                                                               | 自 2023年4月 1日<br>至 2023年9月30日 |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
| 1     | 発行済株式に関する事項                                                                                                                                                                   |                              |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|       | <table><tr><td>株式の種類</td><td>当事業年度期首</td><td>増加</td><td>減少</td><td>当中間会計期間末</td></tr><tr><td>普通株式</td><td>5,150,693株</td><td>－</td><td>－</td><td>5,150,693株</td></tr></table> | 株式の種類                        | 当事業年度期首 | 増加         | 減少 | 当中間会計期間末 | 普通株式 | 5,150,693株 | － | － | 5,150,693株 |  |
| 株式の種類 | 当事業年度期首                                                                                                                                                                       | 増加                           | 減少      | 当中間会計期間末   |    |          |      |            |   |   |            |  |
| 普通株式  | 5,150,693株                                                                                                                                                                    | －                            | －       | 5,150,693株 |    |          |      |            |   |   |            |  |
| 2     | 配当に関する事項                                                                                                                                                                      |                              |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|       | 配当金支払額                                                                                                                                                                        |                              |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|       | 2023年5月23日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。                                                                                                                                          |                              |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|       | ・ 普通株式の配当に関する事項                                                                                                                                                               |                              |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|       | (1) 配当金の総額                                                                                                                                                                    | 55,782百万円                    |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|       | (2) 1株当たり配当額                                                                                                                                                                  | 10,830円                      |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|       | (3) 基準日                                                                                                                                                                       | 2023年3月31日                   |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |
|       | (4) 効力発生日                                                                                                                                                                     | 2023年6月30日                   |         |            |    |          |      |            |   |   |            |  |

## ◇ 金融商品関係

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

2023年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

|                  | 中間貸借対照表<br>計上額 | 時価     | 差額 |
|------------------|----------------|--------|----|
| (1)金銭の信託         | 42,741         | 42,741 | -  |
| 資産計              | 42,741         | 42,741 | -  |
| (2)その他（デリバティブ取引） | 60             | 60     | -  |
| 負債計              | 60             | 60     | -  |

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、短期貸付金、短期借入金、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。



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（※） | 10,266              |
| 組合出資金等        | 1,621               |
| 合計            | 11,888              |

（※）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。

### 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） | -                  | 42,741 | -    | 42,741 |
| 資産計             | -                  | 42,741 | -    | 42,741 |
| デリバティブ取引（通貨関連）  | -                  | 60     | -    | 60     |
| 負債計             | -                  | 60     | -    | 60     |

（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（2023年9月30日）

##### 1. 売買目的有価証券(2023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(2023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(2023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(2023年9月30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

当中間会計期間（2023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 | 684           | -                       | △60         | △60           |

#### ◇ 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 2023年4月 1日<br>至 2023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2023年4月 1日<br>至2023年9月30日) |
|---------|-----------------------------------------|
| 委託者報酬   | 59,884百万円                               |
| 運用受託報酬  | 9,422百万円                                |
| 成功報酬（注） | 646百万円                                  |
| その他営業収益 | 156百万円                                  |
| 合計      | 70,111百万円                               |

（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 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## ① 営業収益

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

## ② 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先が識別されていないため、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 2023年4月 1日<br>至 2023年9月30日                         |           |
|------------------------------------------------------|-----------|
| 1株当たり純資産額                                            | 9,410円05銭 |
| 1株当たり中間純利益                                           | 3,204円61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                                                | 16,505百万円 |
| 普通株主に帰属しない金額                                         | —         |
| 普通株式に係る中間純利益                                         | 16,505百万円 |
| 期中平均株式数                                              | 5,150千株   |

## 4 【利害関係人との取引制限】

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

- ①自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。
- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。 )。
- ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委

託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

④委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

⑤上記③④に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

## 5【その他】

### (1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2)訴訟事件その他の重要事項

委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

| (a)名称      | (b)資本金の額 <sup>*</sup> | (c)事業の内容                                                   |
|------------|-----------------------|------------------------------------------------------------|
| 野村信託銀行株式会社 | 50,000百万円             | 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。 |

＊ 2024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。 |
| 岩井コスモ証券株式会社 <sup>※1</sup> | 13,500百万円             |                                 |
| a u カブコム証券株式会社            | 7,196百万円              |                                 |
| S M B C 日興証券株式会社          | 135,000百万円            |                                 |
| 株式会社 S B I 証券             | 54,323百万円             |                                 |
| O K B 証券株式会社              | 1,500百万円              |                                 |
| 九州 F G 証券株式会社             | 3,000百万円              |                                 |
| 四国アライアンス証券株式会社            | 3,000百万円              |                                 |
| 七十七証券株式会社                 | 3,000百万円              |                                 |
| ちばぎん証券株式会社                | 4,374百万円              |                                 |
| 東海東京証券株式会社                | 6,000百万円              |                                 |
| とうほう証券株式会社                | 3,000百万円              |                                 |
| 南都まほろば証券株式会社              | 3,000百万円              |                                 |

|                   |            |                    |
|-------------------|------------|--------------------|
| 八十二証券株式会社         | 3,000百万円   |                    |
| 百五証券株式会社          | 3,000百万円   |                    |
| ひろぎん証券株式会社        | 5,000百万円   |                    |
| P a y P a y証券株式会社 | 15,224百万円  |                    |
| 松井証券株式会社          | 11,945百万円  |                    |
| マネックス証券株式会社       | 12,200百万円  |                    |
| めぶき証券株式会社         | 3,000百万円   |                    |
| 楽天証券株式会社          | 19,495百万円  |                    |
| リテラ・クレア証券株式会社     | 3,794百万円   |                    |
| 株式会社愛知銀行          | 18,000百万円  |                    |
| 株式会社青森銀行          | 19,562百万円  |                    |
| 株式会社足利銀行          | 135,000百万円 |                    |
| 株式会社池田泉州銀行        | 61,385百万円  |                    |
| 株式会社伊予銀行          | 20,948百万円  |                    |
| 株式会社岩手銀行          | 12,089百万円  |                    |
| 株式会社大垣共立銀行        | 46,773百万円  |                    |
| 株式会社関西みらい銀行       | 38,971百万円  |                    |
| 株式会社北日本銀行         | 7,761百万円   |                    |
| 株式会社紀陽銀行          | 80,096百万円  |                    |
| 株式会社高知銀行          | 22,944百万円  |                    |
| 株式会社佐賀共栄銀行        | 2,679百万円   | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社佐賀銀行          | 16,062百万円  |                    |
| 株式会社滋賀銀行          | 33,076百万円  |                    |
| 株式会社七十七銀行         | 24,658百万円  |                    |
| 株式会社清水銀行          | 10,816百万円  |                    |
| 株式会社荘内銀行          | 8,500百万円   |                    |
| 株式会社大光銀行          | 10,000百万円  |                    |
| 株式会社但馬銀行          | 5,481百万円   |                    |
| 株式会社筑邦銀行          | 8,000百万円   |                    |
| 株式会社中京銀行          | 31,879百万円  |                    |
| 株式会社筑波銀行          | 48,868百万円  |                    |
| 株式会社東邦銀行          | 23,519百万円  |                    |
| 株式会社東北銀行          | 13,233百万円  |                    |
| 株式会社東和銀行          | 38,653百万円  |                    |
| 株式会社鳥取銀行          | 9,061百万円   |                    |
| 株式会社トマト銀行         | 14,310百万円  |                    |
| 株式会社長崎銀行          | 7,621百万円   |                    |
| 株式会社長野銀行          | 13,000百万円  |                    |
| 株式会社名古屋銀行         | 25,090百万円  |                    |
| 株式会社南都銀行          | 37,924百万円  |                    |
| 株式会社西日本シティ銀行      | 85,745百万円  |                    |
| 株式会社肥後銀行          | 18,128百万円  |                    |
| 株式会社百五銀行          | 20,000百万円  |                    |
| 株式会社百十四銀行         | 37,322百万円  |                    |
| 株式会社広島銀行          | 54,573百万円  |                    |
| 株式会社福島銀行          | 18,682百万円  |                    |
| 株式会社福邦銀行          | 9,800百万円   |                    |
| 株式会社豊和銀行          | 12,495百万円  |                    |
| 株式会社北都銀行          | 12,500百万円  |                    |

|            |                          |                                   |
|------------|--------------------------|-----------------------------------|
| 株式会社北洋銀行   | 121,101百万円               |                                   |
| 株式会社北陸銀行   | 140,409百万円               |                                   |
| 株式会社北海道銀行  | 93,524百万円                |                                   |
| 株式会社みちのく銀行 | 36,986百万円                |                                   |
| 株式会社みなと銀行  | 39,984百万円                |                                   |
| 株式会社宮崎銀行   | 14,697百万円                |                                   |
| 株式会社宮崎太陽銀行 | 8,752百万円                 |                                   |
| 株式会社武蔵野銀行  | 45,743百万円                |                                   |
| 株式会社山形銀行   | 12,008百万円                |                                   |
| 株式会社山梨中央銀行 | 15,400百万円                |                                   |
| 株式会社琉球銀行   | 56,967百万円                |                                   |
| 信金中央金庫     | 690,998百万円 <sup>※2</sup> | 信用金庫法に基づき信用金庫連合会の事業を営んでいます。       |
| 朝日信用金庫     | 19,159百万円 <sup>※2</sup>  | 信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。          |
| 岡崎信用金庫     | 3,096百万円 <sup>※2</sup>   |                                   |
| 碧海信用金庫     | 1,215百万円 <sup>※2</sup>   |                                   |
| 近畿産業信用組合   | 25,801百万円 <sup>※2</sup>  | 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。 |
| 第一勧業信用組合   | 16,564百万円 <sup>※2</sup>  |                                   |
| 労働金庫連合会    | 120,000百万円 <sup>※2</sup> | 労働金庫法に基づき労働金庫の事業を営んでいます。          |

＊ 2024年2月末現在

※1 岩井コスモ証券株式会社は、2024年5月21日より募集・販売等の事務を開始する予定です。

※2 朝日信用金庫、岡崎信用金庫、近畿産業信用組合、信金中央金庫、第一勧業信用組合、碧海信用金庫および労働金庫連合会の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託者

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

### (2) 販売会社

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

※野村證券株式会社は、ファンドの投資助言を行ないます。なお、同社は金融商品取引法に基づき投資運用業および投資助言・代理業の登録を行なっています。

## 3【資本関係】

(2023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【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。
- (2) 目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。
- (3) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (4) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5) 目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。
- (6) 目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス(当該アドレスをコード化した図形等も含む)も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載する場合があります。
- (7) 目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8) 目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

## 独立監査人の監査報告書

2023年6月9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 公認会計士 湯 原 尚  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 水 永 真太郎  
業務執行社員

### 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2023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

2024年4月19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」に掲げられているのむラップ・ファンド（保守型）の2023年2月21日から2024年2月19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、のむラップ・ファンド（保守型）の2024年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年4月19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」に掲げられているのむラップ・ファンド（やや保守型）の2023年2月21日から2024年2月19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、のむラップ・ファンド（やや保守型）の2024年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年4月19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」に掲げられているのむラップ・ファンド（普通型）の2023年2月21日から2024年2月19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、のむラップ・ファンド（普通型）の2024年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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



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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年4月19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」に掲げられているのむラップ・ファンド（やや積極型）の2023年2月21日から2024年2月19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、のむラップ・ファンド（やや積極型）の2024年2月19日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## その他の記載内容

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

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

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

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2024年4月19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」に掲げられているのむラップ・ファンド（積極型）の2023年2月21日から2024年2月19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、のむラップ・ファンド（積極型）の2024年2月19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

2023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2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の中間会計期間（2023年4月1日から2023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2023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（2023年4月1日から2023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するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用し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。