

バランスセレクト50

追加型投信 内外 資産複合 インデックス型

【投資信託説明書（請求目論見書）】

（2024年2月1日）

この目論見書により行なうバランスセレクト50の募集については、発行者である野村アセットマネジメント株式会社（委託会社）は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第5条の規定により有価証券届出書を2023年7月31日に関東財務局長に提出しており、2023年8月1日にその効力が生じております。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書であり、投資家の請求により交付される請求目論見書です。

| | |
|------------|---------------------|
| 【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】 | : CEO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 |
| 【縦覧に供する場所】 | : 該当事項はありません。 |

NOMURA 野村アセットマネジメント

目次

| | |
|---------------------|-----|
| 目次 | 2 |
| 第一部【証券情報】 | 3 |
| (1)【ファンドの名称】 | 3 |
| (2)【内国投資信託受益証券の形態等】 | 3 |
| (3)【発行（売出）価額の総額】 | 3 |
| (4)【発行（売出）価格】 | 3 |
| (5)【申込手数料】 | 4 |
| (6)【申込単位】 | 4 |
| (7)【申込期間】 | 4 |
| (8)【申込取扱場所】 | 4 |
| (9)【払込期日】 | 4 |
| (10)【払込取扱場所】 | 4 |
| (11)【振替機関に関する事項】 | 5 |
| (12)【その他】 | 5 |
| 第二部【ファンド情報】 | 6 |
| 第1【ファンドの状況】 | 6 |
| 1【ファンドの性格】 | 6 |
| 2【投資方針】 | 12 |
| 3【投資リスク】 | 25 |
| 4【手数料等及び税金】 | 29 |
| 5【運用状況】 | 32 |
| 第2【管理及び運営】 | 49 |
| 1【申込（販売）手続等】 | 49 |
| 2【換金（解約）手続等】 | 50 |
| 3【資産管理等の概要】 | 51 |
| 4【受益者の権利等】 | 53 |
| 第3【ファンドの経理状況】 | 55 |
| 1【財務諸表】 | 58 |
| 【中間財務諸表】 | 226 |
| 2【ファンドの現況】 | 244 |
| 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】 | 246 |
| 第三部【委託会社等の情報】 | 247 |
| 第1【委託会社等の概況】 | 247 |
| 1【委託会社等の概況】 | 247 |
| 2【事業の内容及び営業の概況】 | 249 |
| 3【委託会社等の経理状況】 | 250 |
| 4【利害関係人との取引制限】 | 301 |
| 5【その他】 | 301 |
| 約款 | 302 |

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

バランスセレクト 50

(以下「ファンド」といいます。)

(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、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けており、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】

5,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額[※]とします。

なお、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

※ 「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 取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（税抜 1.0%）以内*で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

※詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

(6) 【申込単位】

| | |
|--------------------------------|--|
| 一般コース (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 1 万円以上 1 円単位 |
| 自動けいぞく投資コース (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。

(7) 【申込期間】

2023 年 8 月 1 日から 2024 年 7 月 31 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、上記の期日以前に取得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。)の指定する口座を経由して、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

(1 1) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

◆内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象[※]とし、これらに分散投資するバランス運用を行うことで、キャピタルゲインとインカムゲインを総合したトータルリターンの獲得を目指します。

※ ファンドは、「国内株式マザーファンド」「外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

■信託金の限度額■

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

<商品分類>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。
 なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に網掛け表示しております。

(バランスセレクト 50)

《商品分類表》

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産 (収益の源泉) | 補足分類 |
|---------|--------|-------------------|---------|
| 単位型 | 国内 | 株式 | インデックス型 |
| 追加型 | 海外 | 債券 | 特殊型 |
| | 内外 | 不動産投信 | |
| | | その他資産 () | |
| | | 資産複合 | |

《属性区分表》

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ | 対象インデックス |
|---|---|--------------------------------|--------------|-----------|--------------------|
| 株式 一般 大型株 中小型株 | 年1回 | グローバル (日本を含む) | | | |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () | 年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月) | 日本 北米 欧州 アジア オセアニア | ファミリーファンド | あり () | 日経225 TOPIX |
| 不動産投信 | 日々 | 中南米 | ファンド・オブ・ファンズ | なし | |
| その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、 債券)資産配分 固定型)) | その他 () | アフリカ 中近東 (中東) エマージング | | | その他 (合成指数) |
| 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | | | | | |

当ファンドは、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。

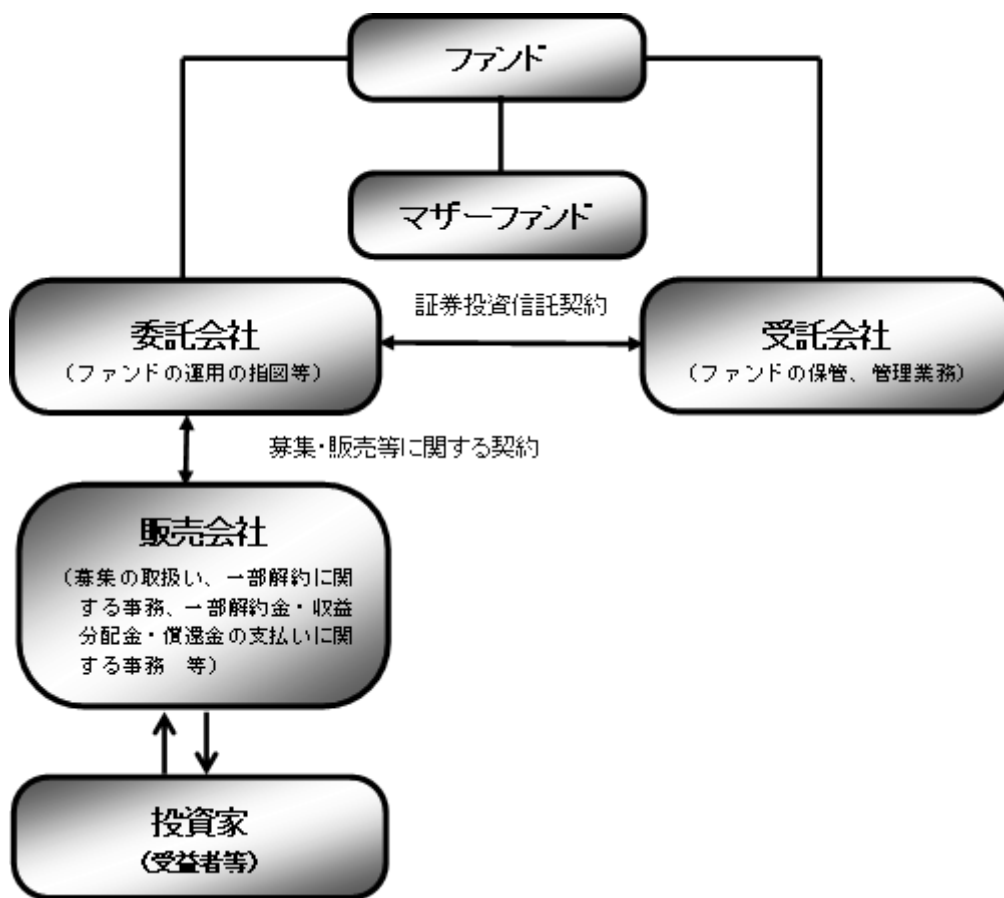
- (2) 条件付運用型…目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型/絶対収益追求型…目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4) その他型…目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊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

2001年5月11日

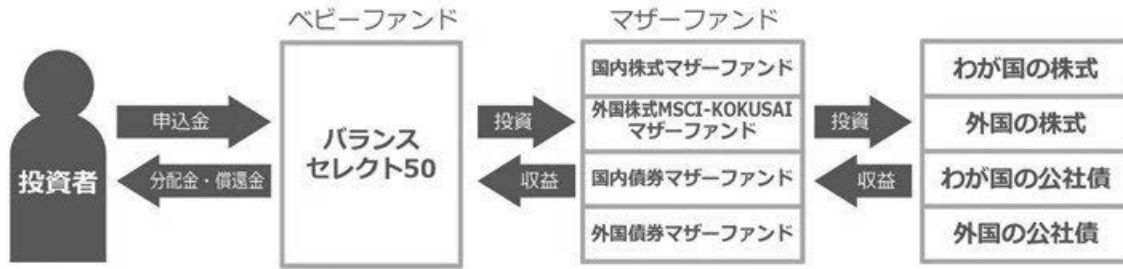
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



| | |
|--------------------|--|
| ファンド | バランスセレクト50 |
| マザーファンド (親投資信託) | 国内株式マザーファンド 外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド 国内債券マザーファンド 外国債券マザーファンド |
| 委託会社(委託者) | 野村アセットマネジメント株式会社 |
| 受託会社(受託者) | 野村信託銀行株式会社 |

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



■委託会社の概況(2023年12月末現在)■

- ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

- ・資本金の額

17,180百万円

- ・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

- ・大株主の状況

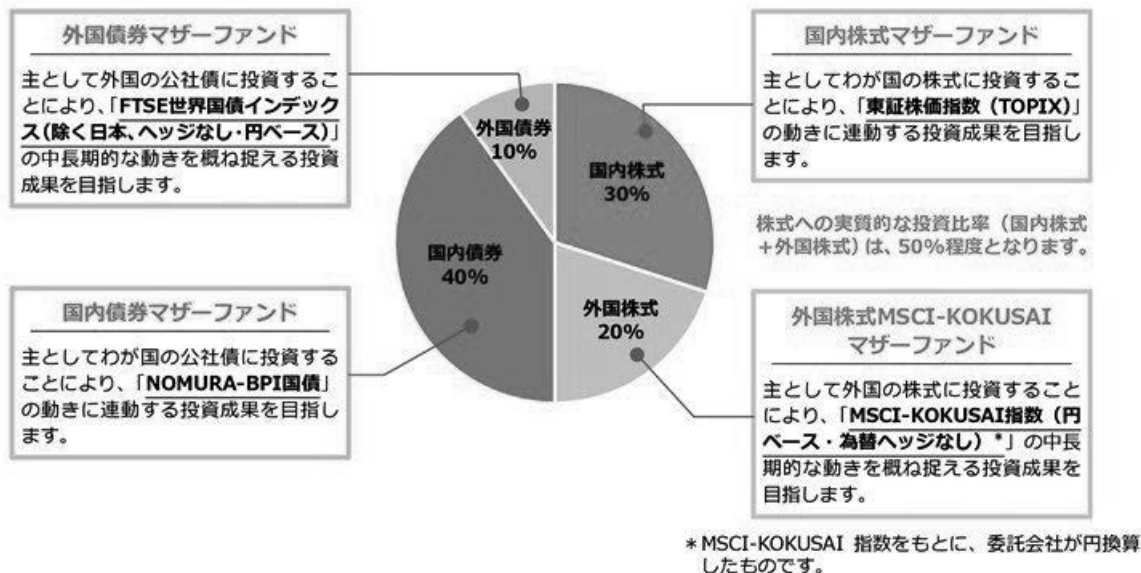
| 名称 | 住所 | 所有株式数 | 比率 |
|----------------|------------------|------------|------|
| 野村ホールディングス株式会社 | 東京都中央区日本橋 1-13-1 | 5,150,693株 | 100% |

2 【投資方針】

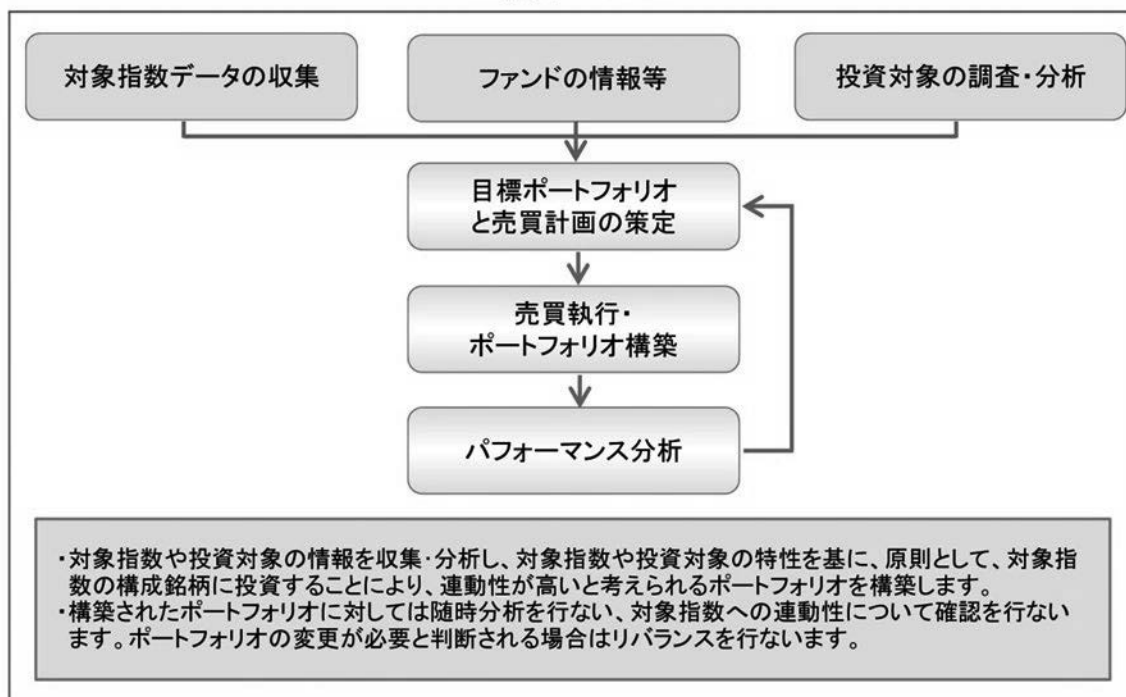
(1) 【投資方針】

[1] 内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

- ◆運用にあたっては、「国内株式マザーファンド」「外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券に投資を行ないます。
- ◆各マザーファンドへの投資比率は以下を基本とし、原則として3ヵ月毎にリバランスを行ないます。



■ 投資プロセス ■



* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

■各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について■

東証株価指数 (TOPIX)

- ①東証株価指数 (TOPIX) の指数値及び東証株価指数 (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、利用など東証株価指数 (TOPIX) に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数 (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。
- ② J P X は、東証株価指数 (TOPIX) の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証株価指数 (TOPIX) の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証株価指数 (TOPIX) 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。
- ③ J P X は、東証株価指数 (TOPIX) の指数値及び東証株価指数 (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東証株価指数 (TOPIX) の指数値について、何ら保証、言及をするものではない。
- ④ J P X は、東証株価指数 (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、東証株価指数 (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。
- ⑥ J P X は、本件商品の購入者又は公衆に対し、本件商品の説明又は投資のアドバイスをする義務を負わない。
- ⑦ J P X は、当社又は本件商品の購入者のニーズを東証株価指数 (TOPIX) の指数値を算出する銘柄構成及び計算に考慮するものではない。
- ⑧以上の項目に限らず、J P X は本件商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しない。

MSCI-KOKUSAI 指数

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

MSCI は、自らが信頼できると考える情報源から本件指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性及び/または完全性について保証するものではありません。MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、本件ファンドの発行会社、本件ファンドの所有者その他の個人・法人が、本契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される

権利に関連して本件指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証をおこなうものではありません。MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数及びそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。本件指数及びそれに含まれるデータに関し、MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつ MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害（逸失利益を含む。）につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI、MSCI の関連会社及び MSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。本証券の購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめ MSCI に問い合わせることなく、本証券を保証、推奨、売買、又は宣伝するためにいかなる MSCI のトレードネーム、トレードマーク、又はサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前に MSCI の書面による許諾を得ることなく MSCI との関係は一切主張することはできません。

NOMURA-BPI 国債

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

FTSE 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

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

[2] 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。

- ◆外貨建資産に投資するマザーファンドにおいても、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。

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】

内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」「外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド」「国内債券マザーファンド」「外国債券マザーファンド」の各受益証券を主要投資対象とします。なお、株式および公社債に直接投資する場合もあります。また、デリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定します。

① 投資の対象とする資産の種類(約款第 20 条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 1 項で定めるもの

をいいます。以下同じ。)

イ 有価証券

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

ハ 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2 次に掲げる特定資産以外の資産

イ 為替手形

② 有価証券の指図範囲(約款第21条第1項)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である下記の各マザーファンド受益証券のほか、

国内株式マザーファンド受益証券(以下「国内株式マザーファンド」といいます。)

外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド受益証券(以下「外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド」といいます。)

国内債券マザーファンド受益証券(以下「国内債券マザーファンド」といいます。)

外国債券マザーファンド受益証券(以下「外国債券マザーファンド」といいます。)

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

1 株券または新株引受権証書

2 国債証券

3 地方債証券

4 特別の法律により法人の発行する債券(金融商品取引法第2条第1項第3号で定めるものをいいます。)

5 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)

6 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)

7 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)

8 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10 コマーシャル・ペーパー

11 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券

12 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

14 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

15 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

16 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

17 外国法人が発行する譲渡性預金証書

18 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの

- 19 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
- 20 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。）
- 21 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを「公社債」といい、第13号および第14号の証券を「投資信託証券」といいます。

③ 金融商品の指図範囲(約款第21条第2項)

委託者は、信託金を、次の金融商品（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)投資対象 ②有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。）
- 3 コール・ローン
- 4 手形割引市場において売買される手形
- 5 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

④ その他の投資対象

- 1 先物取引等
- 2 スワップ取引

(参考)各マザーファンドの概要

(国内株式マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資は行いません。
- 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者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ 10%、合計で 20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド)

運用の基本方針

約款第 13 条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

- ① 株式への投資割合には制限を設けません。
- ② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
- ③ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 20%以内とします。
- ④ 有価証券先物取引等は約款第 17 条の範囲で行ないます。
- ⑤ スワップ取引は約款第 18 条の範囲で行ないます。
- ⑥ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。
- ⑦ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。
- ⑧ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。
- ⑨ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

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

(国内債券マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

(3) 投資制限

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

(外国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

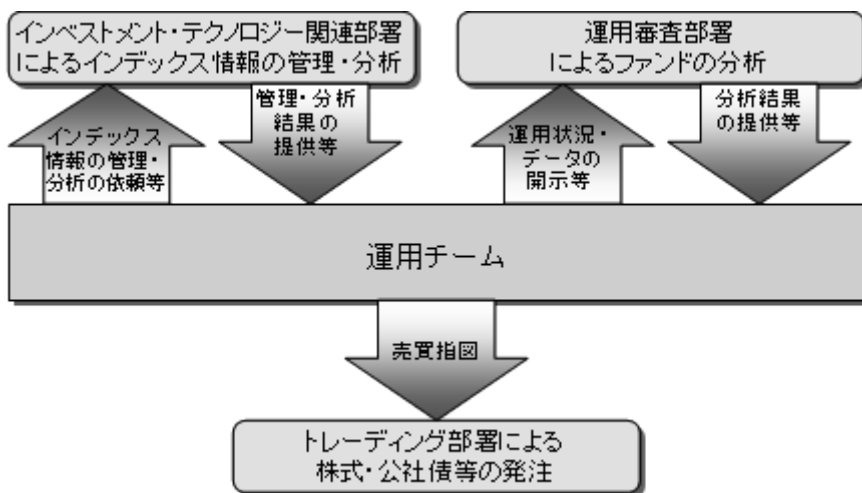
外国の公社債を主要投資対象とします。

(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。

(3) 【運用体制】

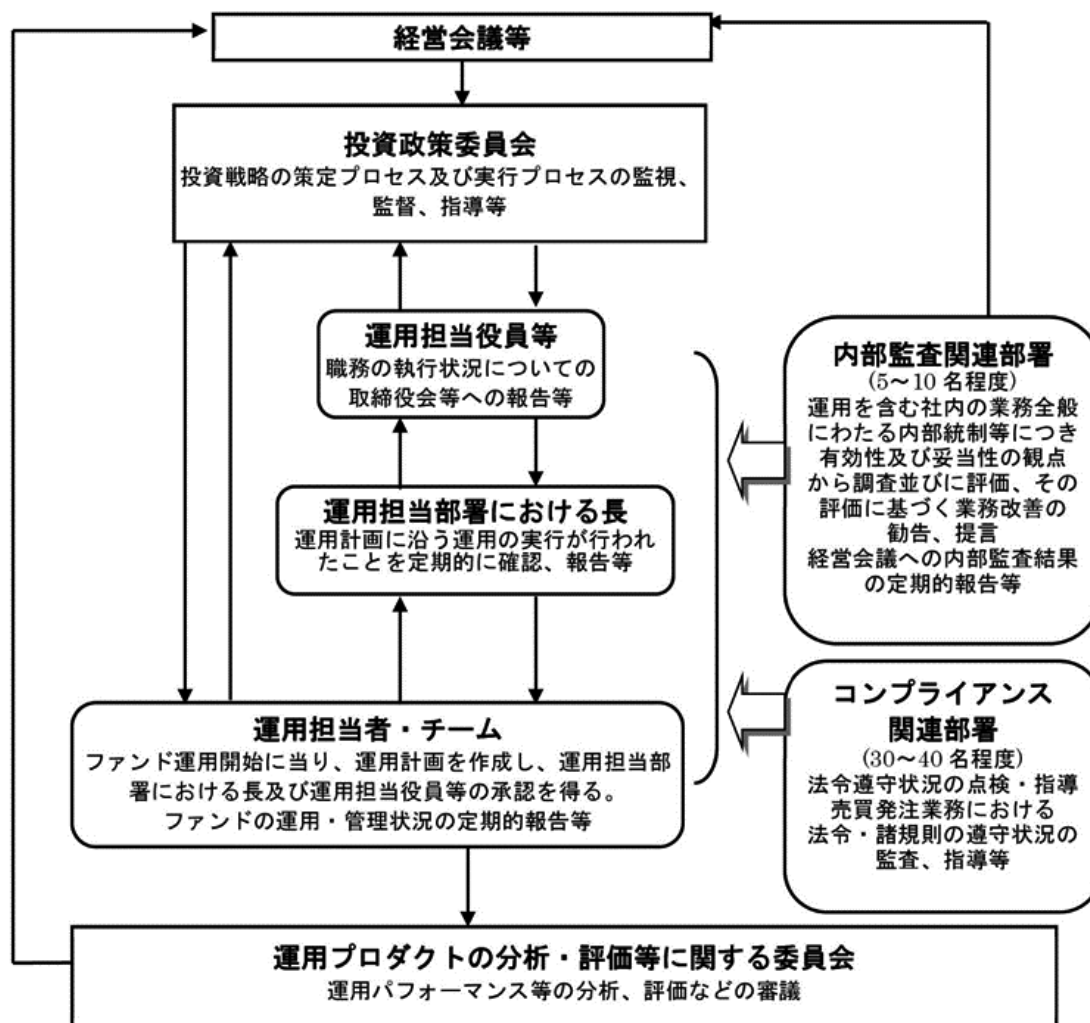
ファンドの運用体制は以下の通りです。



※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】

年1回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

- 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・配当収入と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、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いません。
※ 利子・配当収入とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料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5月10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。なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。「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】

① 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)

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

② 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)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の40%以内とします。

③ デリバティブの使用はヘッジ目的に限定します。

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

(運用の基本方針 2. 運用方法 (3)投資制限)

④ 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第27条)

(i)委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組

入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等(株式、株価指数に係る先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに上記「(2) 投資対象 ③金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(ii) 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。)、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の時価総額と各マザーファンド(国内株式マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド、国内債券マザーファンドおよび外国債券マザーファンドをいいます。以下本項において同じ。)の信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する各マザーファンドの時価総額に各マザーファンドの信託財産純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(iii) 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記「(2) 投資対象 ③金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

2 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに上記「(2) 投資対象 ③金融商品の指図範囲」の第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額(本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3 コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取

引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑤ スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第28条)

- (i) 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(「スワップ取引」)を行なうことの指図をすることができます。
- (ii) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (iii) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額と各マザーファンド(国内株式マザーファンド、外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド、国内債券マザーファンドおよび外国債券マザーファンドをいいます。以下本項において同じ。)の信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (iv) 上記(iii)において各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額に各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (v) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- (vi) 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑥ 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

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

⑦ 投資信託証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

⑧ 投資する株式等の範囲(約款第23条)

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

⑨ 同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

⑩ 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(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)
同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

⑪ 同一銘柄の転換社債等への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)
同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債[※]への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

※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。

⑫ 信用取引の指図範囲(約款第26条)

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

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

- 1 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2 株式分割により取得する株券
- 3 有償増資により取得する株券
- 4 売り出しにより取得する株券
- 5 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
- 6 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

⑬ 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第30条)

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

- 1 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないこととします。
- 2 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

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

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

⑭ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第32条)

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

⑮ 外国為替予約の指図(約款第33条)

(i) 委託者は、信託財産に属する外貨建資産と外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属する外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの時価総額に外国株式MSCI-KOKUSAI マザーフ

ファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

(ii) 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

⑩ 資金の借入れ(約款第 42 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。

⑪ 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)

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

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

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

(ii) 当該株式に係る議決権の総数に 100 分の 50 の率を乗じて得た数

3 【投資リスク】

≪基準価額の変動要因≫

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

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

[株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

[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いませんので、為替変動の影響を受けます。

[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いますのでこれらの影響を受けます。

※ 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滞る可能性があります。
- 有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。
- 投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

《委託会社におけるリスクマネジメント体制》

リスク管理関連の委員会

◆パフォーマンスの考査

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

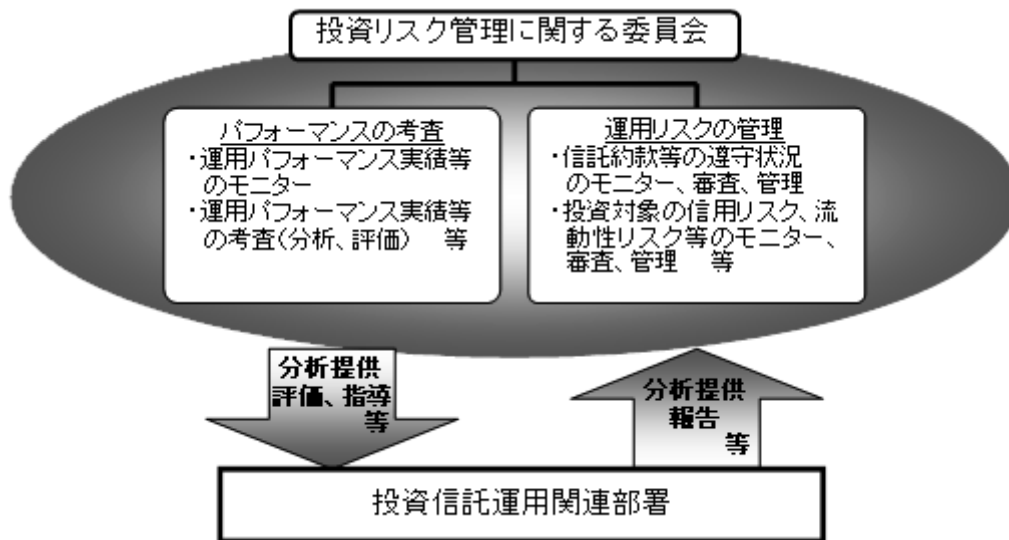
◆運用リスクの管理

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

※流動性リスク管理について

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

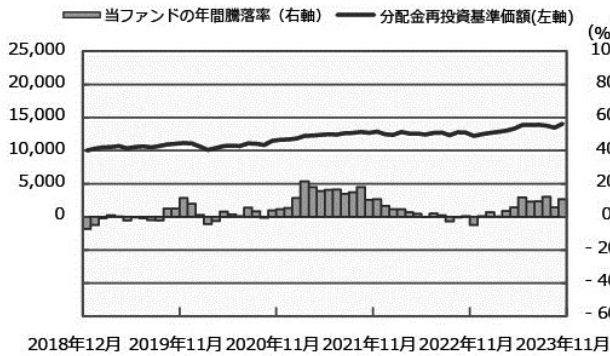
リスク管理体制図



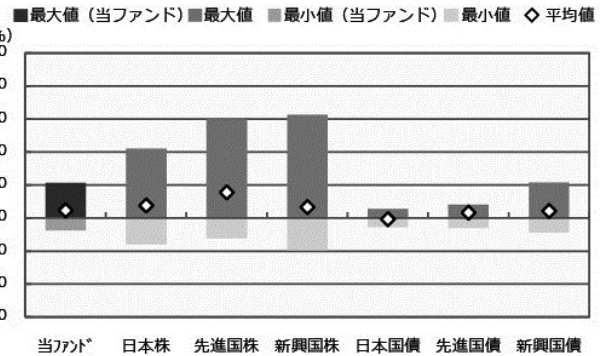
※投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

リスクの定量的比較 (2018年12月末～2023年11月末：月次)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



| | 当ファンド | 日本株 | 先進国株 | 新興国株 | 日本国債 | 先進国債 | 新興国債 |
|---------|-------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|
| 最大値 (%) | 21.3 | 42.1 | 59.8 | 62.7 | 5.4 | 8.0 | 21.5 |
| 最小値 (%) | △ 7.5 | △ 16.0 | △ 12.4 | △ 19.4 | △ 5.5 | △ 6.1 | △ 8.8 |
| 平均値 (%) | 4.7 | 7.6 | 15.4 | 6.6 | △ 0.6 | 3.3 | 4.3 |

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2018年12月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2018年12月から2023年11月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2018年12月から2023年11月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<代表的な資産クラスの指数>

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

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)・・・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、知的財産その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド (円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド (円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェント、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「JPMSLLC」と呼びます) (「指数スポンサー」)は、指数に関する証券、金融商品または取引 (ここでは「プロダクト」と呼びます) についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると思われる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。
- JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPMS, 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 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*で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

② 収益分配金を再投資する場合には手数料は無手数料とします。

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

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.715%（税抜年0.65%）の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

| | | |
|--------|--------|--------|
| <委託会社> | <販売会社> | <受託会社> |
| 年0.26% | 年0.34% | 年0.05% |

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

《支払先の役務の内容》

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

(4) 【その他の手数料等】

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信託財産から支払われます。

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は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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信託財産中から支払われます。

- 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*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口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

◆個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

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

なお、配当控除の適用があります。

<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せん。

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

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

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

◆法人の投資家に対する課税

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

※源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■換金（解約）時および償還時の課税について■

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

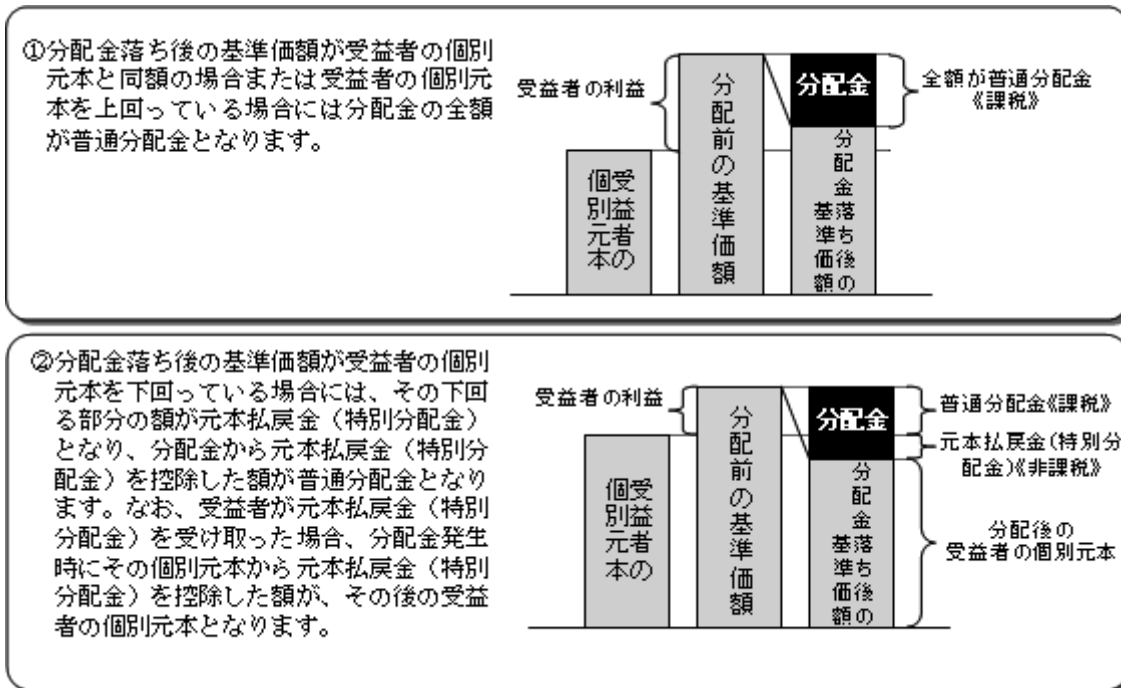
なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

■個別元本について■

- ◆追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。
- ◆受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

■分配金の課税について■

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



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

※外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
 ※上記は 2023 年 11 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。

5 【運用状況】

以下は2023年11月30日現在の運用状況であります。

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

(1) 【投資状況】

バランスセレクト50

| 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 | 2,150,910,520 | 99.99 |
| 現金・預金・その他資産 (負債控除後) | — | 2,150,166 | 0.09 |
| 合計 (純資産総額) | | 2,153,060,686 | 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 | 601,153,865,080 | 98.89 |
| 現金・預金・その他資産 (負債控除後) | — | 6,698,909,571 | 1.10 |
| 合計 (純資産総額) | | 607,852,774,651 | 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 | 6,676,560,000 | 1.09 |

(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 | 1,359,031,271,184 | 71.94 |
| | カナダ | 61,809,690,595 | 3.27 |
| | ドイツ | 46,029,082,955 | 2.43 |
| | イタリア | 14,268,797,508 | 0.75 |
| | フランス | 63,006,898,027 | 3.33 |
| | オランダ | 25,378,564,005 | 1.34 |
| | スペイン | 14,243,712,435 | 0.75 |
| | ベルギー | 4,164,136,259 | 0.22 |
| | オーストリア | 1,043,078,418 | 0.05 |
| | ルクセンブルグ | 261,047,321 | 0.01 |
| | フィンランド | 4,551,921,769 | 0.24 |
| | アイルランド | 2,735,435,273 | 0.14 |
| | ポルトガル | 1,194,749,810 | 0.06 |
| | スイス | 605,389,548 | 0.03 |
| | イギリス | 78,715,224,313 | 4.16 |
| | スイス | 52,319,839,394 | 2.76 |

| | | | |
|--------------------|----------|-------------------|--------|
| | スウェーデン | 17,463,975,283 | 0.92 |
| | ノルウェー | 3,618,928,453 | 0.19 |
| | デンマーク | 17,953,938,044 | 0.95 |
| | オーストラリア | 35,801,783,046 | 1.89 |
| | ニュージーランド | 1,026,570,717 | 0.05 |
| | 香港 | 10,693,875,994 | 0.56 |
| | シンガポール | 5,819,513,611 | 0.30 |
| | イスラエル | 2,035,729,083 | 0.10 |
| | 小計 | 1,823,773,153,045 | 96.54 |
| 新株予約権証券 | カナダ | 0 | 0.00 |
| 投資証券 | アメリカ | 32,133,199,437 | 1.70 |
| | カナダ | 156,932,634 | 0.00 |
| | フランス | 707,479,373 | 0.03 |
| | ベルギー | 152,504,202 | 0.00 |
| | イギリス | 584,721,758 | 0.03 |
| | オーストラリア | 2,234,840,340 | 0.11 |
| | 香港 | 432,396,840 | 0.02 |
| | シンガポール | 776,445,971 | 0.04 |
| | 小計 | 37,178,520,555 | 1.96 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | — | 28,014,552,033 | 1.48 |
| 合計（純資産総額） | | 1,888,966,225,633 | 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 | 20,384,078,473 | 1.07 |
| | 買建 | カナダ | 917,977,881 | 0.04 |
| | 買建 | ドイツ | 2,609,760,944 | 0.13 |
| | 買建 | イギリス | 1,168,224,563 | 0.06 |
| | 買建 | スイス | 765,083,719 | 0.04 |
| | 買建 | オーストラリア | 549,929,838 | 0.02 |

(参考) 国内債券マザーファンド

| 資産の種類 | 国／地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|--------------------|------|----------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 18,935,890,450 | 99.49 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | — | 95,632,550 | 0.50 |
| 合計（純資産総額） | | 19,031,523,000 | 100.00 |

(参考) 外国債券マザーファンド

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

| | | | |
|--------------------|----------------|-----------------|--------|
| 国債証券 | アメリカ | 375,162,380,610 | 47.32 |
| | カナダ | 15,478,931,031 | 1.95 |
| | メキシコ | 7,058,012,879 | 0.89 |
| | ドイツ | 42,954,637,538 | 5.41 |
| | イタリア | 70,486,779,171 | 8.89 |
| | フランス | 57,717,424,673 | 7.28 |
| | オランダ | 11,129,262,881 | 1.40 |
| | スペイン | 45,294,212,120 | 5.71 |
| | ベルギー | 13,733,233,263 | 1.73 |
| | オーストリア | 10,097,082,699 | 1.27 |
| | フィンランド | 2,882,867,461 | 0.36 |
| | アイルランド | 3,691,472,272 | 0.46 |
| | イギリス | 39,946,264,704 | 5.03 |
| | スウェーデン | 1,594,022,371 | 0.20 |
| | ノルウェー | 1,368,459,164 | 0.17 |
| | デンマーク | 2,539,288,911 | 0.32 |
| | ポーランド | 4,018,380,052 | 0.50 |
| | オーストラリア | 11,565,522,076 | 1.45 |
| | ニュージーランド | 1,816,058,683 | 0.22 |
| | シンガポール | 3,383,046,214 | 0.42 |
| マレーシア | 4,045,925,485 | 0.51 | |
| 中国 | 56,264,110,208 | 7.09 | |
| イスラエル | 2,418,838,450 | 0.30 | |
| | 小計 | 784,646,212,916 | 98.98 |
| 現金・預金・その他資産（負債控除後） | — | 8,024,067,928 | 1.01 |
| 合計（純資産総額） | | 792,670,280,844 | 100.00 |

（2）【投資資産】

① 【投資有価証券の主要銘柄】

バランスセレクト50

| 順位 | 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価(円) | 簿価金額(円) | 評価単価(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|----|------|---------------|-----------------------------|-------------|---------|-------------|---------|-------------|---------|
| 1 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内債券マザーファンド | 671,452,515 | 1.3199 | 886,250,175 | 1.2898 | 866,039,453 | 40.22 |
| 2 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内株式マザーファンド | 243,666,233 | 2.2981 | 559,969,371 | 2.6423 | 643,839,287 | 29.90 |
| 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 | 74,224,981 | 4.8714 | 361,585,843 | 5.7302 | 425,323,986 | 19.75 |
| 4 | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 外国債券マザーファンド | 76,799,870 | 2.5945 | 199,257,263 | 2.8087 | 215,707,794 | 10.01 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.90 |
| 合計 | 99.90 |

(参考) 国内株式マザーファンド

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価(円) | 簿価金額(円) | 評価単価(円) | 評価金額(円) | 投資比率(%) |
|----|------|----|-------------------|--------|------------|-----------|----------------|-----------|----------------|---------|
| 1 | 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 9,784,000 | 1,975.14 | 19,324,851,360 | 2,794.50 | 27,341,388,000 | 4.49 |
| 2 | 日本 | 株式 | ソニーグループ | 電気機器 | 1,260,400 | 12,552.83 | 15,821,594,372 | 12,820.00 | 16,158,328,000 | 2.65 |
| 3 | 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 10,990,400 | 886.58 | 9,743,900,580 | 1,255.00 | 13,792,952,000 | 2.26 |
| 4 | 日本 | 株式 | キーエンス | 電気機器 | 178,300 | 63,974.82 | 11,406,710,750 | 63,350.00 | 11,295,305,000 | 1.85 |
| 5 | 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 53,157,300 | 167.34 | 8,895,486,788 | 173.10 | 9,201,528,630 | 1.51 |
| 6 | 日本 | 株式 | 東京エレクトロン | 電気機器 | 377,100 | 16,095.75 | 6,069,709,123 | 24,025.00 | 9,059,827,500 | 1.49 |
| 7 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,247,700 | 5,755.04 | 7,180,575,692 | 7,258.00 | 9,055,806,600 | 1.48 |
| 8 | 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 864,900 | 7,913.50 | 6,844,387,232 | 10,285.00 | 8,895,496,500 | 1.46 |
| 9 | 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 1,245,200 | 5,582.82 | 6,951,730,466 | 6,886.00 | 8,574,447,200 | 1.41 |
| 10 | 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 1,618,500 | 4,068.77 | 6,585,312,088 | 5,212.00 | 8,435,622,000 | 1.38 |
| 11 | 日本 | 株式 | 任天堂 | その他製品 | 1,125,000 | 5,779.41 | 6,501,843,186 | 6,912.00 | 7,776,000,000 | 1.27 |
| 12 | 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 1,420,400 | 4,466.71 | 6,344,515,629 | 5,392.00 | 7,658,796,800 | 1.25 |
| 13 | 日本 | 株式 | リクルートホールディングス | サービス業 | 1,356,100 | 3,916.12 | 5,310,651,395 | 5,505.00 | 7,465,330,500 | 1.22 |
| 14 | 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 1,267,300 | 4,792.82 | 6,073,946,065 | 5,738.00 | 7,271,767,400 | 1.19 |
| 15 | 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 1,581,600 | 4,555.84 | 7,205,517,367 | 4,165.00 | 6,587,364,000 | 1.08 |
| 16 | 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 4,345,200 | 1,240.63 | 5,390,790,776 | 1,509.00 | 6,556,906,800 | 1.07 |
| 17 | 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 1,380,900 | 4,228.64 | 5,839,336,130 | 4,625.00 | 6,386,662,500 | 1.05 |
| 18 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 1,734,600 | 2,794.09 | 4,846,640,708 | 3,648.00 | 6,327,820,800 | 1.04 |
| 19 | 日本 | 株式 | 第一三共 | 医薬品 | 1,556,800 | 4,412.05 | 6,868,689,752 | 4,000.00 | 6,227,200,000 | 1.02 |
| 20 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 2,368,700 | 2,045.01 | 4,844,019,629 | 2,512.00 | 5,950,174,400 | 0.97 |
| 21 | 日本 | 株式 | HOYA | 精密機器 | 353,900 | 15,049.66 | 5,326,075,400 | 16,665.00 | 5,897,743,500 | 0.97 |
| 22 | 日本 | 株式 | ソフトバンクグループ | 情報・通信業 | 881,500 | 5,295.67 | 4,668,136,044 | 6,020.00 | 5,306,630,000 | 0.87 |
| 23 | 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 2,875,300 | 1,540.46 | 4,429,301,900 | 1,798.50 | 5,171,227,050 | 0.85 |
| 24 | 日本 | 株式 | オリエンタルランド | サービス業 | 969,300 | 4,882.78 | 4,732,883,470 | 5,025.00 | 4,870,732,500 | 0.80 |
| 25 | 日本 | 株式 | ダイキン工業 | 機械 | 214,800 | 25,591.95 | 5,497,151,240 | 22,155.00 | 4,758,894,000 | 0.78 |
| 26 | 日本 | 株式 | 村田製作所 | 電気機器 | 1,621,100 | 2,587.03 | 4,193,841,182 | 2,883.50 | 4,674,441,850 | 0.76 |
| 27 | 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 1,066,100 | 3,009.22 | 3,208,130,980 | 3,801.00 | 4,052,246,100 | 0.66 |
| 28 | 日本 | 株式 | 三菱電機 | 電気機器 | 2,003,000 | 1,749.98 | 3,505,215,126 | 2,009.00 | 4,024,027,000 | 0.66 |
| 29 | 日本 | 株式 | SMC | 機械 | 53,900 | 69,957.59 | 3,770,714,589 | 74,450.00 | 4,012,855,000 | 0.66 |
| 30 | 日本 | 株式 | 丸紅 | 卸売業 | 1,571,800 | 1,983.82 | 3,118,180,689 | 2,307.00 | 3,626,142,600 | 0.59 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内／国外 | 業種 | 投資比率(%) |
|------------|-------|----------|---------|
| 株式 | 国内 | 水産・農林業 | 0.08 |
| | | 鉱業 | 0.36 |
| | | 建設業 | 2.05 |
| | | 食料品 | 3.39 |
| | | 繊維製品 | 0.41 |
| | | パルプ・紙 | 0.16 |
| | | 化学 | 5.91 |
| | | 医薬品 | 4.70 |
| | | 石油・石炭製品 | 0.47 |
| | | ゴム製品 | 0.71 |
| | | ガラス・土石製品 | 0.67 |
| | | 鉄鋼 | 0.96 |
| | | 非鉄金属 | 0.67 |
| | | 金属製品 | 0.52 |
| | | 機械 | 5.15 |
| | | 電気機器 | 17.11 |
| | | 輸送用機器 | 8.57 |
| | | 精密機器 | 2.30 |
| | | その他製品 | 2.27 |
| | | 電気・ガス業 | 1.36 |
| | | 陸運業 | 2.74 |
| | | 海運業 | 0.74 |
| | | 空運業 | 0.44 |
| | | 倉庫・運輸関連業 | 0.14 |
| | | 情報・通信業 | 7.59 |
| | | 卸売業 | 6.94 |
| | | 小売業 | 4.23 |
| | | 銀行業 | 7.10 |
| 証券、商品先物取引業 | 0.78 | | |
| 保険業 | 2.41 | | |
| その他金融業 | 1.13 | | |
| 不動産業 | 1.93 | | |
| サービス業 | 4.75 | | |
| 合 計 | | | 98.89 |

(参考) 外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド

| 順位 | 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|----|-----------|------|-----------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 株式 | APPLE INC | コンピュ | 3,687,800 | 23,966.77 | 88,384,672,022 | 27,850.64 | 102,707,611,950 | 5.43 |

| | | | | | | | | | | |
|----|-----------|----|--------------------------------|---|-----------|------------|----------------|------------|----------------|------|
| | | | | ータ・周 辺機器 | | | | | | |
| 2 | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウ ェア | 1,656,200 | 42,137.40 | 69,787,972,329 | 55,717.46 | 92,279,272,986 | 4.88 |
| 3 | アメリカ | 株式 | AMAZON.COM INC | 大規模小 売り | 2,165,100 | 15,255.06 | 33,028,737,328 | 21,519.28 | 46,591,398,324 | 2.46 |
| 4 | アメリカ | 株式 | NVIDIA CORP | 半導体・ 半導体製 造装置 | 579,140 | 41,632.38 | 24,110,978,273 | 70,799.49 | 41,002,821,272 | 2.17 |
| 5 | アメリカ | 株式 | ALPHABET INC-CL A | インタラ クティ ブ・メデ ィアおよ びサービ ス | 1,393,000 | 15,056.63 | 20,973,898,510 | 19,852.97 | 27,655,200,165 | 1.46 |
| 6 | 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 | 518,700 | 31,267.61 | 16,218,512,056 | 48,856.65 | 25,341,946,430 | 1.34 |
| 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 | 1,239,500 | 15,089.79 | 18,703,805,647 | 20,060.34 | 24,864,801,346 | 1.31 |
| 8 | アメリカ | 株式 | TESLA INC | 自動車 | 668,800 | 29,130.43 | 19,482,436,666 | 35,905.66 | 24,013,711,962 | 1.27 |
| 9 | 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 | 218,270 | 69,450.19 | 15,158,894,584 | 78,679.50 | 17,173,376,342 | 0.90 |
| 10 | アメリカ | 株式 | ELI LILLY & CO. | 医薬品 | 189,180 | 51,768.88 | 9,793,638,017 | 87,044.85 | 16,467,144,761 | 0.87 |
| 11 | アメリカ | 株式 | BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 金融サー ビス | 303,900 | 45,195.10 | 13,734,791,784 | 52,752.53 | 16,031,496,389 | 0.84 |
| 12 | アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 銀行 | 685,200 | 19,048.13 | 13,051,783,274 | 22,695.84 | 15,551,191,212 | 0.82 |
| 13 | アメリカ | 株式 | BROADCOM INC | 半導体・ 半導体製 造装置 | 103,927 | 94,596.96 | 9,831,178,673 | 138,367.86 | 14,380,157,428 | 0.76 |
| 14 | アメリカ | 株式 | VISA INC-CLASS A SHARES | 金融サー ビス | 379,400 | 32,783.96 | 12,438,235,837 | 37,389.60 | 14,185,616,554 | 0.75 |
| 15 | アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | 石油・ガ ス・消耗 燃料 | 939,300 | 16,115.83 | 15,137,603,744 | 15,051.14 | 14,137,539,371 | 0.74 |
| 16 | アメリカ | 株式 | JOHNSON & JOHNSON | 医薬品 | 564,546 | 22,589.76 | 12,752,959,888 | 22,370.81 | 12,629,355,649 | 0.66 |
| 17 | アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品 | 552,600 | 21,697.66 | 11,990,128,953 | 22,226.68 | 12,282,468,397 | 0.65 |
| 18 | アメリカ | 株式 | MASTERCARD INC | 金融サー ビス | 198,400 | 53,037.80 | 10,522,699,713 | 60,272.22 | 11,958,009,916 | 0.63 |
| 19 | デンマー ク | 株式 | NOVO NORDISK A/S-B | 医薬品 | 765,100 | 11,802.91 | 9,030,411,794 | 14,932.40 | 11,424,782,300 | 0.60 |
| 20 | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT | 専門小売 り | 235,700 | 42,045.43 | 9,910,108,586 | 45,741.71 | 10,781,321,377 | 0.57 |
| 21 | スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品 | 626,000 | 18,606.41 | 11,647,617,746 | 16,709.35 | 10,460,054,853 | 0.55 |
| 22 | アメリカ | 株式 | ADOBE INC | ソフトウ ェア | 106,900 | 57,106.65 | 6,104,701,717 | 90,799.54 | 9,706,471,606 | 0.51 |
| 23 | オランダ | 株式 | ASML HOLDING NV | 半導体・ 半導体製 造装置 | 94,520 | 100,400.56 | 9,489,861,174 | 101,622.09 | 9,605,320,136 | 0.50 |
| 24 | アメリカ | 株式 | CHEVRON CORP | 石油・ガ ス・消耗 燃料 | 425,400 | 23,857.68 | 10,149,059,773 | 21,164.84 | 9,003,524,510 | 0.47 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----|------------------------------|-------------|---------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 25 | アメリカ | 株式 | COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 生活必需品流通・小売り | 103,900 | 72,783.53 | 7,562,209,342 | 86,456.57 | 8,982,837,644 | 0.47 |
| 26 | アメリカ | 株式 | MERCK & CO INC | 医薬品 | 594,900 | 15,581.05 | 9,269,171,154 | 14,873.18 | 8,848,060,196 | 0.46 |
| 27 | アメリカ | 株式 | ABBVIE INC | バイオテクノロジー | 413,700 | 23,118.10 | 9,563,961,914 | 20,369.19 | 8,426,735,971 | 0.44 |
| 28 | アメリカ | 株式 | COCA COLA CO | 飲料 | 963,200 | 9,055.91 | 8,722,657,990 | 8,563.88 | 8,248,735,092 | 0.43 |
| 29 | アメリカ | 株式 | WALMART INC | 生活必需品流通・小売り | 347,300 | 21,534.11 | 7,478,799,707 | 22,954.68 | 7,972,162,309 | 0.42 |
| 30 | アメリカ | 株式 | PEPSICO INC | 飲料 | 322,800 | 26,516.67 | 8,559,582,362 | 24,584.22 | 7,935,786,603 | 0.42 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 国内／国外 | 業種 | 投資比率(%) |
|----------------|-------|----------------------|---------|
| 株式 | 国外 | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 4.25 |
| | | メディア | 0.66 |
| | | 娯楽 | 1.02 |
| | | 不動産管理・開発 | 0.32 |
| | | エネルギー設備・サービス | 0.27 |
| | | 石油・ガス・消耗燃料 | 4.58 |
| | | 化学 | 1.87 |
| | | 建設資材 | 0.30 |
| | | 容器・包装 | 0.21 |
| | | 金属・鉱業 | 1.45 |
| | | 紙製品・林産品 | 0.09 |
| | | 航空宇宙・防衛 | 1.70 |
| | | 建設関連製品 | 0.60 |
| | | 建設・土木 | 0.31 |
| | | 電気設備 | 0.85 |
| | | コングロマリット | 0.89 |
| | | 機械 | 1.77 |
| | | 商社・流通業 | 0.42 |
| | | 商業サービス・用品 | 0.56 |
| | | 航空貨物・物流サービス | 0.50 |
| | | 旅客航空輸送 | 0.04 |
| | | 海上運輸 | 0.05 |
| | | 陸上運輸 | 1.05 |
| | | 運送インフラ | 0.10 |
| | | 自動車用部品 | 0.16 |
| | | 自動車 | 1.88 |
| 家庭用耐久財 | 0.30 | | |
| レジャー用品 | 0.01 | | |
| 繊維・アパレル・贅沢品 | 1.22 | | |
| ホテル・レストラン・レジャー | 2.03 | | |

| | | | |
|---------|---|-------------------------|-------|
| | | 販売 | 0.08 |
| | | 大規模小売り | 2.89 |
| | | 専門小売り | 1.55 |
| | | 生活必需品流通・小売り | 1.66 |
| | | 飲料 | 1.57 |
| | | 食品 | 1.44 |
| | | タバコ | 0.56 |
| | | 家庭用品 | 1.06 |
| | | パーソナルケア用品 | 0.60 |
| | | ヘルスケア機器・用品 | 2.16 |
| | | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | 2.13 |
| | | バイオテクノロジー | 1.76 |
| | | 医薬品 | 4.92 |
| | | 銀行 | 5.23 |
| | | 金融サービス | 3.08 |
| | | 保険 | 3.14 |
| | | 情報技術サービス | 1.38 |
| | | ソフトウェア | 8.87 |
| | | 通信機器 | 0.65 |
| | | コンピュータ・周辺機器 | 5.69 |
| | | 電子装置・機器・部品 | 0.49 |
| | | 半導体・半導体製造装置 | 6.28 |
| | | 各種電気通信サービス | 0.97 |
| | | 無線通信サービス | 0.21 |
| | | 電力 | 1.62 |
| | | ガス | 0.09 |
| | | 総合公益事業 | 0.75 |
| | | 水道 | 0.09 |
| | | 消費者金融 | 0.35 |
| | | 資本市場 | 3.12 |
| | | 各種消費者サービス | 0.02 |
| | | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | 0.12 |
| | | ヘルスケア・テクノロジー | 0.04 |
| | | ライフサイエンス・ツール/サービス | 1.15 |
| | | 専門サービス | 1.00 |
| 新株予約権証券 | — | — | 0.00 |
| 投資証券 | — | — | 1.96 |
| 合 計 | | | 98.51 |

(参考) 国内債券マザーファンド

| 順位 | 国／地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価単価(円) | 簿価金額(円) | 評価単価(円) | 評価金額(円) | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|----|------|------|-------------------|-------------|---------|-------------|---------|-------------|-------|------------|---------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(2年)第447回 | 340,000,000 | 100.15 | 340,510,000 | 100.03 | 340,112,200 | 0.005 | 2025/4/1 | 1.78 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(2年)第452回 | 300,000,000 | 99.94 | 299,847,000 | 100.00 | 300,000,000 | 0.005 | 2025/9/1 | 1.57 |
| 3 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第145回 | 270,000,000 | 100.36 | 270,988,200 | 100.17 | 270,461,700 | 0.1 | 2025/9/20 | 1.42 |
| 4 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第340回 | 260,000,000 | 101.07 | 262,795,000 | 100.71 | 261,851,200 | 0.4 | 2025/9/20 | 1.37 |
| 5 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第342回 | 230,000,000 | 100.41 | 230,952,200 | 100.13 | 230,315,100 | 0.1 | 2026/3/20 | 1.21 |
| 6 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第341回 | 200,000,000 | 100.91 | 201,830,000 | 100.56 | 201,128,000 | 0.3 | 2025/12/20 | 1.05 |
| 7 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第343回 | 200,000,000 | 100.42 | 200,840,000 | 100.11 | 200,228,000 | 0.1 | 2026/6/20 | 1.05 |
| 8 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第345回 | 200,000,000 | 100.39 | 200,780,000 | 100.04 | 200,090,000 | 0.1 | 2026/12/20 | 1.05 |
| 9 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第158回 | 200,000,000 | 100.10 | 200,216,500 | 99.59 | 199,190,000 | 0.1 | 2028/3/20 | 1.04 |
| 10 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第351回 | 190,000,000 | 99.87 | 189,754,400 | 99.45 | 188,972,100 | 0.1 | 2028/6/20 | 0.99 |
| 11 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第366回 | 190,000,000 | 98.38 | 186,937,100 | 97.18 | 184,647,700 | 0.2 | 2032/3/20 | 0.97 |
| 12 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第346回 | 180,000,000 | 100.36 | 180,648,000 | 99.98 | 179,969,400 | 0.1 | 2027/3/20 | 0.94 |
| 13 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第347回 | 180,000,000 | 100.28 | 180,504,000 | 99.91 | 179,839,800 | 0.1 | 2027/6/20 | 0.94 |
| 14 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(5年)第149回 | 180,000,000 | 100.10 | 180,180,000 | 99.83 | 179,697,600 | 0.005 | 2026/9/20 | 0.94 |
| 15 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第350回 | 180,000,000 | 99.96 | 179,928,000 | 99.59 | 179,271,000 | 0.1 | 2028/3/20 | 0.94 |
| 16 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第363回 | 180,000,000 | 98.45 | 177,210,000 | 97.16 | 174,888,000 | 0.1 | 2031/6/20 | 0.91 |
| 17 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第364回 | 180,000,000 | 98.00 | 176,402,000 | 96.85 | 174,330,000 | 0.1 | 2031/9/20 | 0.91 |
| 18 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第368回 | 180,000,000 | 98.68 | 177,624,000 | 96.65 | 173,979,000 | 0.2 | 2032/9/20 | 0.91 |
| 19 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第352回 | 170,000,000 | 99.81 | 169,682,100 | 99.28 | 168,789,600 | 0.1 | 2028/9/20 | 0.88 |
| 20 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第370回 | 170,000,000 | 100.87 | 171,479,000 | 98.81 | 167,983,800 | 0.5 | 2033/3/20 | 0.88 |
| 21 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付(10年)第3 | 170,000,000 | 97.56 | 165,856,300 | 97.70 | 166,101,900 | 0.4 | 2033/6/20 | 0.87 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|----|------|---------------------------|-------------|--------|-------------|--------|-------------|-------|------------|------|
| | | | 71回 | | | | | | | | |
| 22 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 62回 | 170,000,000 | 98.63 | 167,671,000 | 97.42 | 165,619,100 | 0.1 | 2031/3/20 | 0.87 |
| 23 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 67回 | 170,000,000 | 98.55 | 167,535,000 | 96.94 | 164,803,100 | 0.2 | 2032/6/20 | 0.86 |
| 24 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 44回 | 160,000,000 | 100.42 | 160,672,000 | 100.09 | 160,155,200 | 0.1 | 2026/9/20 | 0.84 |
| 25 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第14 8回 | 160,000,000 | 100.12 | 160,198,400 | 99.87 | 159,795,200 | 0.005 | 2026/6/20 | 0.83 |
| 26 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 48回 | 160,000,000 | 100.19 | 160,312,000 | 99.82 | 159,726,400 | 0.1 | 2027/9/20 | 0.83 |
| 27 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (5年)第15 0回 | 160,000,000 | 100.05 | 160,086,400 | 99.75 | 159,609,600 | 0.005 | 2026/12/20 | 0.83 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 65回 | 165,000,000 | 98.15 | 161,947,500 | 96.60 | 159,396,600 | 0.1 | 2031/12/20 | 0.83 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 69回 | 160,000,000 | 101.20 | 161,920,000 | 99.01 | 158,420,800 | 0.5 | 2032/12/20 | 0.83 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 国庫債券 利付 (10年)第3 61回 | 160,000,000 | 98.78 | 158,048,000 | 97.67 | 156,278,400 | 0.1 | 2030/12/20 | 0.82 |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 99.49 |
| 合計 | 99.49 |

(参考) 外国債券マザーファンド

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 簿価 単価 (円) | 簿価 金額 (円) | 評価 単価 (円) | 評価 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|----------|------|--------------------------------|------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 86,650,000 | 17,200.27 | 14,904,039,100 | 16,308.10 | 14,130,975,962 | 6.25 | 2030/5/15 | 1.78 |
| 2 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 82,500,000 | 16,599.37 | 13,694,485,334 | 15,741.65 | 12,986,869,096 | 5.375 | 2031/2/15 | 1.63 |
| 3 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 84,200,000 | 15,945.61 | 13,426,205,373 | 15,342.38 | 12,918,290,689 | 5.25 | 2028/11/15 | 1.62 |
| 4 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 87,650,000 | 15,396.58 | 13,495,107,822 | 14,526.60 | 12,732,572,218 | 4.125 | 2032/11/15 | 1.60 |
| 5 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY BOND | 70,850,000 | 15,555.59 | 11,021,138,278 | 15,140.16 | 10,726,808,136 | 6 | 2026/2/15 | 1.35 |
| 6 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 56,600,000 | 18,718.94 | 10,594,924,935 | 18,711.04 | 10,590,452,351 | 4.75 | 2035/4/25 | 1.33 |
| 7 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 57,950,000 | 18,619.02 | 10,789,727,274 | 18,194.10 | 10,543,481,820 | 5.5 | 2029/4/25 | 1.33 |
| 8 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 71,200,000 | 12,830.19 | 9,135,098,539 | 12,927.79 | 9,204,591,566 | 0.5 | 2027/4/30 | 1.16 |
| 9 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 64,600,000 | 13,779.87 | 8,901,802,409 | 13,738.11 | 8,874,823,935 | 2 | 2026/11/15 | 1.11 |
| 10 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 54,000,000 | 16,168.91 | 8,731,216,065 | 16,283.43 | 8,793,056,628 | 3.85 | 2029/12/15 | 1.10 |
| 11 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 66,000,000 | 13,779.40 | 9,094,408,798 | 13,242.33 | 8,739,938,685 | 2.875 | 2032/5/15 | 1.10 |
| 12 | イタリア | 国債証券 | BUONI | 50,850,000 | 15,977.42 | 8,124,522,484 | 16,144.53 | 8,209,498,386 | 3.4 | 2028/4/1 | 1.03 |

| | | | | | | | | | | | | |
|----|------|------|---------------------------|-------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|------|--|
| | | | POLIENNALI DEL TES | | | | | | | | | |
| 13 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 63,100,000 | 13,130.67 | 8,285,455,489 | 12,911.42 | 8,147,108,443 | 1.125 | 2028/2/29 | 1.02 | |
| 14 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 43,850,000 | 18,252.99 | 8,003,936,857 | 18,284.54 | 8,017,773,903 | 5.75 | 2033/2/1 | 1.01 | |
| 15 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 56,500,000 | 14,126.18 | 7,981,295,015 | 14,048.05 | 7,937,152,362 | 2.25 | 2025/11/15 | 1.00 | |
| 16 | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 48,850,000 | 16,151.94 | 7,890,223,481 | 16,218.83 | 7,922,900,507 | 3.6 | 2025/9/29 | 0.99 | |
| 17 | ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 42,550,000 | 18,691.62 | 7,953,284,657 | 18,327.02 | 7,798,148,810 | 6.5 | 2027/7/4 | 0.98 | |
| 18 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 102,200,000 | 8,523.45 | 8,710,970,021 | 7,580.13 | 7,746,899,340 | 1.375 | 2050/8/15 | 0.97 | |
| 19 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 56,850,000 | 13,392.25 | 7,613,497,517 | 13,604.26 | 7,734,022,826 | 0.25 | 2025/8/31 | 0.97 | |
| 20 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 53,000,000 | 14,316.25 | 7,587,616,827 | 14,260.61 | 7,558,128,080 | 3 | 2025/10/31 | 0.95 | |
| 21 | フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 38,150,000 | 19,923.22 | 7,600,709,271 | 19,724.78 | 7,525,003,655 | 5.75 | 2032/10/25 | 0.94 | |
| 22 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 50,000,000 | 15,125.23 | 7,562,615,156 | 14,467.14 | 7,233,574,710 | 4 | 2030/2/28 | 0.91 | |
| 23 | スペイン | 国債証券 | SPANISH GOVERNMENT | 38,500,000 | 18,605.72 | 7,163,204,765 | 18,438.59 | 7,098,859,205 | 6 | 2029/1/31 | 0.89 | |
| 24 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 48,500,000 | 14,407.97 | 6,987,868,266 | 14,270.38 | 6,921,137,180 | 3 | 2025/9/30 | 0.87 | |
| 25 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 49,800,000 | 13,637.46 | 6,791,457,439 | 13,799.01 | 6,871,909,381 | 0.375 | 2025/4/30 | 0.86 | |
| 26 | ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 35,400,000 | 18,938.57 | 6,704,254,855 | 19,395.00 | 6,865,833,223 | 4.25 | 2039/7/4 | 0.86 | |
| 27 | スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 38,850,000 | 17,796.65 | 6,913,999,866 | 17,643.35 | 6,854,442,407 | 5.15 | 2028/10/31 | 0.86 | |
| 28 | ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 34,900,000 | 19,747.84 | 6,891,998,327 | 19,449.68 | 6,787,938,403 | 5.5 | 2031/1/4 | 0.85 | |
| 29 | スペイン | 国債証券 | SPANISH GOVERNMENT | 35,100,000 | 19,191.08 | 6,736,071,891 | 19,140.55 | 6,718,333,086 | 5.75 | 2032/7/30 | 0.84 | |
| 30 | アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B | 48,400,000 | 13,429.78 | 6,500,017,301 | 13,552.84 | 6,559,576,808 | 1.375 | 2026/8/31 | 0.82 | |

種類別及び業種別投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.98 |
| 合計 | 98.98 |

②【投資不動産物件】

バランスセレクト50

該当事項はありません。

(参考) 国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

バランスセレクト50

該当事項はありません。

(参考) 国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類 | 取引所 | 名称 | 買建/ 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------|-------|---------------------|-----------|-----|-----|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数先物 取引 | 大阪取引所 | TOPIX 先物(2023年12月限) | 買建 | 281 | 日本円 | 6,514,142,147 | 6,676,560,000 | 1.09 |

(参考) 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

| 種類 | 国/地 域 | 取引所 | 名称 | 買建/ 売建 | 枚数 | 通貨 | 帳簿価額 | 帳簿価額 (円) | 評価額 | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------------------|-----------------|------------------------------------|---|-----------|-----|------------|---------------|----------------|-------------|----------------|-----------------|
| 株価指 数先物 取引 | アメリカ | シカゴマ ーカント イール取 引所 | E-mini S&P500 株 価指数先物(2023 年12月限) | 買建 | 608 | 米ドル | 132,244,862.5 | 19,449,251,924 | 138,601,200 | 20,384,078,473 | 1.07 |
| | カナダ | モントリ オール取 引所 | S&P TSEX60 株価指 数先物(2023年12 月限) | 買建 | 35 | カナダド ル | 8,204,860 | 887,847,896 | 8,483,300 | 917,977,881 | 0.04 |
| | ドイツ | ユーレック ス・ドイ ツ金融先 物取引所 | ユーロ50 株価指 数先物(2023年12 月限) | 買建 | 369 | ユーロ | 15,430,120 | 2,492,118,681 | 16,158,510 | 2,609,760,944 | 0.13 |
| | オース トラリ ア | シドニー 先物取 引所 | SPI200 株価指数先 物(2023年12月 限) | 買建 | 32 | 豪ドル | 5,556,150 | 541,446,819 | 5,643,200 | 549,929,838 | 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(2023年12月 限) | 買建 | 84 | 英ポンド | 6,226,180 | 1,163,299,465 | 6,252,540 | 1,168,224,563 | 0.06 |
| | 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 (2023年12月限) | 買建 | 42 | スイスフ ラン | 4,441,290 | 748,623,843 | 4,538,940 | 765,083,719 | 0.04 |

(参考) 国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

バランスセレクト50

2023年11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13計算期間 | (2014年5月12日) | 2,013 | 2,019 | 1.2854 | 1.2894 |
| 第14計算期間 | (2015年5月11日) | 2,150 | 2,159 | 1.5149 | 1.5214 |
| 第15計算期間 | (2016年5月10日) | 1,943 | 1,951 | 1.4215 | 1.4270 |
| 第16計算期間 | (2017年5月10日) | 2,102 | 2,111 | 1.5475 | 1.5540 |
| 第17計算期間 | (2018年5月10日) | 2,115 | 2,124 | 1.6345 | 1.6415 |
| 第18計算期間 | (2019年5月10日) | 2,053 | 2,062 | 1.5919 | 1.5989 |
| 第19計算期間 | (2020年5月11日) | 1,958 | 1,967 | 1.5755 | 1.5825 |
| 第20計算期間 | (2021年5月10日) | 2,124 | 2,135 | 1.8650 | 1.8745 |
| 第21計算期間 | (2022年5月10日) | 2,063 | 2,074 | 1.8535 | 1.8635 |
| 第22計算期間 | (2023年5月10日) | 2,148 | 2,160 | 1.9505 | 1.9615 |
| | 2022年11月末日 | 2,088 | — | 1.9057 | — |
| | 12月末日 | 2,010 | — | 1.8358 | — |
| | 2023年1月末日 | 2,051 | — | 1.8724 | — |
| | 2月末日 | 2,087 | — | 1.9016 | — |
| | 3月末日 | 2,107 | — | 1.9220 | — |
| | 4月末日 | 2,145 | — | 1.9508 | — |
| | 5月末日 | 2,177 | — | 1.9819 | — |
| | 6月末日 | 2,264 | — | 2.0669 | — |
| | 7月末日 | 2,251 | — | 2.0635 | — |
| | 8月末日 | 2,261 | — | 2.0715 | — |
| | 9月末日 | 2,226 | — | 2.0546 | — |
| | 10月末日 | 2,168 | — | 2.0075 | — |
| | 11月末日 | 2,153 | — | 2.0955 | — |

② 【分配の推移】

バランスセレクト50

| | 計算期間 | 1口当たりの分配金 |
|---------|-----------------------|-----------|
| 第13計算期間 | 2013年5月11日～2014年5月12日 | 0.0040円 |
| 第14計算期間 | 2014年5月13日～2015年5月11日 | 0.0065円 |
| 第15計算期間 | 2015年5月12日～2016年5月10日 | 0.0055円 |

| | | |
|-----------|---------------------------------|----------|
| 第 16 計算期間 | 2016 年 5 月 11 日～2017 年 5 月 10 日 | 0.0065 円 |
| 第 17 計算期間 | 2017 年 5 月 11 日～2018 年 5 月 10 日 | 0.0070 円 |
| 第 18 計算期間 | 2018 年 5 月 11 日～2019 年 5 月 10 日 | 0.0070 円 |
| 第 19 計算期間 | 2019 年 5 月 11 日～2020 年 5 月 11 日 | 0.0070 円 |
| 第 20 計算期間 | 2020 年 5 月 12 日～2021 年 5 月 10 日 | 0.0095 円 |
| 第 21 計算期間 | 2021 年 5 月 11 日～2022 年 5 月 10 日 | 0.0100 円 |
| 第 22 計算期間 | 2022 年 5 月 11 日～2023 年 5 月 10 日 | 0.0110 円 |

③【収益率の推移】

バランスセレクト 50

| | 計算期間 | 収益率 |
|-------------|----------------------------------|-------|
| 第 13 計算期間 | 2013 年 5 月 11 日～2014 年 5 月 12 日 | 3.7% |
| 第 14 計算期間 | 2014 年 5 月 13 日～2015 年 5 月 11 日 | 18.4% |
| 第 15 計算期間 | 2015 年 5 月 12 日～2016 年 5 月 10 日 | △5.8% |
| 第 16 計算期間 | 2016 年 5 月 11 日～2017 年 5 月 10 日 | 9.3% |
| 第 17 計算期間 | 2017 年 5 月 11 日～2018 年 5 月 10 日 | 6.1% |
| 第 18 計算期間 | 2018 年 5 月 11 日～2019 年 5 月 10 日 | △2.2% |
| 第 19 計算期間 | 2019 年 5 月 11 日～2020 年 5 月 11 日 | △0.6% |
| 第 20 計算期間 | 2020 年 5 月 12 日～2021 年 5 月 10 日 | 19.0% |
| 第 21 計算期間 | 2021 年 5 月 11 日～2022 年 5 月 10 日 | △0.1% |
| 第 22 計算期間 | 2022 年 5 月 11 日～2023 年 5 月 10 日 | 5.8% |
| 第 23 期（中間期） | 2023 年 5 月 11 日～2023 年 11 月 10 日 | 5.9% |

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

（4）【設定及び解約の実績】

バランスセレクト 50

| | 計算期間 | 設定口数 | 解約口数 | 発行済み口数 |
|-----------|---------------------------------|-------------|-------------|---------------|
| 第 13 計算期間 | 2013 年 5 月 11 日～2014 年 5 月 12 日 | 106,668,354 | 445,125,657 | 1,566,425,200 |
| 第 14 計算期間 | 2014 年 5 月 13 日～2015 年 5 月 11 日 | 99,510,731 | 246,335,812 | 1,419,600,119 |
| 第 15 計算期間 | 2015 年 5 月 12 日～2016 年 5 月 10 日 | 88,902,453 | 140,992,525 | 1,367,510,047 |
| 第 16 計算期間 | 2016 年 5 月 11 日～2017 年 5 月 10 日 | 103,461,716 | 112,395,216 | 1,358,576,547 |
| 第 17 計算期間 | 2017 年 5 月 11 日～2018 年 5 月 10 日 | 112,652,811 | 177,093,273 | 1,294,136,085 |
| 第 18 計算期間 | 2018 年 5 月 11 日～2019 年 5 月 10 日 | 87,292,570 | 91,570,485 | 1,289,858,170 |
| 第 19 計算期間 | 2019 年 5 月 11 日～2020 年 5 月 11 日 | 92,378,554 | 139,113,276 | 1,243,123,448 |
| 第 20 計算期間 | 2020 年 5 月 12 日～2021 年 5 月 10 日 | 68,567,869 | 172,300,238 | 1,139,391,079 |
| 第 21 計算期間 | 2021 年 5 月 11 日～2022 年 5 月 10 日 | 64,775,985 | 90,780,876 | 1,113,386,188 |
| 第 22 計算期間 | 2022 年 5 月 11 日～2023 年 5 月 10 日 | 59,391,351 | 71,365,181 | 1,101,412,358 |

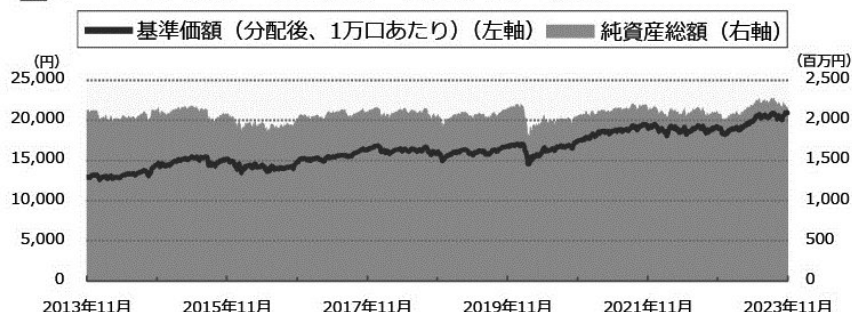
| | | | | |
|-------------|----------------------------------|------------|------------|---------------|
| 第 23 期（中間期） | 2023 年 5 月 11 日～2023 年 11 月 10 日 | 36,074,352 | 72,920,727 | 1,064,565,983 |
|-------------|----------------------------------|------------|------------|---------------|

※本邦外における設定及び解約の実績はありません。



運用実績 (2023年11月30日現在)

■ 基準価額・純資産の推移 (日次)



■ 分配の推移

(1万口あたり、課税前)

| | |
|---------|-------|
| 2023年5月 | 110 円 |
| 2022年5月 | 100 円 |
| 2021年5月 | 95 円 |
| 2020年5月 | 70 円 |
| 2019年5月 | 70 円 |
| 設定来累計 | 995 円 |

■ 主要な資産の状況

銘柄別投資比率 (上位)

| 順位 | 銘柄 | 投資比率 (%) |
|----|-------------------------|----------|
| 1 | 国内債券マザーファンド | 40.2 |
| 2 | 国内株式マザーファンド | 29.9 |
| 3 | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 19.8 |
| 4 | 外国債券マザーファンド | 10.0 |

実質的な銘柄別投資比率 (上位)

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|-------------------|--------|----------|
| 1 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 1.3 |
| 2 | ソニーグループ | 電気機器 | 0.8 |
| 3 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 0.7 |
| 4 | キーエンス | 電気機器 | 0.6 |
| 5 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 0.5 |

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 業種 | 投資比率 (%) |
|----|-------------------|----------------------|----------|
| 1 | APPLE INC | コンピュータ・周辺機器 | 1.1 |
| 2 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア | 1.0 |
| 3 | AMAZON.COM INC | 大規模小売り | 0.5 |
| 4 | NVIDIA CORP | 半導体・半導体製造装置 | 0.4 |
| 5 | ALPHABET INC-CL A | インタラクティブ・メディアおよびサービス | 0.3 |

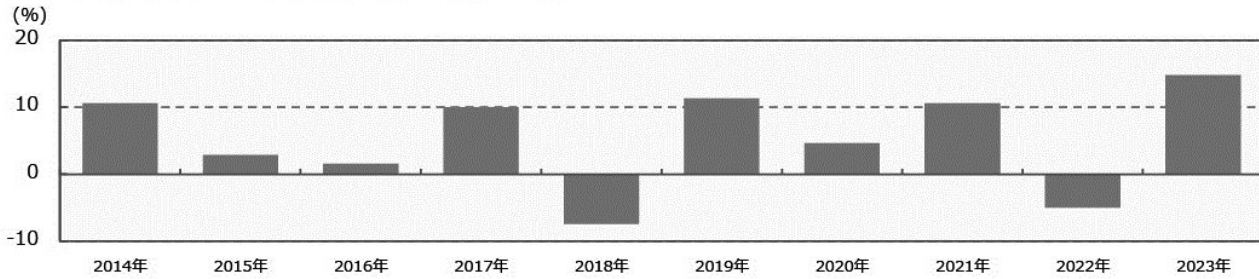
・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|---------------------|------|----------|
| 1 | 国庫債券 利付 (2年) 第447回 | 国債証券 | 0.7 |
| 2 | 国庫債券 利付 (2年) 第452回 | 国債証券 | 0.6 |
| 3 | 国庫債券 利付 (5年) 第145回 | 国債証券 | 0.6 |
| 4 | 国庫債券 利付 (10年) 第340回 | 国債証券 | 0.6 |
| 5 | 国庫債券 利付 (10年) 第342回 | 国債証券 | 0.5 |

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

| 順位 | 銘柄 | 種類 | 投資比率 (%) |
|----|------------------|------|----------|
| 1 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.2 |
| 2 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.2 |
| 3 | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.2 |
| 4 | US TREASURY N/B | 国債証券 | 0.2 |
| 5 | US TREASURY BOND | 国債証券 | 0.1 |

■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2023年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

(1) 受益権の募集

申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。

(2) 申込締切時間

午後 3 時まで取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受け付けにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

(3) 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販売会社に支払うものとします。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。

(7) 積立方式

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

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

(8) 申込受け付けの中止および取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があります。取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、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の受け付けを中止すること、および既に受け付けた取得申込みの受け付けを取り消す場合があります。

(9) 申込手続等に関する照会先

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

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

2 【換金（解約）手続等】

(1) 解約の請求

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

(2) 解約請求の締切時間

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

(3) 換金単位

「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

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

(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できません。また、大口解約について、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換金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、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、および既に受け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を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

| 対象 | 評価方法 |
|-------|--|
| 株式 | 原則として、基準価額計算日 ^{※1} の金融商品取引所の最終相場で評価します。 |
| 公社債等 | 原則として、基準価額計算日 ^{※1} における以下のいずれかの価額で評価します。 ^{※2} ①日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) ②金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) ③価格情報会社の提供する価額 |
| 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(2001年5月11日設定)。

(4) 【計算期間】

原則として毎年5月11日から翌年5月10日までとします。

ただし、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。

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託終了日前に、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させる場合があります。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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(ii) 上記(i)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

(iii) 上記(ii)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。

(iv) 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(v) 上記(ii)から(iv)までの規定は、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(ii)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。

(vi) 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。

(vii) 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(iv)」に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。

(viii) 受託者が委託者の承諾を受けてその任務を辞任する場合、または、委託者または受益者が裁判所に受託者の解任を請求し裁判所が受託者を解任した場合、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。

(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、知られたる受益者に対して交付し

ます。

(d) 信託約款の変更

- (i) 委託者は、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。
- (ii) 委託者は、上記(i)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (iii) 上記(ii)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (iv) 上記(iii)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるとときは、上記(i)の信託約款の変更をしません。
- (v) 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (vi) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記(i)から(v)までの規定にしたがいます。

(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) 反対者の買取請求権

ファンドの信託契約の解約または信託約款の変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手続に関する事項は、前述の「(b)信託期間の終了」(i)または「(d)信託約款の変更」(ii)に規定する公告または書面に付記します。

(g) 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て）に、原則として決算日

から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取り下さい。

なお、時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。

<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ます。）に、原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

■償還金請求権の失効■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

③ 換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間(2022年5月11日から2023年5月10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。

独立監査人の監査報告書

2023年7月11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

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」に掲げられているバランスセレクト50の2022年5月11日から2023年5月10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、バランスセレクト50の2023年5月10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、ファンデ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。

1 【財務諸表】

【バランスセレクト50】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第 21 期 (2022 年 5 月 10 日現在) | 第 22 期 (2023 年 5 月 10 日現在) |
|------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 15,024,280 | 9,443,830 |
| 親投資信託受益証券 | 2,061,038,517 | 2,145,480,564 |
| 未収入金 | 8,135,957 | 14,835,436 |
| 流動資産合計 | 2,084,198,754 | 2,169,759,830 |
| 資産合計 | 2,084,198,754 | 2,169,759,830 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 11,133,861 | 12,115,535 |
| 未払解約金 | 1,882,784 | 1,919,216 |
| 未払受託者報酬 | 579,450 | 567,581 |
| 未払委託者報酬 | 6,953,299 | 6,810,879 |
| 未払利息 | 5 | 15 |
| その他未払費用 | 34,702 | 33,994 |
| 流動負債合計 | 20,584,101 | 21,447,220 |
| 負債合計 | 20,584,101 | 21,447,220 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,113,386,188 | 1,101,412,358 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | 950,228,465 | 1,046,900,252 |
| (分配準備積立金) | 669,582,056 | 711,226,147 |
| 元本等合計 | 2,063,614,653 | 2,148,312,610 |
| 純資産合計 | 2,063,614,653 | 2,148,312,610 |
| 負債純資産合計 | 2,084,198,754 | 2,169,759,830 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第 21 期 自 2021 年 5 月 11 日 至 2022 年 5 月 10 日 | 第 22 期 自 2022 年 5 月 11 日 至 2023 年 5 月 10 日 |
|-----------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 14,883,020 | 134,583,685 |
| 営業収益合計 | 14,883,020 | 134,583,685 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 1,209 | 1,597 |
| 受託者報酬 | 1,177,219 | 1,151,385 |
| 委託者報酬 | 14,126,479 | 13,816,447 |

| | | |
|---|-------------|---------------|
| その他費用 | 70,506 | 68,960 |
| 営業費用合計 | 15,375,413 | 15,038,389 |
| 営業利益又は営業損失(△) | △492,393 | 119,545,296 |
| 経常利益又は経常損失(△) | △492,393 | 119,545,296 |
| 当期純利益又は当期純損失(△) | △492,393 | 119,545,296 |
| 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(△) | 3,559,138 | 2,772,192 |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△) | 985,529,302 | 950,228,465 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 58,007,472 | 52,602,257 |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 58,007,472 | 52,602,257 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 78,122,917 | 60,588,039 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 78,122,917 | 60,588,039 |
| 分配金 | 11,133,861 | 12,115,535 |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 950,228,465 | 1,046,900,252 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|--|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4. その他 | 当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2022年5月11日から2023年5月10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21期 2022年5月10日現在 | 第22期 2023年5月10日現在 |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,113,386,188口 | 1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,101,412,358口 |
| 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.8535円 (10,000口当たり純資産額) (18,535円) | 2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.9505円 (10,000口当たり純資産額) (19,505円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第21期 自2021年5月11日 至2022年5月10日 | 第22期 自2022年5月11日 至2023年5月10日 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|------------------------------------|----------------|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|----|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|-------------------|--------------|---------|---|----|--|--|--------------|---|-------------|---------------------------|---|-------------|--------|---|--------------|----------|---|--------------|---------------|-----------|----------------|--------------|---|----------------|-------------------|--------------|---------|
| 1. 分配金の計算過程 | 1. 分配金の計算過程 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>19,006,034円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>512,853,750円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>661,709,883円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,193,569,667円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,113,386,188口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>10,720円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 19,006,034円 | 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | 収益調整金額 | C | 512,853,750円 | 分配準備積立金額 | D | 661,709,883円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,193,569,667円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,113,386,188口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 10,720円 | <table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>34,509,337円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>60,644,089円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>542,080,398円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>628,188,256円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,265,422,080円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,101,412,358口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>11,489円</td> </tr> </tbody> </table> | 項目 | | | 費用控除後の配当等収益額 | A | 34,509,337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 | 60,644,089円 | 収益調整金額 | C | 542,080,398円 | 分配準備積立金額 | D | 628,188,256円 | 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,265,422,080円 | 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,101,412,358口 | 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 11,489円 |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 19,006,034円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | B | 0円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 512,853,750円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 661,709,883円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,193,569,667円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,113,386,188口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 10,720円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項目 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 費用控除後の配当等収益額 | A | 34,509,337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 | 60,644,089円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 収益調整金額 | C | 542,080,398円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 分配準備積立金額 | D | 628,188,256円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの分配対象収益額 | E=A+B+C+D | 1,265,422,080円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 当ファンドの期末残存口数 | F | 1,101,412,358口 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 10,000口当たり収益分配対象額 | G=E/F×10,000 | 11,489円 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | | |
|----------------|-------------------------|-------------|
| 10,000口当たり分配金額 | H | 100円 |
| 収益分配金金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 11,133,861円 |

| | | |
|----------------|-------------------------|-------------|
| 10,000口当たり分配金額 | H | 110円 |
| 収益分配金金額 | $I=F \times H / 10,000$ | 12,115,535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 21 期 自 2021 年 5 月 11 日 至 2022 年 5 月 10 日 | 第 22 期 自 2022 年 5 月 11 日 至 2023 年 5 月 10 日 |
|---|--|
| <p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p> | <p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制 同左</p> |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 第 21 期 2022 年 5 月 10 日現在 | 第 22 期 2023 年 5 月 10 日現在 |
|---|---|
| <p>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。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p> |

(関連当事者との取引に関する注記)

| 第 21 期 自 2021 年 5 月 11 日 至 2022 年 5 月 10 日 | 第 22 期 自 2022 年 5 月 11 日 至 2023 年 5 月 10 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21期 自 2021年 5月 11日 至 2022年 5月 10日 | | 第22期 自 2022年 5月 11日 至 2023年 5月 10日 | |
|--|-----------------|--|-----------------|
| 期首元本額 | 1,139,391,079 円 | 期首元本額 | 1,113,386,188 円 |
| 期中追加設定元本額 | 64,775,985 円 | 期中追加設定元本額 | 59,391,351 円 |
| 期中一部解約元本額 | 90,780,876 円 | 期中一部解約元本額 | 71,365,181 円 |

2 有価証券関係

売買目的有価証券

| 種類 | 第21期 自 2021年 5月 11日 至 2022年 5月 10日 | 第22期 自 2022年 5月 11日 至 2023年 5月 10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 | 4,876,356 | 124,586,625 |
| 合計 | 4,876,356 | 124,586,625 |

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(2023年5月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2023年5月10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 | 281,739,399 | 646,451,051 | |
| | | 国内債券マザーファンド | 649,364,912 | 857,811,048 | |
| | | 外国債券マザーファンド | 82,230,109 | 213,296,679 | |
| | | 外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド | 88,015,341 | 427,921,786 | |
| | 小計 | | 銘柄数: 4 組入時価比率: 99.9% | 1,101,349,761 | 2,145,480,564 100.0% |
| 合計 | | | | 2,145,480,564 | |

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド」、「国内債券マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」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)

(2023年5月10日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 27,587,283,429 |
| 株式 | 501,080,719,500 |
| 派生商品評価勘定 | 507,603,275 |
| 未収入金 | 36,769,845 |
| 未収配当金 | 5,657,517,494 |
| 未収利息 | 459,840 |
| その他未収収益 | 116,768,104 |
| 流動資産合計 | 534,987,121,487 |
| 資産合計 | 534,987,121,487 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 前受金 | 187,133,400 |
| 未払解約金 | 931,736,047 |
| 未払利息 | 45,220 |
| 有価証券貸借取引受入金 | 22,413,934,996 |
| 流動負債合計 | 23,532,849,663 |
| 負債合計 | 23,532,849,663 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 222,905,745,135 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 288,548,526,689 |
| 元本等合計 | 511,454,271,824 |
| 純資産合計 | 511,454,271,824 |
| 負債純資産合計 | 534,987,121,487 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

| | |
|------------------------|--|
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 |
| | 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 |
| | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。 |

(重要な会計上の見積りに関する注記)
該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

| 2023年5月10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 | 2,2945円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (22,945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 | 21,376,014,220円 |

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

| 自 2022年5月11日 至 2023年5月10日 | |
|------------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。 |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 2023年5月10日現在 | |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | 株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年5月10日現在 | | |
|------------------------------------|--|------------------|
| 期首 | | 2022年5月11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 | | 208,940,390,653円 |
| 同期中における追加設定元本額 | | 37,638,674,028円 |
| 同期中における一部解約元本額 | | 23,673,319,546円 |
| 期末元本額 | | 222,905,745,135円 |
| 期末元本額の内訳* | | |
| バランスセレクト30 | | 120,991,056円 |
| バランスセレクト50 | | 281,739,399円 |
| バランスセレクト70 | | 427,607,350円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | | 2,017,742,362円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | | 2,625,616,529円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | | 9,204,623,811円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | | 31,798,424円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | | 34,732,409円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | | 57,652,602円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | | 91,508,820円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | | 87,522,392円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | | 153,436,118円 |
| 野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け) | | 11,946,233,079円 |
| のむラップ・ファンド(保守型) | | 2,254,835,897円 |
| のむラップ・ファンド(普通型) | | 15,781,133,191円 |
| のむラップ・ファンド(積極型) | | 6,255,535,188円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | | 34,344,011円 |
| 野村インデックスファンド・TOPIX | | 1,957,538,815円 |
| マイ・ロード | | 2,829,573,923円 |
| ネクストコア | | 26,927,291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 | | 1,383,036,417円 |
| 野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け) | | 2,809,573,687円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | | 1,357,410,452円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | | 38,370,152円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | | 9,862,735円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | | 6,253,303円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | | 4,988,908円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | | 4,604,470円 |
| のむラップ・ファンド(やや保守型) | | 399,306,162円 |
| のむラップ・ファンド(やや積極型) | | 943,298,752円 |
| インデックス・ブレンド(タイプI) | | 3,830,579円 |
| インデックス・ブレンド(タイプII) | | 3,729,699円 |
| インデックス・ブレンド(タイプIII) | | 23,195,645円 |
| インデックス・ブレンド(タイプIV) | | 8,415,737円 |
| インデックス・ブレンド(タイプV) | | 33,029,855円 |
| 野村6資産均等バランス | | 3,784,631,433円 |
| 世界6資産分散ファンド | | 84,051,863円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | | 30,605,496円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式 | | 3,341,627,348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) | | 221,915,270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) | | 122,466,706円 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | | 307,593,001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) | | 163,062,860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) | | 1,514,067円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | | 7,023,782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) | | 204,786円 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | | 1,738,904,519円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用) | | 2,758,012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) | 23,695,963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) | 45,066,990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) | 10,801,665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) | 79,882,246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) | 148,903,157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) | 3,717,211,928円 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 34,548,556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) | 205,476,240円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX (適格機関投資家専用) | 4,195,442,043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) | 41,038,314円 |
| 野村国内外マルチアセット (6資産) オープン投信 (適格機関投資家専用) | 159,159,689円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 2,113,076円 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 5,716,255円 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | 27,278,961円 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 32,187,313円 |
| 国内債券・株式バランスファンド (確定拠出年金向け) | 109,558,932円 |
| マイバランス30 (確定拠出年金向け) | 8,434,684,434円 |
| マイバランス50 (確定拠出年金向け) | 24,728,931,797円 |
| マイバランス70 (確定拠出年金向け) | 29,985,916,378円 |
| 野村国内株式インデックスファンド・TOPIX (確定拠出年金向け) | 37,737,288,450円 |
| マイバランスDC30 | 3,573,290,711円 |
| マイバランスDC50 | 6,334,251,424円 |
| マイバランスDC70 | 7,145,649,481円 |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX | 12,485,167,495円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 1,020,379,451円 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 78,316,747円 |
| マイターゲット2050 (確定拠出年金向け) | 1,892,565,281円 |
| マイターゲット2030 (確定拠出年金向け) | 1,934,980,474円 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け) | 1,577,218,615円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 14,606,375円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 7,004,334円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 119,541,876円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030 | 41,796,961円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 40,672,344円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 30,201,930円 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け) | 1,055,939,989円 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け) | 789,912,179円 |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け) | 565,874,690円 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け) | 720,623,750円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 23,505,191円 |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け) | 256,695,328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) | 169,512,046円 |
| みらいバランス・株式10 (富士通企業年金基金DC向け) | 190,209,258円 |
| 野村DCバランスファンド (年金運用戦略タイプ) | 56,568,455円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2023年5月10日現在)

(単位:円)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | 備考 |
|----|----|----|-----|-----|----|
|----|----|----|-----|-----|----|

| | | | | 単価 | 金額 | |
|---------------|---------|-------------------|-------------|----------|---------------|---------------------------|
| 株式 | 日本円 | 極洋 | 8,900 | 3,565.00 | 31,728,500 | |
| | | ニッセイ | 235,500 | 596.00 | 140,358,000 | |
| | | マルハニチロ | 34,900 | 2,581.00 | 90,076,900 | |
| | | 雪国まいたけ | 20,100 | 1,038.00 | 20,863,800 | 貸付有価証券 700株 |
| | | カネコ種苗 | 7,200 | 1,613.00 | 11,613,600 | |
| | | サカタのタネ | 26,800 | 4,005.00 | 107,334,000 | 貸付有価証券 200株 |
| | | ホクト | 21,000 | 1,861.00 | 39,081,000 | |
| | | ホクリョウ | 2,600 | 775.00 | 2,015,000 | 貸付有価証券 1,000株 (600株) |
| | | 住石ホールディングス | 28,500 | 335.00 | 9,547,500 | 貸付有価証券 14,400株 |
| | | 日鉄鉱業 | 9,400 | 3,850.00 | 36,190,000 | 貸付有価証券 400株 |
| | | 三井松島ホールディングス | 10,700 | 3,140.00 | 33,598,000 | 貸付有価証券 5,000株 (1,800株) |
| | | I N P E X | 870,900 | 1,458.00 | 1,269,772,200 | 貸付有価証券 209,800株 |
| | | 石油資源開発 | 27,300 | 4,525.00 | 123,532,500 | 貸付有価証券 1,000株 |
| | | K&Oエナジーグループ | 10,700 | 2,337.00 | 25,005,900 | 貸付有価証券 400株 (400株) |
| | | ショーボンドホールディングス | 32,100 | 5,820.00 | 186,822,000 | |
| | | ミライト・ワン | 77,900 | 1,701.00 | 132,507,900 | |
| | | タマホーム | 14,800 | 3,890.00 | 57,572,000 | 貸付有価証券 6,900株 (100株) |
| | | サンヨーホームズ | 2,200 | 718.00 | 1,579,600 | 貸付有価証券 600株 (600株) |
| | | 日本アクア | 7,600 | 902.00 | 6,855,200 | 貸付有価証券 100株 |
| | | ファーストコーポレーション | 4,700 | 947.00 | 4,450,900 | |
| | | ベステラ | 4,000 | 934.00 | 3,736,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| | | R o b o t H o m e | 40,100 | 233.00 | 9,343,300 | |
| | | キャンディル | 3,300 | 580.00 | 1,914,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| ダイセキ環境ソリューション | 3,700 | 928.00 | 3,433,600 | | | |
| 第一カッター興業 | 6,000 | 1,266.00 | 7,596,000 | | | |
| 安藤・間 | 136,400 | 926.00 | 126,306,400 | | | |
| 東急建設 | 67,100 | 744.00 | 49,922,400 | | | |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|-----------------------|
| コムシスホールディングス | 79,700 | 2,646.00 | 210,886,200 | 貸付有価証券 1,800株 |
| ビーアールホールディングス | 37,400 | 387.00 | 14,473,800 | |
| 高松コンストラクショングループ | 15,300 | 2,233.00 | 34,164,900 | |
| 東建コーポレーション | 6,800 | 7,770.00 | 52,836,000 | |
| ソネック | 2,000 | 977.00 | 1,954,000 | |
| ヤマウラ | 11,900 | 1,220.00 | 14,518,000 | |
| オリエンタル白石 | 84,600 | 333.00 | 28,171,800 | 貸付有価証券 300株 |
| 大成建設 | 154,100 | 4,780.00 | 736,598,000 | |
| 大林組 | 589,100 | 1,172.00 | 690,425,200 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 清水建設 | 495,200 | 845.00 | 418,444,000 | 貸付有価証券 23,600株 |
| 飛島建設 | 18,200 | 1,163.00 | 21,166,600 | |
| 長谷工コーポレーション | 170,000 | 1,675.00 | 284,750,000 | |
| 松井建設 | 15,400 | 729.00 | 11,226,600 | |
| 銭高組 | 1,600 | 3,655.00 | 5,848,000 | 貸付有価証券 400株 (400株) |
| 鹿島建設 | 365,200 | 1,855.00 | 677,446,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 不動テトラ | 11,400 | 1,826.00 | 20,816,400 | |
| 大末建設 | 4,700 | 1,246.00 | 5,856,200 | 貸付有価証券 200株 |
| 鉄建建設 | 11,800 | 2,023.00 | 23,871,400 | 貸付有価証券 500株 |
| 西松建設 | 27,900 | 3,635.00 | 101,416,500 | 貸付有価証券 900株 |
| 三井住友建設 | 132,800 | 393.00 | 52,190,400 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 大豊建設 | 6,800 | 3,990.00 | 27,132,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 佐田建設 | 8,200 | 494.00 | 4,050,800 | |
| ナカノフドー建設 | 9,100 | 419.00 | 3,812,900 | 貸付有価証券 600株 (600株) |
| 奥村組 | 26,700 | 3,525.00 | 94,117,500 | |
| 東鉄工業 | 22,700 | 2,778.00 | 63,060,600 | |
| イチケン | 2,900 | 1,948.00 | 5,649,200 | |
| 富士ピー・エス | 5,700 | 444.00 | 2,530,800 | |
| 浅沼組 | 13,200 | 3,180.00 | 41,976,000 | |
| 戸田建設 | 202,700 | 830.00 | 168,241,000 | |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|---------------|----------------------|
| 熊谷組 | 27,600 | 2,953.00 | 81,502,800 | |
| 北野建設 | 2,400 | 3,270.00 | 7,848,000 | |
| 植木組 | 3,600 | 1,344.00 | 4,838,400 | |
| 矢作建設工業 | 22,400 | 1,014.00 | 22,713,600 | |
| ピーエス三菱 | 20,900 | 689.00 | 14,400,100 | |
| 日本ハウスホールディングス | 32,700 | 393.00 | 12,851,100 | 貸付有価証券 600株 |
| 新日本建設 | 23,100 | 1,064.00 | 24,578,400 | |
| 東亜道路工業 | 6,600 | 4,615.00 | 30,459,000 | 貸付有価証券 300株(100株) |
| 日本道路 | 3,300 | 8,140.00 | 26,862,000 | |
| 東亜建設工業 | 14,100 | 3,020.00 | 42,582,000 | |
| 日本国土開発 | 49,400 | 624.00 | 30,825,600 | |
| 若築建設 | 7,300 | 4,555.00 | 33,251,500 | |
| 東洋建設 | 53,300 | 976.00 | 52,020,800 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 五洋建設 | 233,500 | 681.00 | 159,013,500 | |
| 世紀東急工業 | 21,200 | 1,260.00 | 26,712,000 | |
| 福田組 | 6,200 | 4,865.00 | 30,163,000 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 住友林業 | 126,400 | 2,965.00 | 374,776,000 | 貸付有価証券 28,700株 |
| 日本基礎技術 | 7,700 | 544.00 | 4,188,800 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 巴コーポレーション | 14,300 | 478.00 | 6,835,400 | |
| 大和ハウス工業 | 460,300 | 3,483.00 | 1,603,224,900 | |
| ライト工業 | 30,500 | 2,020.00 | 61,610,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 積水ハウス | 516,000 | 2,846.00 | 1,468,536,000 | 貸付有価証券 125,500株 |
| 日特建設 | 15,700 | 1,023.00 | 16,061,100 | |
| 北陸電気工事 | 11,300 | 888.00 | 10,034,400 | |
| ユアテック | 36,300 | 839.00 | 30,455,700 | |
| 日本リーテック | 14,500 | 1,387.00 | 20,111,500 | |
| 四電工 | 6,900 | 1,956.00 | 13,496,400 | |
| 中電工 | 25,600 | 2,253.00 | 57,676,800 | |
| 関電工 | 90,300 | 1,074.00 | 96,982,200 | |
| きんでん | 116,000 | 1,866.00 | 216,456,000 | |
| 東京エネシス | 16,400 | 943.00 | 15,465,200 | |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|------------------|
| トーエネック | 5,500 | 3,645.00 | 20,047,500 | |
| 住友電設 | 15,700 | 2,891.00 | 45,388,700 | |
| 日本電設工業 | 27,100 | 2,002.00 | 54,254,200 | |
| エクシオグループ | 75,900 | 2,563.00 | 194,531,700 | 貸付有価証券 4,000株 |
| 新日本空調 | 9,200 | 1,984.00 | 18,252,800 | |
| 九電工 | 40,100 | 3,585.00 | 143,758,500 | 貸付有価証券 100株 |
| 三機工業 | 36,500 | 1,530.00 | 55,845,000 | |
| 日揮ホールディングス | 162,900 | 1,675.00 | 272,857,500 | 貸付有価証券 4,500株 |
| 中外炉工業 | 5,400 | 1,857.00 | 10,027,800 | |
| ヤマト | 10,700 | 992.00 | 10,614,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 太平電業 | 10,200 | 4,270.00 | 43,554,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 高砂熱学工業 | 39,700 | 2,410.00 | 95,677,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 三晃金属工業 | 1,600 | 3,965.00 | 6,344,000 | |
| 朝日工業社 | 6,800 | 2,560.00 | 17,408,000 | |
| 明星工業 | 28,300 | 908.00 | 25,696,400 | |
| 大気社 | 19,000 | 3,800.00 | 72,200,000 | |
| ダイダン | 10,800 | 2,523.00 | 27,248,400 | |
| 日比谷総合設備 | 14,100 | 2,286.00 | 32,232,600 | |
| フィル・カンパニー | 2,900 | 870.00 | 2,523,000 | |
| テスホールディングス | 17,800 | 1,198.00 | 21,324,400 | |
| インフロニア・ホールディングス | 172,600 | 1,192.00 | 205,739,200 | |
| レイズネクスト | 23,800 | 1,461.00 | 34,771,800 | 貸付有価証券 300株 |
| ニッポン | 44,600 | 1,781.00 | 79,432,600 | |
| 日清製粉グループ本社 | 152,900 | 1,652.00 | 252,590,800 | |
| 日東富士製粉 | 2,900 | 4,635.00 | 13,441,500 | |
| 昭和産業 | 14,400 | 2,655.00 | 38,232,000 | |
| 鳥越製粉 | 10,300 | 630.00 | 6,489,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 中部飼料 | 22,900 | 1,093.00 | 25,029,700 | |
| フィード・ワン | 24,200 | 759.00 | 18,367,800 | |
| 東洋精糖 | 2,400 | 943.00 | 2,263,200 | |
| 日本甜菜製糖 | 9,600 | 1,700.00 | 16,320,000 | |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|-------------------------|
| DM三井製糖ホールディングス | 16,400 | 2,302.00 | 37,752,800 | |
| 塩水港精糖 | 15,400 | 202.00 | 3,110,800 | |
| ウェルネオシュガー | 8,500 | 1,755.00 | 14,917,500 | |
| 森永製菓 | 30,200 | 4,060.00 | 122,612,000 | |
| 中村屋 | 4,100 | 3,150.00 | 12,915,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 江崎グリコ | 47,300 | 3,600.00 | 170,280,000 | 貸付有価証券 17,200株 |
| 名糖産業 | 6,500 | 1,747.00 | 11,355,500 | |
| 井村屋グループ | 9,000 | 2,322.00 | 20,898,000 | |
| 不二家 | 11,300 | 2,499.00 | 28,238,700 | 貸付有価証券 3,900株 |
| 山崎製パン | 110,700 | 1,962.00 | 217,193,400 | 貸付有価証券 49,700株 |
| 第一屋製パン | 2,400 | 402.00 | 964,800 | |
| モロゾフ | 5,300 | 3,735.00 | 19,795,500 | |
| 亀田製菓 | 10,500 | 4,400.00 | 46,200,000 | |
| 寿スピリッツ | 17,600 | 9,720.00 | 171,072,000 | 貸付有価証券 100株 |
| カルビー | 75,700 | 2,802.00 | 212,111,400 | |
| 森永乳業 | 30,100 | 5,120.00 | 154,112,000 | |
| 六甲バター | 12,100 | 1,419.00 | 17,169,900 | 貸付有価証券 1,700株 |
| ヤクルト本社 | 118,200 | 10,100.00 | 1,193,820,000 | |
| 明治ホールディングス | 205,000 | 3,325.00 | 681,625,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 雪印メグミルク | 40,000 | 1,993.00 | 79,720,000 | |
| プリマハム | 22,200 | 2,273.00 | 50,460,600 | 貸付有価証券 100株 |
| 日本ハム | 64,700 | 3,945.00 | 255,241,500 | 貸付有価証券 300株 |
| 林兼産業 | 3,900 | 483.00 | 1,883,700 | |
| 丸大食品 | 16,600 | 1,521.00 | 25,248,600 | 貸付有価証券 1,200株 |
| S F o o d s | 18,200 | 3,075.00 | 55,965,000 | |
| 柿安本店 | 6,400 | 2,246.00 | 14,374,400 | 貸付有価証券 3,000株 (200株) |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | 126,300 | 735.00 | 92,830,500 | 貸付有価証券 100株 |
| サッポロホールディングス | 54,400 | 3,760.00 | 204,544,000 | 貸付有価証券 200株 |
| アサヒグループホールデ | 382,100 | 5,237.00 | 2,001,057,700 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|------------------------------|---------|----------|---------------|-------------------------|
| インクス | | | | 48,600株 (3,900株) |
| キリンホールディングス | 746,300 | 2,115.50 | 1,578,797,650 | 貸付有価証券 148,800株 |
| 宝ホールディングス | 112,900 | 1,048.00 | 118,319,200 | 貸付有価証券 2,100株 |
| オエノンホールディングス | 49,400 | 289.00 | 14,276,600 | |
| 養命酒製造 | 5,400 | 1,900.00 | 10,260,000 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス | 129,600 | 1,494.00 | 193,622,400 | 貸付有価証券 50,900株 |
| サントリー食品インター ナショナル | 116,400 | 5,040.00 | 586,656,000 | |
| ダイドーグループホール ディングス | 9,400 | 5,060.00 | 47,564,000 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 伊藤園 | 56,000 | 4,060.00 | 227,360,000 | |
| キーコーヒー | 18,500 | 2,095.00 | 38,757,500 | |
| ユニカフェ | 4,300 | 911.00 | 3,917,300 | 貸付有価証券 1,200株 (100株) |
| ジャパンフーズ | 2,000 | 1,120.00 | 2,240,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 日清オイリオグループ | 23,300 | 3,390.00 | 78,987,000 | |
| 不二製油グループ本社 | 38,500 | 2,092.00 | 80,542,000 | |
| かどや製油 | 1,500 | 3,580.00 | 5,370,000 | |
| J-オイルミルズ | 16,800 | 1,609.00 | 27,031,200 | |
| キッコーマン | 109,600 | 7,790.00 | 853,784,000 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 味の素 | 399,300 | 4,814.00 | 1,922,230,200 | 貸付有価証券 10,200株 |
| ブルドックソース | 8,800 | 2,052.00 | 18,057,600 | |
| キューピー | 88,900 | 2,295.00 | 204,025,500 | 貸付有価証券 2,200株 |
| ハウス食品グループ本社 | 50,600 | 3,010.00 | 152,306,000 | |
| カゴメ | 77,100 | 3,415.00 | 263,296,500 | 貸付有価証券 9,600株 |
| 焼津水産化学工業 | 5,000 | 855.00 | 4,275,000 | 貸付有価証券 500株 (500株) |
| アリアケジャパン | 14,400 | 5,460.00 | 78,624,000 | |
| ピエトロ | 1,900 | 1,819.00 | 3,456,100 | 貸付有価証券 100株 |
| エバラ食品工業 | 4,400 | 3,030.00 | 13,332,000 | |
| やまみ | 1,200 | 1,410.00 | 1,692,000 | |
| ニチレイ | 75,800 | 3,010.00 | 228,158,000 | 貸付有価証券 3,800株 |

| | | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|---------------------------|
| 東洋水産 | 83,600 | 6,050.00 | 505,780,000 | |
| イトアンドホールディングス | 7,000 | 2,256.00 | 15,792,000 | |
| 大冷 | 1,600 | 1,941.00 | 3,105,600 | |
| ヨシムラ・フード・ホールディングス | 10,500 | 957.00 | 10,048,500 | |
| 日清食品ホールディングス | 58,100 | 12,390.00 | 719,859,000 | |
| 永谷園ホールディングス | 8,100 | 2,160.00 | 17,496,000 | |
| 一正蒲鉾 | 5,500 | 793.00 | 4,361,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| フジッコ | 17,000 | 1,925.00 | 32,725,000 | |
| ロック・フィールド | 18,500 | 1,505.00 | 27,842,500 | 貸付有価証券 400株 |
| 日本たばこ産業 | 1,088,700 | 2,985.50 | 3,250,313,850 | 貸付有価証券 177,500株 |
| ケンコーマヨネーズ | 11,400 | 1,255.00 | 14,307,000 | 貸付有価証券 100株 |
| わらべや日洋ホールディングス | 12,200 | 2,345.00 | 28,609,000 | |
| なとり | 10,400 | 1,963.00 | 20,415,200 | |
| イフジ産業 | 2,200 | 1,067.00 | 2,347,400 | |
| ファーマフーズ | 23,700 | 1,763.00 | 41,783,100 | 貸付有価証券 7,900株 (1,900株) |
| ユーグレナ | 106,900 | 891.00 | 95,247,900 | 貸付有価証券 21,600株 (100株) |
| 紀文食品 | 12,900 | 1,108.00 | 14,293,200 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| ピクルスホールディングス | 9,700 | 1,169.00 | 11,339,300 | |
| ミヨシ油脂 | 4,500 | 1,001.00 | 4,504,500 | |
| 理研ビタミン | 14,300 | 2,017.00 | 28,843,100 | |
| 片倉工業 | 15,500 | 1,795.00 | 27,822,500 | |
| グンゼ | 11,900 | 4,640.00 | 55,216,000 | |
| 東洋紡 | 72,700 | 1,052.00 | 76,480,400 | |
| ユニチカ | 50,800 | 213.00 | 10,820,400 | 貸付有価証券 3,000株 |
| 富士紡ホールディングス | 6,600 | 3,205.00 | 21,153,000 | |
| 倉敷紡績 | 12,600 | 2,495.00 | 31,437,000 | |
| シキボウ | 7,300 | 1,012.00 | 7,387,600 | 貸付有価証券 500株 |
| 日本毛織 | 44,400 | 1,020.00 | 45,288,000 | 貸付有価証券 100株 |

| | | | | |
|---------------------|-----------|-----------|-------------|---------------------------------|
| ダイトウボウ | 21,300 | 93.00 | 1,980,900 | 貸付有価証券 6,300株 (2,300株) |
| トーア紡コーポレーショ ン | 5,100 | 355.00 | 1,810,500 | |
| ダイドーリミテッド | 18,800 | 285.00 | 5,358,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 帝国繊維 | 19,000 | 1,731.00 | 32,889,000 | |
| 帝人 | 161,600 | 1,513.00 | 244,500,800 | 貸付有価証券 400株 |
| 東レ | 1,127,200 | 761.10 | 857,911,920 | |
| 住江織物 | 2,700 | 2,314.00 | 6,247,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 日本フェルト | 7,200 | 419.00 | 3,016,800 | 貸付有価証券 100株 |
| イチカワ | 1,600 | 1,361.00 | 2,177,600 | |
| 日東製網 | 1,400 | 1,419.00 | 1,986,600 | |
| アツギ | 7,600 | 421.00 | 3,199,600 | 貸付有価証券 100株 |
| ダイニック | 3,400 | 721.00 | 2,451,400 | |
| セーレン | 32,500 | 2,295.00 | 74,587,500 | 貸付有価証券 15,200株 (15,000 株) |
| ソトー | 4,100 | 831.00 | 3,407,100 | |
| 東海染工 | 1,300 | 1,125.00 | 1,462,500 | |
| 小松マテーレ | 24,400 | 684.00 | 16,689,600 | |
| ワコールホールディング ス | 32,400 | 2,700.00 | 87,480,000 | |
| ホギメディカル | 22,600 | 3,410.00 | 77,066,000 | |
| クラウドディアホールディ ングス | 3,000 | 553.00 | 1,659,000 | |
| T S I ホールディングス | 56,600 | 669.00 | 37,865,400 | |
| マツオカコーポレーショ ン | 3,500 | 1,422.00 | 4,977,000 | 貸付有価証券 700株 (700株) |
| ワールド | 21,600 | 1,527.00 | 32,983,200 | |
| 三陽商会 | 5,000 | 1,635.00 | 8,175,000 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| ナイガイ | 4,300 | 266.00 | 1,143,800 | 貸付有価証券 100株 |
| オンワードホールディン グス | 109,100 | 380.00 | 41,458,000 | 貸付有価証券 300株 |
| ルックホールディングス | 3,700 | 2,240.00 | 8,288,000 | |
| ゴールドウイン | 29,800 | 11,980.00 | 357,004,000 | |
| デサント | 29,000 | 4,340.00 | 125,860,000 | 貸付有価証券 400株 |

| | | | | |
|----------------|-----------|----------|---------------|-------------------------|
| キング | 5,700 | 572.00 | 3,260,400 | |
| ヤマトインターナショナル | 10,300 | 281.00 | 2,894,300 | 貸付有価証券 2,900株 |
| 特種東海製紙 | 7,500 | 3,005.00 | 22,537,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 王子ホールディングス | 700,800 | 544.00 | 381,235,200 | |
| 日本製紙 | 87,600 | 1,096.00 | 96,009,600 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 三菱製紙 | 15,700 | 424.00 | 6,656,800 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 北越コーポレーション | 106,300 | 933.00 | 99,177,900 | 貸付有価証券 49,800株 |
| 中越パルプ工業 | 5,300 | 1,036.00 | 5,490,800 | |
| 巴川製紙所 | 4,100 | 685.00 | 2,808,500 | |
| 大王製紙 | 74,300 | 1,130.00 | 83,959,000 | 貸付有価証券 4,600株 |
| 阿波製紙 | 3,100 | 570.00 | 1,767,000 | 貸付有価証券 1,800株 |
| レンゴー | 153,200 | 875.00 | 134,050,000 | 貸付有価証券 3,100株 |
| トーモク | 9,700 | 1,883.00 | 18,265,100 | |
| ザ・パック | 12,500 | 3,145.00 | 39,312,500 | 貸付有価証券 400株 |
| 北の達人コーポレーション | 70,900 | 282.00 | 19,993,800 | 貸付有価証券 7,800株 |
| クラレ | 267,500 | 1,249.00 | 334,107,500 | 貸付有価証券 65,600株 |
| 旭化成 | 1,050,600 | 1,001.50 | 1,052,175,900 | |
| 共和レザー | 7,500 | 544.00 | 4,080,000 | |
| レゾナック・ホールディングス | 162,600 | 2,168.00 | 352,516,800 | 貸付有価証券 3,600株 |
| 住友化学 | 1,248,000 | 454.00 | 566,592,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 住友精化 | 7,000 | 4,485.00 | 31,395,000 | |
| 日産化学 | 79,900 | 6,040.00 | 482,596,000 | |
| ラサ工業 | 6,500 | 2,235.00 | 14,527,500 | |
| クレハ | 14,400 | 8,610.00 | 123,984,000 | |
| 多木化学 | 6,500 | 4,355.00 | 28,307,500 | 貸付有価証券 1,400株 |
| テイカ | 11,300 | 1,233.00 | 13,932,900 | |
| 石原産業 | 30,400 | 1,203.00 | 36,571,200 | |
| 片倉コープアグリ | 2,700 | 1,692.00 | 4,568,400 | 貸付有価証券 1,200株 (800株) |

| | | | | |
|--------------|-----------|----------|---------------|-------------------------|
| 日本曹達 | 18,100 | 4,835.00 | 87,513,500 | |
| 東ソー | 224,600 | 1,815.00 | 407,649,000 | 貸付有価証券 700株 |
| トクヤマ | 54,300 | 2,162.00 | 117,396,600 | |
| セントラル硝子 | 27,000 | 2,969.00 | 80,163,000 | |
| 東亜合成 | 84,400 | 1,223.00 | 103,221,200 | 貸付有価証券 39,200株 |
| 大阪ソーダ | 10,100 | 4,390.00 | 44,339,000 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 関東電化工業 | 32,500 | 1,030.00 | 33,475,000 | |
| デンカ | 61,200 | 2,715.00 | 166,158,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 信越化学工業 | 1,398,400 | 3,973.00 | 5,555,843,200 | 貸付有価証券 14,700株 |
| 日本カーバイド工業 | 5,000 | 1,346.00 | 6,730,000 | |
| 堺化学工業 | 12,800 | 1,878.00 | 24,038,400 | 貸付有価証券 3,500株 |
| 第一稀元素化学工業 | 15,300 | 1,012.00 | 15,483,600 | 貸付有価証券 800株 |
| エア・ウォーター | 158,700 | 1,734.00 | 275,185,800 | |
| 日本酸素ホールディングス | 163,200 | 2,520.00 | 411,264,000 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 日本化学工業 | 5,600 | 1,855.00 | 10,388,000 | |
| 東邦アセチレン | 2,800 | 1,380.00 | 3,864,000 | |
| 日本パーカライズング | 83,300 | 1,061.00 | 88,381,300 | 貸付有価証券 400株 |
| 高压ガス工業 | 24,400 | 774.00 | 18,885,600 | |
| チタン工業 | 1,600 | 1,438.00 | 2,300,800 | |
| 四国化成ホールディングス | 20,000 | 1,440.00 | 28,800,000 | |
| 戸田工業 | 3,800 | 2,471.00 | 9,389,800 | 貸付有価証券 1,700株 (400株) |
| ステラ ケミファ | 10,000 | 2,838.00 | 28,380,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 保土谷化学工業 | 4,800 | 3,215.00 | 15,432,000 | |
| 日本触媒 | 25,600 | 5,450.00 | 139,520,000 | |
| 大日精化工業 | 11,700 | 1,870.00 | 21,879,000 | |
| カネカ | 38,400 | 3,680.00 | 141,312,000 | |
| 三菱瓦斯化学 | 125,600 | 2,013.00 | 252,832,800 | 貸付有価証券 500株 |
| 三井化学 | 138,700 | 3,490.00 | 484,063,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| J S R | 157,100 | 3,095.00 | 486,224,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|---------------|-----------|----------|-------------|---------------------------|
| | | | | 800 株 |
| 東京応化工業 | 29,400 | 7,350.00 | 216,090,000 | |
| 大阪有機化学工業 | 12,700 | 2,080.00 | 26,416,000 | 貸付有価証券 100 株 |
| 三菱ケミカルグループ | 1,135,300 | 799.10 | 907,218,230 | 貸付有価証券 11,700 株 |
| KHネオケム | 28,000 | 2,387.00 | 66,836,000 | |
| ダイセル | 247,400 | 1,094.00 | 270,655,600 | |
| 住友ベークライト | 24,900 | 5,120.00 | 127,488,000 | 貸付有価証券 1,900 株 |
| 積水化学工業 | 344,100 | 1,879.00 | 646,563,900 | |
| 日本ゼオン | 100,900 | 1,478.00 | 149,130,200 | 貸付有価証券 3,800 株 |
| アイカ工業 | 42,500 | 3,025.00 | 128,562,500 | 貸付有価証券 500 株 |
| UBE | 86,700 | 2,179.00 | 188,919,300 | 貸付有価証券 1,500 株 |
| 積水樹脂 | 24,500 | 2,194.00 | 53,753,000 | 貸付有価証券 1,500 株 |
| タキロンシーアイ | 36,800 | 527.00 | 19,393,600 | 貸付有価証券 3,900 株 |
| 旭有機材 | 11,200 | 3,255.00 | 36,456,000 | |
| ニチバン | 10,400 | 2,003.00 | 20,831,200 | |
| リケンテクノス | 36,200 | 605.00 | 21,901,000 | |
| 大倉工業 | 7,800 | 2,121.00 | 16,543,800 | |
| 積水化成成品工業 | 23,600 | 426.00 | 10,053,600 | |
| 群栄化学工業 | 4,000 | 2,663.00 | 10,652,000 | 貸付有価証券 100 株 |
| タイガースポリマー | 6,000 | 490.00 | 2,940,000 | 貸付有価証券 200 株 |
| ミライアル | 4,000 | 1,511.00 | 6,044,000 | |
| ダイキアクシス | 4,800 | 741.00 | 3,556,800 | 貸付有価証券 2,600 株 |
| ダイキョーニシカワ | 37,100 | 686.00 | 25,450,600 | |
| 竹本容器 | 4,400 | 797.00 | 3,506,800 | |
| 森六ホールディングス | 8,500 | 1,962.00 | 16,677,000 | |
| 恵和 | 10,900 | 1,356.00 | 14,780,400 | 貸付有価証券 5,100 株 (100 株) |
| 日本化薬 | 128,500 | 1,247.00 | 160,239,500 | |
| カーリットホールディングス | 15,100 | 704.00 | 10,630,400 | |
| 日本精化 | 9,600 | 2,564.00 | 24,614,400 | 貸付有価証券 400 株 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|---------------|-------------------------|
| 扶桑化学工業 | 15,600 | 3,735.00 | 58,266,000 | 貸付有価証券 800株 |
| トリケミカル研究所 | 22,500 | 2,224.00 | 50,040,000 | |
| ADEKA | 58,700 | 2,320.00 | 136,184,000 | |
| 日油 | 52,000 | 6,330.00 | 329,160,000 | 貸付有価証券 2,600株 |
| 新日本理化 | 18,000 | 212.00 | 3,816,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ハリマ化成グループ | 9,200 | 863.00 | 7,939,600 | |
| 花王 | 409,700 | 5,315.00 | 2,177,555,500 | 貸付有価証券 73,400株 |
| 第一工業製薬 | 6,000 | 1,912.00 | 11,472,000 | |
| 石原ケミカル | 7,700 | 1,524.00 | 11,734,800 | |
| 日華化学 | 5,300 | 849.00 | 4,499,700 | |
| ニイタカ | 2,400 | 2,225.00 | 5,340,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 三洋化成工業 | 10,300 | 4,260.00 | 43,878,000 | |
| 有機合成薬品工業 | 9,700 | 295.00 | 2,861,500 | 貸付有価証券 1,800株 (800株) |
| 大日本塗料 | 20,500 | 897.00 | 18,388,500 | |
| 日本ペイントホールディングス | 744,400 | 1,224.00 | 911,145,600 | 貸付有価証券 25,100株 |
| 関西ペイント | 154,100 | 2,043.00 | 314,826,300 | 貸付有価証券 500株 |
| 神東塗料 | 10,900 | 135.00 | 1,471,500 | 貸付有価証券 100株 |
| 中国塗料 | 27,600 | 1,198.00 | 33,064,800 | |
| 日本特殊塗料 | 8,300 | 1,071.00 | 8,889,300 | 貸付有価証券 400株 |
| 藤倉化成 | 22,600 | 436.00 | 9,853,600 | |
| 太陽ホールディングス | 25,600 | 2,604.00 | 66,662,400 | |
| D I C | 65,700 | 2,527.00 | 166,023,900 | 貸付有価証券 12,200株 |
| サカタインクス | 37,400 | 1,111.00 | 41,551,400 | |
| 東洋インキSCホールディングス | 32,900 | 2,201.00 | 72,412,900 | |
| T&K TOKA | 14,900 | 1,183.00 | 17,626,700 | |
| 富士フイルムホールディングス | 323,200 | 7,234.00 | 2,338,028,800 | |
| 資生堂 | 351,700 | 6,597.00 | 2,320,164,900 | 貸付有価証券 33,500株 |
| ライオン | 202,100 | 1,417.00 | 286,375,700 | |
| 高砂香料工業 | 11,400 | 2,600.00 | 29,640,000 | |

| | | | | |
|------------------|--------|-----------|-------------|-------------------------|
| マンダム | 36,400 | 1,585.00 | 57,694,000 | |
| ミルボン | 25,000 | 5,690.00 | 142,250,000 | |
| ファンケル | 73,700 | 2,301.00 | 169,583,700 | |
| コーセー | 34,300 | 15,400.00 | 528,220,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| コタ | 15,500 | 1,645.00 | 25,497,500 | |
| シーボン | 1,700 | 1,600.00 | 2,720,000 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 86,300 | 2,078.00 | 179,331,400 | 貸付有価証券 8,200株 |
| ノエビアホールディングス | 15,000 | 5,490.00 | 82,350,000 | |
| アジュバンホールディングス | 3,200 | 925.00 | 2,960,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 新日本製薬 | 9,600 | 1,379.00 | 13,238,400 | 貸付有価証券 400株 |
| アクシージア | 8,500 | 1,183.00 | 10,055,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| エステー | 13,000 | 1,573.00 | 20,449,000 | |
| アグロ カネショウ | 6,700 | 1,801.00 | 12,066,700 | 貸付有価証券 2,300株 |
| コニシ | 28,100 | 2,161.00 | 60,724,100 | |
| 長谷川香料 | 32,200 | 3,300.00 | 106,260,000 | 貸付有価証券 4,900株 |
| 星光PMC | 6,700 | 588.00 | 3,939,600 | |
| 小林製薬 | 49,000 | 8,350.00 | 409,150,000 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 荒川化学工業 | 14,300 | 1,003.00 | 14,342,900 | |
| メック | 13,900 | 2,669.00 | 37,099,100 | |
| 日本高純度化学 | 4,200 | 2,517.00 | 10,571,400 | |
| タカラバイオ | 45,400 | 1,731.00 | 78,587,400 | 貸付有価証券 800株 |
| JCU | 18,800 | 3,380.00 | 63,544,000 | |
| 新田ゼラチン | 8,100 | 880.00 | 7,128,000 | 貸付有価証券 3,600株 (100株) |
| OATアグリオ | 5,400 | 1,350.00 | 7,290,000 | 貸付有価証券 400株 |
| デクセリアルズ | 48,700 | 2,628.00 | 127,983,600 | 貸付有価証券 22,600株 |
| アース製薬 | 15,300 | 5,080.00 | 77,724,000 | |
| 北興化学工業 | 16,900 | 910.00 | 15,379,000 | |
| 大成ラミック | 5,300 | 2,953.00 | 15,650,900 | |
| クミアイ化学工業 | 66,900 | 909.00 | 60,812,100 | 貸付有価証券 1,600株 |

| | | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|-----------------------------|
| 日本農薬 | 30,900 | 690.00 | 21,321,000 | 貸付有価証券 700株 |
| アキレス | 10,600 | 1,465.00 | 15,529,000 | |
| 有沢製作所 | 27,400 | 1,284.00 | 35,181,600 | 貸付有価証券 100株 |
| 日東電工 | 122,300 | 9,130.00 | 1,116,599,000 | |
| レック | 24,000 | 881.00 | 21,144,000 | |
| 三光合成 | 21,200 | 540.00 | 11,448,000 | |
| きもと | 19,300 | 185.00 | 3,570,500 | 貸付有価証券 6,700株 |
| 藤森工業 | 13,300 | 3,215.00 | 42,759,500 | |
| 前澤化成工業 | 10,900 | 1,615.00 | 17,603,500 | 貸付有価証券 5,000株 |
| 未来工業 | 6,000 | 2,316.00 | 13,896,000 | |
| ウェーブブロックホールディングス | 3,900 | 603.00 | 2,351,700 | 貸付有価証券 800株 (800株) |
| J S P | 11,800 | 1,608.00 | 18,974,400 | |
| エフピコ | 31,900 | 3,040.00 | 96,976,000 | |
| 天馬 | 14,300 | 2,368.00 | 33,862,400 | |
| 信越ポリマー | 31,100 | 1,355.00 | 42,140,500 | |
| 東リ | 29,400 | 312.00 | 9,172,800 | |
| ニフコ | 60,800 | 3,900.00 | 237,120,000 | 貸付有価証券 5,500株 |
| バルカー | 14,100 | 3,520.00 | 49,632,000 | |
| ユニ・チャーム | 350,900 | 5,176.00 | 1,816,258,400 | 貸付有価証券 26,400株 (15,000株) |
| ショーエイコーポレーション | 3,800 | 566.00 | 2,150,800 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| 協和キリン | 203,500 | 3,010.00 | 612,535,000 | 貸付有価証券 11,200株 |
| 武田薬品工業 | 1,490,700 | 4,575.00 | 6,819,952,500 | 貸付有価証券 55,600株 |
| アステラス製薬 | 1,591,300 | 2,095.50 | 3,334,569,150 | |
| 住友ファーマ | 125,000 | 802.00 | 100,250,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 塩野義製薬 | 212,400 | 6,044.00 | 1,283,745,600 | |
| わかもと製薬 | 12,300 | 248.00 | 3,050,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 日本新薬 | 39,700 | 6,220.00 | 246,934,000 | |
| 中外製薬 | 527,300 | 3,578.00 | 1,886,679,400 | 貸付有価証券 142,500株 |
| 科研製薬 | 28,900 | 3,795.00 | 109,675,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-----------------|-----------|----------|---------------|----------------------------------|
| | | | | 300 株 |
| エーザイ | 204,900 | 8,095.00 | 1,658,665,500 | 貸付有価証券 900 株 |
| ロート製薬 | 163,200 | 2,796.00 | 456,307,200 | |
| 小野薬品工業 | 325,000 | 2,604.50 | 846,462,500 | |
| 久光製薬 | 37,400 | 3,810.00 | 142,494,000 | 貸付有価証券 4,000 株 |
| 持田製薬 | 19,300 | 3,545.00 | 68,418,500 | 貸付有価証券 600 株 |
| 参天製薬 | 306,900 | 1,152.00 | 353,548,800 | |
| 扶桑薬品工業 | 5,300 | 2,039.00 | 10,806,700 | |
| 日本ケミファ | 1,300 | 1,815.00 | 2,359,500 | |
| ツムラ | 53,000 | 2,690.00 | 142,570,000 | |
| キッセイ薬品工業 | 26,000 | 2,885.00 | 75,010,000 | 貸付有価証券 300 株 |
| 生化学工業 | 32,100 | 841.00 | 26,996,100 | |
| 栄研化学 | 27,300 | 1,576.00 | 43,024,800 | |
| 鳥居薬品 | 9,000 | 3,355.00 | 30,195,000 | |
| JCRファーマ | 57,000 | 1,443.00 | 82,251,000 | 貸付有価証券 2,000 株 |
| 東和薬品 | 25,900 | 1,941.00 | 50,271,900 | |
| 富士製薬工業 | 12,400 | 1,277.00 | 15,834,800 | |
| ゼリア新薬工業 | 23,400 | 2,468.00 | 57,751,200 | 貸付有価証券 100 株 |
| そーせいグループ | 57,900 | 2,813.00 | 162,872,700 | 貸付有価証券 27,000 株 (22,600 株) |
| 第一三共 | 1,467,500 | 4,432.00 | 6,503,960,000 | 貸付有価証券 15,000 株 |
| 杏林製薬 | 36,500 | 1,742.00 | 63,583,000 | 貸付有価証券 200 株 |
| 大幸薬品 | 30,600 | 384.00 | 11,750,400 | 貸付有価証券 7,900 株 |
| ダイト | 11,800 | 2,536.00 | 29,924,800 | |
| 大塚ホールディングス | 385,400 | 4,723.00 | 1,820,244,200 | 貸付有価証券 58,800 株 |
| 大正製薬ホールディングス | 37,400 | 5,900.00 | 220,660,000 | 貸付有価証券 3,800 株 |
| ペプチドリーム | 81,700 | 1,865.00 | 152,370,500 | 貸付有価証券 18,400 株 |
| あすか製薬ホールディングス | 17,300 | 1,308.00 | 22,628,400 | |
| サワイグループホールディングス | 38,500 | 3,940.00 | 151,690,000 | |

| | | | | |
|------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| 日本コークス工業 | 151,900 | 93.00 | 14,126,700 | 貸付有価証券 2,400株 |
| ニチレキ | 19,900 | 1,774.00 | 35,302,600 | |
| ユシロ化学工業 | 8,700 | 885.00 | 7,699,500 | |
| ビーピー・カストロール | 5,100 | 908.00 | 4,630,800 | |
| 富士石油 | 34,400 | 259.00 | 8,909,600 | 貸付有価証券 2,500株 |
| MORESCO | 4,300 | 1,150.00 | 4,945,000 | |
| 出光興産 | 187,100 | 2,904.00 | 543,338,400 | |
| ENEOSホールディングス | 2,857,300 | 480.40 | 1,372,646,920 | |
| コスモエネルギーホールディングス | 66,600 | 4,350.00 | 289,710,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 横浜ゴム | 95,800 | 2,968.00 | 284,334,400 | 貸付有価証券 5,200株 |
| TOYO TIRE | 96,800 | 1,619.00 | 156,719,200 | 貸付有価証券 9,800株 |
| ブリヂストン | 537,900 | 5,477.00 | 2,946,078,300 | 貸付有価証券 85,800株 (7,500株) |
| 住友ゴム工業 | 165,200 | 1,272.00 | 210,134,400 | |
| 藤倉コンポジット | 9,300 | 1,038.00 | 9,653,400 | |
| オカモト | 9,300 | 4,145.00 | 38,548,500 | |
| フコク | 8,800 | 1,088.00 | 9,574,400 | |
| ニッタ | 17,100 | 3,150.00 | 53,865,000 | |
| 住友理工 | 32,700 | 779.00 | 25,473,300 | |
| 三ツ星ベルト | 24,600 | 3,960.00 | 97,416,000 | 貸付有価証券 1,900株 |
| バンドー化学 | 26,700 | 1,118.00 | 29,850,600 | |
| 日東紡績 | 19,000 | 1,893.00 | 35,967,000 | |
| AGC | 171,400 | 5,190.00 | 889,566,000 | 貸付有価証券 26,500株 |
| 日本板硝子 | 85,900 | 656.00 | 56,350,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 石塚硝子 | 2,000 | 1,559.00 | 3,118,000 | |
| 日本山村硝子 | 4,900 | 717.00 | 3,513,300 | |
| 日本電気硝子 | 68,800 | 2,518.00 | 173,238,400 | 貸付有価証券 200株 |
| オハラ | 8,000 | 1,164.00 | 9,312,000 | 貸付有価証券 1,100株 (100株) |
| 住友大阪セメント | 23,700 | 3,830.00 | 90,771,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 太平洋セメント | 107,300 | 2,463.00 | 264,279,900 | 貸付有価証券 500株 |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|-------------------|
| 日本ヒューム | 14,700 | 805.00 | 11,833,500 | |
| 日本コンクリート工業 | 32,700 | 266.00 | 8,698,200 | 貸付有価証券 200株 |
| 三谷セキサン | 7,100 | 5,070.00 | 35,997,000 | |
| アジアパイルホールディングス | 26,300 | 766.00 | 20,145,800 | |
| 東海カーボン | 141,300 | 1,237.00 | 174,788,100 | 貸付有価証券 9,400株 |
| 日本カーボン | 9,700 | 4,220.00 | 40,934,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 東洋炭素 | 10,500 | 4,270.00 | 44,835,000 | |
| ノリタケカンパニーリミテド | 8,400 | 4,715.00 | 39,606,000 | |
| TOTO | 111,200 | 4,605.00 | 512,076,000 | 貸付有価証券 2,500株 |
| 日本碍子 | 195,900 | 1,746.00 | 342,041,400 | 貸付有価証券 500株 |
| 日本特殊陶業 | 128,200 | 2,612.00 | 334,858,400 | 貸付有価証券 12,500株 |
| ダントーホールディングス | 9,200 | 640.00 | 5,888,000 | 貸付有価証券 5,300株 |
| MARUWA | 6,200 | 17,680.00 | 109,616,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 品川リフラクトリーズ | 4,700 | 4,700.00 | 22,090,000 | |
| 黒崎播磨 | 3,400 | 6,430.00 | 21,862,000 | |
| ヨータイ | 11,200 | 1,487.00 | 16,654,400 | |
| 東京窯業 | 12,000 | 351.00 | 4,212,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ニッカトー | 5,900 | 620.00 | 3,658,000 | 貸付有価証券 100株 |
| フジミインコーポレーテッド | 13,400 | 7,410.00 | 99,294,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| クニミネ工業 | 3,800 | 936.00 | 3,556,800 | |
| エーアンドエーマテリアル | 2,400 | 1,013.00 | 2,431,200 | |
| ニチアス | 42,600 | 2,759.00 | 117,533,400 | 貸付有価証券 200株 |
| ニチハ | 21,100 | 2,950.00 | 62,245,000 | |
| 日本製鉄 | 775,900 | 2,825.00 | 2,191,917,500 | 貸付有価証券 84,500株 |
| 神戸製鋼所 | 348,500 | 1,034.00 | 360,349,000 | |
| 中山製鋼所 | 35,700 | 855.00 | 30,523,500 | 貸付有価証券 15,100株 |
| 合同製鐵 | 8,600 | 3,210.00 | 27,606,000 | |
| JFEホールディングス | 463,100 | 1,836.00 | 850,251,600 | |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| 東京製鐵 | 48,700 | 1,326.00 | 64,576,200 | 貸付有価証券 100株 |
| 共英製鋼 | 19,700 | 1,815.00 | 35,755,500 | |
| 大和工業 | 28,600 | 5,520.00 | 157,872,000 | |
| 東京鐵鋼 | 8,200 | 2,587.00 | 21,213,400 | |
| 大阪製鐵 | 8,000 | 1,334.00 | 10,672,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 淀川製鋼所 | 19,700 | 2,878.00 | 56,696,600 | 貸付有価証券 800株 |
| 中部鋼鈹 | 14,200 | 2,084.00 | 29,592,800 | |
| 丸一鋼管 | 52,800 | 3,110.00 | 164,208,000 | |
| モリ工業 | 3,100 | 3,440.00 | 10,664,000 | |
| 大同特殊鋼 | 21,800 | 5,220.00 | 113,796,000 | |
| 日本高周波鋼業 | 4,500 | 340.00 | 1,530,000 | |
| 日本冶金工業 | 12,700 | 4,560.00 | 57,912,000 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 山陽特殊製鋼 | 17,100 | 2,672.00 | 45,691,200 | 貸付有価証券 100株 |
| 愛知製鋼 | 10,000 | 2,800.00 | 28,000,000 | |
| 日本金属 | 2,900 | 953.00 | 2,763,700 | |
| 大太平洋金属 | 12,300 | 1,679.00 | 20,651,700 | 貸付有価証券 800株 |
| 新日本電工 | 110,700 | 350.00 | 38,745,000 | 貸付有価証券 2,900株 (600株) |
| 栗本鐵工所 | 8,200 | 2,084.00 | 17,088,800 | |
| 虹技 | 1,600 | 1,185.00 | 1,896,000 | |
| 日本鑄鉄管 | 1,300 | 1,069.00 | 1,389,700 | |
| 三菱製鋼 | 10,900 | 1,205.00 | 13,134,500 | |
| 日亜鋼業 | 13,700 | 325.00 | 4,452,500 | |
| 日本精線 | 2,400 | 4,510.00 | 10,824,000 | |
| エンビプロ・ホールディングス | 9,300 | 610.00 | 5,673,000 | 貸付有価証券 4,400株 (3,000株) |
| シンニッタン | 14,500 | 248.00 | 3,596,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 新家工業 | 2,900 | 2,081.00 | 6,034,900 | 貸付有価証券 1,500株 (100株) |
| 大紀アルミニウム工業所 | 24,700 | 1,416.00 | 34,975,200 | 貸付有価証券 3,700株 |
| 日本軽金属ホールディングス | 46,700 | 1,430.00 | 66,781,000 | |
| 三井金属鉱業 | 50,400 | 3,280.00 | 165,312,000 | |
| 東邦亜鉛 | 10,200 | 1,876.00 | 19,135,200 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|---------------|-----------------------------|
| | | | | 600 株 |
| 三菱マテリアル | 115,600 | 2,277.00 | 263,221,200 | |
| 住友金属鉱山 | 200,900 | 5,060.00 | 1,016,554,000 | 貸付有価証券 7,400 株 |
| DOWAホールディングス | 38,900 | 4,520.00 | 175,828,000 | 貸付有価証券 800 株 |
| 古河機械金属 | 25,400 | 1,351.00 | 34,315,400 | 貸付有価証券 1,100 株 |
| 大阪チタニウムテクノロ ジーズ | 25,400 | 2,745.00 | 69,723,000 | 貸付有価証券 1,900 株 |
| 東邦チタニウム | 31,300 | 1,621.00 | 50,737,300 | 貸付有価証券 14,200 株 |
| UACJ | 24,300 | 2,755.00 | 66,946,500 | |
| CKサンエツ | 4,200 | 4,320.00 | 18,144,000 | |
| 古河電気工業 | 57,700 | 2,542.00 | 146,673,400 | 貸付有価証券 1,800 株 |
| 住友電気工業 | 598,400 | 1,749.00 | 1,046,601,600 | 貸付有価証券 4,500 株 |
| フジクラ | 185,800 | 937.00 | 174,094,600 | |
| SWCC | 19,400 | 1,786.00 | 34,648,400 | |
| タツタ電線 | 35,300 | 715.00 | 25,239,500 | 貸付有価証券 1,900 株 |
| カナレ電気 | 2,100 | 1,382.00 | 2,902,200 | 貸付有価証券 700 株 (700 株) |
| 平河ヒューテック | 10,000 | 1,505.00 | 15,050,000 | 貸付有価証券 4,100 株 |
| リョービ | 18,500 | 1,587.00 | 29,359,500 | |
| アーレスティ | 14,900 | 583.00 | 8,686,700 | 貸付有価証券 1,400 株 (1,400 株) |
| アサヒホールディングス | 70,100 | 1,996.00 | 139,919,600 | 貸付有価証券 5,400 株 |
| 稲葉製作所 | 9,000 | 1,455.00 | 13,095,000 | |
| 宮地エンジニアリンググ ループ | 4,800 | 3,995.00 | 19,176,000 | |
| トーカロ | 47,600 | 1,311.00 | 62,403,600 | |
| アルファC o | 4,900 | 1,034.00 | 5,066,600 | 貸付有価証券 900 株 |
| SUMCO | 329,900 | 1,905.00 | 628,459,500 | 貸付有価証券 17,600 株 |
| 川田テクノロジーズ | 4,100 | 4,125.00 | 16,912,500 | |
| RS Technologies | 11,600 | 3,010.00 | 34,916,000 | 貸付有価証券 200 株 |
| ジェイテックコーポレー ション | 1,800 | 2,434.00 | 4,381,200 | 貸付有価証券 1,000 株 (700 株) |
| 信和 | 7,400 | 719.00 | 5,320,600 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| 東洋製罐グループホールディングス | 114,700 | 1,975.00 | 226,532,500 | |
| ホッカンホールディングス | 9,300 | 1,390.00 | 12,927,000 | |
| コロナ | 9,700 | 969.00 | 9,399,300 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 21,700 | 2,254.00 | 48,911,800 | |
| 駒井ハルテック | 2,200 | 1,832.00 | 4,030,400 | 貸付有価証券 400株 |
| 高田機工 | 1,100 | 2,688.00 | 2,956,800 | |
| 三和ホールディングス | 159,600 | 1,522.00 | 242,911,200 | 貸付有価証券 4,400株 |
| 文化シヤッター | 49,900 | 1,147.00 | 57,235,300 | 貸付有価証券 23,300株(17,000株) |
| 三協立山 | 19,800 | 689.00 | 13,642,200 | |
| アルインコ | 13,200 | 994.00 | 13,120,800 | |
| 東洋シヤッター | 3,100 | 550.00 | 1,705,000 | |
| L I X I L | 252,500 | 2,018.00 | 509,545,000 | 貸付有価証券 5,700株 |
| 日本ファイルコン | 8,800 | 475.00 | 4,180,000 | |
| ノーリツ | 25,500 | 1,863.00 | 47,506,500 | |
| 長府製作所 | 17,500 | 2,521.00 | 44,117,500 | |
| リンナイ | 94,300 | 3,270.00 | 308,361,000 | |
| ダイニチ工業 | 6,700 | 730.00 | 4,891,000 | |
| 日東精工 | 25,100 | 613.00 | 15,386,300 | |
| 三洋工業 | 1,500 | 1,939.00 | 2,908,500 | |
| 岡部 | 27,900 | 782.00 | 21,817,800 | 貸付有価証券 100株 |
| ジーテクト | 19,300 | 1,497.00 | 28,892,100 | |
| 東プレ | 30,500 | 1,412.00 | 43,066,000 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 高周波熱錬 | 26,700 | 730.00 | 19,491,000 | |
| 東京製綱 | 10,200 | 1,174.00 | 11,974,800 | |
| サンコール | 12,000 | 580.00 | 6,960,000 | 貸付有価証券 500株 |
| モリテック スチール | 9,900 | 299.00 | 2,960,100 | 貸付有価証券 2,800株 |
| パイオラックス | 23,900 | 2,137.00 | 51,074,300 | |
| エイチワン | 17,800 | 662.00 | 11,783,600 | |
| 日本発條 | 153,300 | 1,009.00 | 154,679,700 | 貸付有価証券 1,400株 |

| | | | | |
|-------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| 中央発條 | 12,800 | 715.00 | 9,152,000 | 貸付有価証券 500株 |
| アドバネクス | 1,600 | 1,036.00 | 1,657,600 | 貸付有価証券 400株 |
| 立川プラインド工業 | 7,800 | 1,282.00 | 9,999,600 | 貸付有価証券 300株 |
| 三益半導体工業 | 13,400 | 2,664.00 | 35,697,600 | |
| 日本ドライケミカル | 3,200 | 1,833.00 | 5,865,600 | |
| 日本製鋼所 | 46,700 | 2,490.00 | 116,283,000 | |
| 三浦工業 | 70,800 | 3,630.00 | 257,004,000 | 貸付有価証券 300株 |
| タクマ | 52,100 | 1,459.00 | 76,013,900 | |
| ツガミ | 37,700 | 1,451.00 | 54,702,700 | |
| オークマ | 17,000 | 6,200.00 | 105,400,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 芝浦機械 | 16,900 | 3,200.00 | 54,080,000 | |
| アマダ | 270,700 | 1,292.00 | 349,744,400 | 貸付有価証券 6,100株 |
| アイダエンジニアリング | 34,900 | 889.00 | 31,026,100 | |
| TAKISAWA | 3,500 | 1,328.00 | 4,648,000 | 貸付有価証券 500株 |
| FUJ I | 73,700 | 2,357.00 | 173,710,900 | 貸付有価証券 100株 |
| 牧野フライス製作所 | 18,800 | 4,870.00 | 91,556,000 | |
| オーエスジー | 81,000 | 1,945.00 | 157,545,000 | 貸付有価証券 34,000株 |
| ダイジェット工業 | 1,300 | 875.00 | 1,137,500 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 47,400 | 926.00 | 43,892,400 | 貸付有価証券 1,200株 |
| DMG森精機 | 102,800 | 2,219.00 | 228,113,200 | 貸付有価証券 500株(300株) |
| ソディック | 46,800 | 761.00 | 35,614,800 | |
| ディスコ | 81,600 | 16,680.00 | 1,361,088,000 | 貸付有価証券 4,800株(1,700株) |
| 日東工器 | 8,200 | 2,065.00 | 16,933,000 | |
| 日進工具 | 14,200 | 1,164.00 | 16,528,800 | |
| パンチ工業 | 11,900 | 574.00 | 6,830,600 | |
| 富士ダイス | 6,200 | 745.00 | 4,619,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 豊和工業 | 7,200 | 857.00 | 6,170,400 | |
| 東洋機械金属 | 9,100 | 671.00 | 6,106,100 | |
| 津田駒工業 | 2,400 | 495.00 | 1,188,000 | 貸付有価証券 1,200株(300株) |

| | | | | |
|--------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| エンシュウ | 2,800 | 689.00 | 1,929,200 | 貸付有価証券 100株(100株) |
| 島精機製作所 | 27,000 | 1,840.00 | 49,680,000 | 貸付有価証券 3,600株 |
| オプトラン | 25,100 | 2,055.00 | 51,580,500 | |
| NCホールディングス | 2,700 | 1,976.00 | 5,335,200 | 貸付有価証券 100株 |
| イワキポンプ | 11,300 | 1,306.00 | 14,757,800 | |
| フリュー | 17,800 | 1,159.00 | 20,630,200 | |
| ヤマシンフィルタ | 40,500 | 336.00 | 13,608,000 | |
| 日阪製作所 | 16,400 | 951.00 | 15,596,400 | |
| やまびこ | 27,700 | 1,368.00 | 37,893,600 | |
| 野村マイクロ・サイエンス | 5,700 | 4,475.00 | 25,507,500 | |
| 平田機工 | 8,100 | 6,910.00 | 55,971,000 | 貸付有価証券 600株 |
| PEGASUS | 18,700 | 622.00 | 11,631,400 | 貸付有価証券 3,700株(2,600株) |
| マルマエ | 7,400 | 1,620.00 | 11,988,000 | 貸付有価証券 3,400株 |
| タツモ | 9,300 | 1,860.00 | 17,298,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ナブテスコ | 106,500 | 3,170.00 | 337,605,000 | |
| 三井海洋開発 | 21,300 | 1,466.00 | 31,225,800 | |
| レオン自動機 | 17,800 | 1,286.00 | 22,890,800 | 貸付有価証券 200株 |
| SMC | 55,000 | 69,710.00 | 3,834,050,000 | 貸付有価証券 400株 |
| ホソカワミクロン | 11,900 | 2,966.00 | 35,295,400 | |
| ユニオンツール | 7,500 | 3,290.00 | 24,675,000 | 貸付有価証券 100株(100株) |
| オイレス工業 | 23,700 | 1,736.00 | 41,143,200 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 6,700 | 4,270.00 | 28,609,000 | |
| サトーホールディングス | 24,100 | 2,298.00 | 55,381,800 | |
| 技研製作所 | 15,900 | 2,120.00 | 33,708,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 日本エアテック | 8,600 | 1,111.00 | 9,554,600 | |
| カワタ | 3,800 | 868.00 | 3,298,400 | |
| 日精樹脂工業 | 12,600 | 1,021.00 | 12,864,600 | 貸付有価証券 100株 |
| オカダアイオン | 4,100 | 1,826.00 | 7,486,600 | |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|-----------------------------|
| ワイエイシイホールディングス | 5,600 | 2,918.00 | 16,340,800 | 貸付有価証券 1,500株(300株) |
| 小松製作所 | 794,800 | 3,338.00 | 2,653,042,400 | |
| 住友重機械工業 | 100,400 | 3,295.00 | 330,818,000 | 貸付有価証券 14,000株 |
| 日立建機 | 67,600 | 3,330.00 | 225,108,000 | |
| 日工 | 25,100 | 643.00 | 16,139,300 | |
| 巴工業 | 7,300 | 2,443.00 | 17,833,900 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 井関農機 | 15,900 | 1,217.00 | 19,350,300 | |
| TOWA | 17,300 | 2,124.00 | 36,745,200 | 貸付有価証券 5,800株 |
| 丸山製作所 | 2,200 | 1,864.00 | 4,100,800 | |
| 北川鉄工所 | 6,700 | 1,223.00 | 8,194,100 | |
| ローゼ | 8,900 | 9,900.00 | 88,110,000 | 貸付有価証券 3,300株(800株) |
| タカキタ | 3,700 | 450.00 | 1,665,000 | 貸付有価証券 1,900株 |
| クボタ | 897,700 | 2,106.00 | 1,890,556,200 | 貸付有価証券 248,200株(37,100株) |
| 荏原実業 | 8,100 | 2,990.00 | 24,219,000 | |
| 三菱化工機 | 5,500 | 2,456.00 | 13,508,000 | |
| 月島ホールディングス | 22,900 | 1,147.00 | 26,266,300 | 貸付有価証券 100株 |
| 帝国電機製作所 | 11,900 | 2,424.00 | 28,845,600 | |
| 東京機械製作所 | 3,100 | 545.00 | 1,689,500 | 貸付有価証券 400株(400株) |
| 新東工業 | 34,300 | 1,039.00 | 35,637,700 | |
| 澁谷工業 | 15,900 | 2,632.00 | 41,848,800 | |
| アイチ コーポレーション | 23,600 | 842.00 | 19,871,200 | |
| 小森コーポレーション | 39,300 | 1,062.00 | 41,736,600 | |
| 鶴見製作所 | 13,000 | 2,359.00 | 30,667,000 | |
| 日本ギア工業 | 4,400 | 478.00 | 2,103,200 | |
| 酒井重工業 | 2,100 | 4,300.00 | 9,030,000 | |
| 荏原製作所 | 69,400 | 6,110.00 | 424,034,000 | 貸付有価証券 6,300株 |
| 石井鐵工所 | 1,500 | 2,306.00 | 3,459,000 | |
| 西島製作所 | 14,600 | 1,645.00 | 24,017,000 | |
| 北越工業 | 17,100 | 1,300.00 | 22,230,000 | |
| ダイキン工業 | 202,500 | 25,555.00 | 5,174,887,500 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-----------------|---------|----------|-------------|-------------------------|
| | | | | 2,100株 |
| オルガノ | 23,300 | 3,280.00 | 76,424,000 | 貸付有価証券 4,400株 |
| トーヨーカネツ | 6,400 | 2,741.00 | 17,542,400 | |
| 栗田工業 | 94,900 | 5,590.00 | 530,491,000 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 椿本チエイン | 24,000 | 3,475.00 | 83,400,000 | |
| 大同工業 | 5,300 | 727.00 | 3,853,100 | |
| 木村化工機 | 12,900 | 728.00 | 9,391,200 | 貸付有価証券 500株 |
| アネスト岩田 | 28,800 | 1,047.00 | 30,153,600 | 貸付有価証券 500株 |
| ダイフク | 262,400 | 2,589.00 | 679,353,600 | 貸付有価証券 9,400株 |
| サムコ | 4,500 | 5,070.00 | 22,815,000 | 貸付有価証券 2,100株 (100株) |
| 加藤製作所 | 6,200 | 1,315.00 | 8,153,000 | |
| 油研工業 | 2,000 | 2,007.00 | 4,014,000 | |
| タダノ | 89,500 | 1,047.00 | 93,706,500 | 貸付有価証券 4,100株 |
| フジテック | 59,500 | 3,680.00 | 218,960,000 | 貸付有価証券 11,600株 |
| CKD | 46,900 | 2,117.00 | 99,287,300 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 平和 | 56,400 | 2,658.00 | 149,911,200 | |
| 理想科学工業 | 15,100 | 2,292.00 | 34,609,200 | 貸付有価証券 100株 |
| SANKYO | 33,300 | 5,860.00 | 195,138,000 | |
| 日本金銭機械 | 18,600 | 1,251.00 | 23,268,600 | 貸付有価証券 2,000株 (300株) |
| マースグループホールディングス | 10,000 | 2,901.00 | 29,010,000 | |
| フクシマガリレイ | 12,500 | 5,410.00 | 67,625,000 | 貸付有価証券 100株 |
| オーイズミ | 4,900 | 581.00 | 2,846,900 | 貸付有価証券 1,300株 |
| ダイコク電機 | 9,300 | 2,809.00 | 26,123,700 | 貸付有価証券 4,300株 |
| 竹内製作所 | 30,800 | 3,735.00 | 115,038,000 | 貸付有価証券 100株 |
| アマノ | 48,100 | 2,873.00 | 138,191,300 | 貸付有価証券 8,900株 |
| JUKI | 26,300 | 595.00 | 15,648,500 | 貸付有価証券 100株 |
| ジャノメ | 17,200 | 619.00 | 10,646,800 | 貸付有価証券 300株 |

| | | | | |
|---------------|---------|----------|---------------|-----------------------|
| マックス | 20,900 | 2,237.00 | 46,753,300 | |
| グローリー | 40,700 | 2,801.00 | 114,000,700 | |
| 新晃工業 | 17,100 | 1,823.00 | 31,173,300 | 貸付有価証券 100株 |
| 大和冷機工業 | 26,000 | 1,440.00 | 37,440,000 | |
| セガサミーホールディングス | 136,400 | 2,700.00 | 368,280,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 日本ピストンリング | 4,400 | 1,371.00 | 6,032,400 | 貸付有価証券 500株 (100株) |
| リケン | 6,700 | 2,715.00 | 18,190,500 | |
| T P R | 19,400 | 1,410.00 | 27,354,000 | |
| ツバキ・ナカシマ | 41,800 | 989.00 | 41,340,200 | 貸付有価証券 100株 |
| ホシザキ | 109,200 | 4,930.00 | 538,356,000 | 貸付有価証券 14,300株 |
| 大豊工業 | 14,700 | 777.00 | 11,421,900 | |
| 日本精工 | 311,600 | 783.00 | 243,982,800 | 貸付有価証券 800株 |
| N T N | 334,400 | 310.00 | 103,664,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| ジェイテクト | 150,900 | 1,162.00 | 175,345,800 | 貸付有価証券 400株 |
| 不二越 | 12,500 | 3,875.00 | 48,437,500 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 日本トムソン | 41,500 | 588.00 | 24,402,000 | |
| T H K | 97,900 | 3,000.00 | 293,700,000 | 貸付有価証券 7,200株 |
| ユーシン精機 | 13,400 | 721.00 | 9,661,400 | |
| 前澤給装工業 | 11,900 | 1,094.00 | 13,018,600 | |
| イーグル工業 | 18,800 | 1,312.00 | 24,665,600 | |
| 前澤工業 | 7,500 | 781.00 | 5,857,500 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 日本ピラー工業 | 15,700 | 3,725.00 | 58,482,500 | 貸付有価証券 2,700株 |
| キッツ | 62,500 | 940.00 | 58,750,000 | 貸付有価証券 500株 |
| マキタ | 211,000 | 3,730.00 | 787,030,000 | 貸付有価証券 17,300株 |
| 三井E & S | 78,900 | 564.00 | 44,499,600 | 貸付有価証券 7,900株 |
| 日立造船 | 139,000 | 845.00 | 117,455,000 | |
| 三菱重工業 | 296,600 | 5,508.00 | 1,633,672,800 | |
| I H I | 106,900 | 3,510.00 | 375,219,000 | 貸付有価証券 100株 |

| | | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|-----------------------------|
| サノヤスホールディングス | 17,700 | 134.00 | 2,371,800 | |
| スター精密 | 32,000 | 1,774.00 | 56,768,000 | |
| 日清紡ホールディングス | 138,100 | 1,038.00 | 143,347,800 | 貸付有価証券 1,900株 |
| イビデン | 97,300 | 6,020.00 | 585,746,000 | 貸付有価証券 10,400株 |
| コニカミノルタ | 378,900 | 548.00 | 207,637,200 | 貸付有価証券 1,000株 |
| ブラザー工業 | 226,600 | 2,021.00 | 457,958,600 | |
| ミネベアミツミ | 295,100 | 2,591.00 | 764,604,100 | 貸付有価証券 15,500株 |
| 日立製作所 | 824,900 | 7,803.00 | 6,436,694,700 | |
| 東芝 | 326,500 | 4,407.00 | 1,438,885,500 | |
| 三菱電機 | 1,753,200 | 1,740.50 | 3,051,444,600 | |
| 富士電機 | 103,100 | 5,690.00 | 586,639,000 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 東洋電機製造 | 4,300 | 1,067.00 | 4,588,100 | |
| 安川電機 | 201,000 | 5,690.00 | 1,143,690,000 | 貸付有価証券 20,300株 (2,900株) |
| シンフォニアテクノロジー | 18,700 | 1,761.00 | 32,930,700 | |
| 明電舎 | 25,700 | 1,904.00 | 48,932,800 | |
| オリジン | 2,900 | 1,278.00 | 3,706,200 | |
| 山洋電気 | 7,300 | 7,080.00 | 51,684,000 | |
| デンヨー | 12,900 | 1,959.00 | 25,271,100 | |
| PHCホールディングス | 23,700 | 1,422.00 | 33,701,400 | |
| ソシオネクスト | 23,300 | 11,650.00 | 271,445,000 | 貸付有価証券 9,100株 |
| 東芝テック | 25,300 | 3,745.00 | 94,748,500 | |
| 芝浦メカトロニクス | 3,300 | 15,390.00 | 50,787,000 | 貸付有価証券 400株 |
| マブチモーター | 42,100 | 3,890.00 | 163,769,000 | 貸付有価証券 19,500株 (2,600株) |
| ニデック | 412,700 | 6,874.00 | 2,836,899,800 | |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | 12,400 | 508.00 | 6,299,200 | |
| トレックス・セミコンダクター | 8,000 | 2,292.00 | 18,336,000 | 貸付有価証券 3,700株 (3,700株) |
| 東光高岳 | 10,200 | 2,114.00 | 21,562,800 | 貸付有価証券 3,300株 |
| ダブル・スコープ | 55,500 | 1,168.00 | 64,824,000 | 貸付有価証券 24,800株 (14,600株) |

| | | | | |
|----------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| ダイヘン | 15,300 | 4,605.00 | 70,456,500 | |
| ヤーマン | 29,300 | 1,145.00 | 33,548,500 | 貸付有価証券 6,300株(2,000株) |
| JVCケンウッド | 154,500 | 527.00 | 81,421,500 | |
| ミマキエンジニアリング | 16,100 | 682.00 | 10,980,200 | |
| I-PEX | 9,400 | 1,478.00 | 13,893,200 | |
| 大崎電気工業 | 40,200 | 574.00 | 23,074,800 | |
| オムロン | 155,400 | 8,157.00 | 1,267,597,800 | 貸付有価証券 100株 |
| 日東工業 | 22,900 | 2,783.00 | 63,730,700 | |
| IDEC | 25,000 | 3,460.00 | 86,500,000 | |
| 正興電機製作所 | 5,000 | 1,018.00 | 5,090,000 | |
| 不二電機工業 | 2,600 | 1,116.00 | 2,901,600 | 貸付有価証券 100株 |
| ジーエス・ユアサコーポレーション | 55,700 | 2,496.00 | 139,027,200 | 貸付有価証券 200株 |
| サクサホールディングス | 2,700 | 2,159.00 | 5,829,300 | |
| メルコホールディングス | 4,300 | 3,370.00 | 14,491,000 | |
| テクノメディカ | 4,100 | 1,811.00 | 7,425,100 | |
| ダイヤモンドエレクトリックホールディング | 5,700 | 923.00 | 5,261,100 | 貸付有価証券 2,600株(100株) |
| 日本電気 | 239,900 | 6,130.00 | 1,470,587,000 | |
| 富士通 | 169,000 | 17,875.00 | 3,020,875,000 | |
| 沖電気工業 | 76,700 | 755.00 | 57,908,500 | 貸付有価証券 100株 |
| 岩崎通信機 | 5,800 | 826.00 | 4,790,800 | |
| 電気興業 | 6,800 | 2,312.00 | 15,721,600 | |
| サンケン電気 | 15,800 | 10,760.00 | 170,008,000 | |
| ナカヨ | 2,100 | 1,134.00 | 2,381,400 | |
| アイホン | 10,300 | 2,223.00 | 22,896,900 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 1,106,800 | 1,866.50 | 2,065,842,200 | 貸付有価証券 397,400株 |
| セイコーエプソン | 217,600 | 2,015.00 | 438,464,000 | 貸付有価証券 15,900株 |
| ワコム | 129,000 | 732.00 | 94,428,000 | 貸付有価証券 28,800株 |
| アルバック | 40,300 | 5,450.00 | 219,635,000 | 貸付有価証券 3,000株 |
| アクセル | 4,900 | 1,398.00 | 6,850,200 | |
| EIZO | 12,400 | 4,425.00 | 54,870,000 | 貸付有価証券 500株 |

| | | | | |
|-----------------|-----------|-----------|----------------|---------------------------|
| 日本信号 | 38,600 | 1,156.00 | 44,621,600 | |
| 京三製作所 | 35,500 | 428.00 | 15,194,000 | |
| 能美防災 | 22,900 | 1,816.00 | 41,586,400 | |
| ホーチキ | 12,700 | 1,634.00 | 20,751,800 | |
| 星和電機 | 5,200 | 482.00 | 2,506,400 | |
| エレコム | 40,500 | 1,290.00 | 52,245,000 | |
| パナソニック ホールディングス | 2,003,700 | 1,297.00 | 2,598,798,900 | |
| シャープ | 204,300 | 992.00 | 202,665,600 | 貸付有価証券 84,500株(1,200株) |
| アンリツ | 119,500 | 1,225.00 | 146,387,500 | |
| 富士通ゼネラル | 48,100 | 3,395.00 | 163,299,500 | 貸付有価証券 2,100株 |
| ソニーグループ | 1,188,100 | 12,520.00 | 14,875,012,000 | 貸付有価証券 7,700株 |
| TDK | 268,600 | 4,875.00 | 1,309,425,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 帝国通信工業 | 7,600 | 1,542.00 | 11,719,200 | |
| タムラ製作所 | 72,800 | 802.00 | 58,385,600 | 貸付有価証券 10,300株 |
| アルプスアルパイン | 151,500 | 1,214.00 | 183,921,000 | 貸付有価証券 16,200株 |
| 池上通信機 | 4,200 | 588.00 | 2,469,600 | |
| 日本電波工業 | 20,300 | 1,184.00 | 24,035,200 | 貸付有価証券 7,500株(1,100株) |
| 鈴木 | 9,000 | 1,028.00 | 9,252,000 | |
| メイコー | 18,500 | 2,665.00 | 49,302,500 | 貸付有価証券 400株 |
| 日本トリム | 3,800 | 2,994.00 | 11,377,200 | |
| ローランド ディー. ジー. | 9,300 | 3,495.00 | 32,503,500 | |
| フォスター電機 | 15,700 | 1,232.00 | 19,342,400 | |
| SMK | 4,100 | 2,408.00 | 9,872,800 | |
| ヨコオ | 13,500 | 2,050.00 | 27,675,000 | |
| ティアック | 20,400 | 116.00 | 2,366,400 | 貸付有価証券 200株 |
| ホシデン | 39,600 | 1,867.00 | 73,933,200 | |
| ヒロセ電機 | 28,100 | 18,760.00 | 527,156,000 | |
| 日本航空電子工業 | 34,800 | 2,484.00 | 86,443,200 | 貸付有価証券 10,800株(9,500株) |
| TOA | 19,300 | 855.00 | 16,501,500 | 貸付有価証券 100株 |

| | | | | |
|-------------|---------|-----------|----------------|---------------------------|
| マクセル | 34,300 | 1,476.00 | 50,626,800 | |
| 古野電気 | 22,000 | 949.00 | 20,878,000 | |
| スミダコーポレーション | 15,500 | 1,667.00 | 25,838,500 | |
| アイコム | 6,500 | 2,837.00 | 18,440,500 | 貸付有価証券 200株 |
| リオン | 7,000 | 1,857.00 | 12,999,000 | |
| 横河電機 | 185,600 | 2,472.00 | 458,803,200 | 貸付有価証券 2,800株 |
| 新電元工業 | 6,500 | 3,545.00 | 23,042,500 | 貸付有価証券 1,500株 |
| アズビル | 117,300 | 3,900.00 | 457,470,000 | 貸付有価証券 3,500株 |
| 東亜ディーケーケー | 6,100 | 838.00 | 5,111,800 | 貸付有価証券 300株 (300株) |
| 日本光電工業 | 77,600 | 3,860.00 | 299,536,000 | 貸付有価証券 5,000株 |
| チノー | 7,000 | 2,145.00 | 15,015,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 共和電業 | 12,200 | 360.00 | 4,392,000 | |
| 日本電子材料 | 11,100 | 1,407.00 | 15,617,700 | |
| 堀場製作所 | 37,400 | 7,640.00 | 285,736,000 | 貸付有価証券 4,100株 |
| アドバンテスト | 132,300 | 11,450.00 | 1,514,835,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 小野測器 | 4,800 | 461.00 | 2,212,800 | |
| エスペック | 13,400 | 2,076.00 | 27,818,400 | |
| キーエンス | 168,000 | 64,110.00 | 10,770,480,000 | 貸付有価証券 19,200株 |
| 日置電機 | 8,800 | 9,150.00 | 80,520,000 | 貸付有価証券 500株 |
| シスメックス | 144,900 | 9,010.00 | 1,305,549,000 | |
| 日本マイクロニクス | 27,700 | 1,269.00 | 35,151,300 | |
| メガチップス | 13,800 | 3,320.00 | 45,816,000 | |
| OBARA GROUP | 9,200 | 4,040.00 | 37,168,000 | 貸付有価証券 4,000株 (4,000株) |
| 澤藤電機 | 1,500 | 1,131.00 | 1,696,500 | |
| 原田工業 | 5,700 | 818.00 | 4,662,600 | 貸付有価証券 2,600株 |
| コーセル | 20,200 | 1,120.00 | 22,624,000 | 貸付有価証券 100株 |
| イリソ電子工業 | 15,400 | 4,540.00 | 69,916,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| オプテックスグループ | 30,800 | 2,100.00 | 64,680,000 | |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| 千代田インテグレ | 5,800 | 2,369.00 | 13,740,200 | |
| レーザーテック | 77,000 | 17,820.00 | 1,372,140,000 | 貸付有価証券 35,300株 |
| スタンレー電気 | 119,500 | 2,953.00 | 352,883,500 | |
| 岩崎電気 | 1,500 | 4,450.00 | 6,675,000 | |
| ウシオ電機 | 85,300 | 1,743.00 | 148,677,900 | |
| 岡谷電機産業 | 10,100 | 312.00 | 3,151,200 | 貸付有価証券 500株 |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 12,000 | 818.00 | 9,816,000 | 貸付有価証券 6,300株 (1,400株) |
| エノモト | 3,300 | 1,714.00 | 5,656,200 | 貸付有価証券 100株 |
| 日本セラミック | 17,100 | 2,809.00 | 48,033,900 | |
| 遠藤照明 | 5,800 | 1,384.00 | 8,027,200 | 貸付有価証券 300株 |
| 古河電池 | 12,400 | 1,126.00 | 13,962,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 双信電機 | 5,300 | 377.00 | 1,998,100 | |
| 山一電機 | 14,700 | 1,839.00 | 27,033,300 | |
| 図研 | 14,600 | 3,455.00 | 50,443,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 日本電子 | 42,100 | 4,110.00 | 173,031,000 | |
| カシオ計算機 | 125,100 | 1,329.00 | 166,257,900 | 貸付有価証券 2,100株 |
| ファナック | 824,300 | 4,646.00 | 3,829,697,800 | 貸付有価証券 9,700株 |
| 日本シイエムケイ | 35,700 | 480.00 | 17,136,000 | |
| エンプラス | 4,900 | 4,230.00 | 20,727,000 | |
| 大真空 | 20,500 | 694.00 | 14,227,000 | 貸付有価証券 5,100株 (4,300株) |
| ローム | 77,600 | 11,180.00 | 867,568,000 | |
| 浜松ホトニクス | 134,800 | 7,390.00 | 996,172,000 | 貸付有価証券 6,200株 |
| 三井ハイテック | 17,400 | 8,390.00 | 145,986,000 | 貸付有価証券 8,100株 |
| 新光電気工業 | 59,400 | 4,115.00 | 244,431,000 | 貸付有価証券 3,100株 |
| 京セラ | 260,900 | 7,210.00 | 1,881,089,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 太陽誘電 | 81,800 | 4,050.00 | 331,290,000 | |
| 村田製作所 | 509,400 | 7,716.00 | 3,930,530,400 | 貸付有価証券 5,600株 |
| 双葉電子工業 | 32,000 | 525.00 | 16,800,000 | |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|-----------------------|
| 北陸電気工業 | 4,900 | 1,282.00 | 6,281,800 | 貸付有価証券 300株 |
| ニチコン | 34,300 | 1,375.00 | 47,162,500 | 貸付有価証券 8,900株 |
| 日本ケミコン | 16,600 | 2,156.00 | 35,789,600 | |
| KOA | 25,400 | 1,711.00 | 43,459,400 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 市光工業 | 24,200 | 529.00 | 12,801,800 | |
| 小糸製作所 | 202,000 | 2,630.00 | 531,260,000 | 貸付有価証券 2,600株 |
| ミツバ | 31,500 | 599.00 | 18,868,500 | |
| SCREENホールディングス | 28,700 | 11,420.00 | 327,754,000 | 貸付有価証券 500株 |
| キャノン電子 | 18,600 | 1,900.00 | 35,340,000 | |
| キャノン | 921,500 | 3,219.00 | 2,966,308,500 | 貸付有価証券 233,700株 |
| リコー | 421,100 | 1,043.00 | 439,207,300 | 貸付有価証券 30,700株 |
| 象印マホービン | 50,200 | 1,788.00 | 89,757,600 | 貸付有価証券 500株 (100株) |
| MUTOHホールディングス | 1,800 | 1,717.00 | 3,090,600 | |
| 東京エレクトロン | 355,500 | 15,630.00 | 5,556,465,000 | 貸付有価証券 2,900株 |
| イノテック | 11,200 | 1,391.00 | 15,579,200 | |
| トヨタ紡織 | 70,700 | 2,144.00 | 151,580,800 | |
| 芦森工業 | 2,400 | 1,495.00 | 3,588,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ユニプレス | 30,100 | 967.00 | 29,106,700 | |
| 豊田自動織機 | 122,800 | 7,960.00 | 977,488,000 | |
| モリタホールディングス | 29,500 | 1,584.00 | 46,728,000 | |
| 三櫻工業 | 25,600 | 676.00 | 17,305,600 | |
| デンソー | 346,400 | 8,170.00 | 2,830,088,000 | 貸付有価証券 4,300株 |
| 東海理化電機製作所 | 47,300 | 1,897.00 | 89,728,100 | |
| 川崎重工業 | 126,600 | 2,874.00 | 363,848,400 | 貸付有価証券 4,200株 |
| 名村造船所 | 33,500 | 422.00 | 14,137,000 | 貸付有価証券 15,700株 |
| 日本車輛製造 | 6,500 | 2,060.00 | 13,390,000 | |
| 三菱ロジスネクスト | 26,800 | 1,162.00 | 31,141,600 | 貸付有価証券 100株 |
| 近畿車輛 | 1,800 | 1,521.00 | 2,737,800 | |

| | | | | |
|--------------|-----------|----------|----------------|---------------------------|
| 日産自動車 | 2,385,800 | 507.20 | 1,210,077,760 | 貸付有価証券 93,900株 |
| いすゞ自動車 | 488,300 | 1,631.00 | 796,417,300 | |
| トヨタ自動車 | 9,222,400 | 1,931.50 | 17,813,065,600 | 貸付有価証券 60,800株 |
| 日野自動車 | 216,500 | 545.00 | 117,992,500 | 貸付有価証券 3,500株 |
| 三菱自動車工業 | 655,200 | 477.00 | 312,530,400 | 貸付有価証券 244,500株 |
| エフテック | 9,000 | 767.00 | 6,903,000 | |
| レシップホールディングス | 5,100 | 478.00 | 2,437,800 | |
| GMB | 2,600 | 1,882.00 | 4,893,200 | 貸付有価証券 1,200株 (1,000株) |
| ファルテック | 2,100 | 615.00 | 1,291,500 | |
| 武蔵精密工業 | 41,000 | 1,819.00 | 74,579,000 | 貸付有価証券 6,000株 |
| 日産車体 | 29,600 | 911.00 | 26,965,600 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 新明和工業 | 52,800 | 1,283.00 | 67,742,400 | |
| 極東開発工業 | 27,700 | 1,788.00 | 49,527,600 | 貸付有価証券 2,800株 |
| トピー工業 | 13,600 | 1,960.00 | 26,656,000 | |
| ティラド | 4,200 | 2,440.00 | 10,248,000 | |
| タチエス | 26,600 | 1,264.00 | 33,622,400 | |
| NOK | 65,200 | 1,882.00 | 122,706,400 | 貸付有価証券 1,700株 |
| フタバ産業 | 45,000 | 461.00 | 20,745,000 | |
| KYB | 16,200 | 4,340.00 | 70,308,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 大同メタル工業 | 32,800 | 534.00 | 17,515,200 | |
| プレス工業 | 75,000 | 545.00 | 40,875,000 | |
| ミクニ | 15,000 | 345.00 | 5,175,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 太平洋工業 | 38,500 | 1,205.00 | 46,392,500 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 河西工業 | 17,400 | 203.00 | 3,532,200 | 貸付有価証券 4,300株 (1,500株) |
| アイシン | 129,600 | 3,960.00 | 513,216,000 | 貸付有価証券 4,800株 |
| マツダ | 555,600 | 1,225.00 | 680,610,000 | 貸付有価証券 5,600株 |
| 今仙電機製作所 | 8,300 | 717.00 | 5,951,100 | 貸付有価証券 500株 (500株) |
| 本田技研工業 | 1,365,300 | 3,653.00 | 4,987,440,900 | |

| | | | | |
|------------|---------|-----------|---------------|----------------------------|
| スズキ | 308,500 | 4,843.00 | 1,494,065,500 | 貸付有価証券 8,200株 |
| SUBARU | 531,400 | 2,218.00 | 1,178,645,200 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 安永 | 5,700 | 1,020.00 | 5,814,000 | 貸付有価証券 3,000株 (2,400株) |
| ヤマハ発動機 | 264,000 | 3,455.00 | 912,120,000 | 貸付有価証券 63,200株 (8,700株) |
| TBK | 12,900 | 288.00 | 3,715,200 | 貸付有価証券 100株 |
| エクセディ | 27,500 | 2,082.00 | 57,255,000 | |
| 豊田合成 | 49,000 | 2,335.00 | 114,415,000 | |
| 愛三工業 | 27,700 | 954.00 | 26,425,800 | |
| 盟和産業 | 1,800 | 973.00 | 1,751,400 | |
| 日本プラスト | 10,200 | 428.00 | 4,365,600 | 貸付有価証券 500株 |
| ヨロズ | 15,700 | 889.00 | 13,957,300 | |
| エフ・シー・シー | 29,800 | 1,732.00 | 51,613,600 | |
| シマノ | 68,700 | 21,010.00 | 1,443,387,000 | 貸付有価証券 3,900株 |
| テイ・エス テック | 76,900 | 1,872.00 | 143,956,800 | |
| ジャムコ | 7,100 | 1,427.00 | 10,131,700 | 貸付有価証券 900株 (800株) |
| テルモ | 516,600 | 4,138.00 | 2,137,690,800 | 貸付有価証券 400株 |
| クリエートメディック | 4,200 | 903.00 | 3,792,600 | |
| 日機装 | 39,100 | 942.00 | 36,832,200 | |
| 日本エム・ディ・エム | 10,000 | 973.00 | 9,730,000 | |
| 島津製作所 | 204,600 | 4,190.00 | 857,274,000 | 貸付有価証券 5,100株 |
| JMS | 15,500 | 530.00 | 8,215,000 | 貸付有価証券 100株 |
| クボテック | 3,000 | 207.00 | 621,000 | 貸付有価証券 1,400株 (100株) |
| 長野計器 | 12,200 | 1,298.00 | 15,835,600 | |
| ブイ・テクノロジー | 8,200 | 3,085.00 | 25,297,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 東京計器 | 12,900 | 1,236.00 | 15,944,400 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 愛知時計電機 | 6,500 | 1,553.00 | 10,094,500 | |
| インターアクション | 8,000 | 1,339.00 | 10,712,000 | |
| オーバル | 11,500 | 440.00 | 5,060,000 | 貸付有価証券 5,300株 (2,200株) |

| | | | | |
|-------------------|-----------|-----------|---------------|----------------------------|
| 東京精密 | 36,800 | 5,150.00 | 189,520,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| マニー | 67,200 | 1,702.00 | 114,374,400 | 貸付有価証券 100株 |
| ニコン | 242,800 | 1,461.00 | 354,730,800 | 貸付有価証券 12,500株 |
| トプコン | 88,400 | 1,973.00 | 174,413,200 | 貸付有価証券 2,800株 |
| オリンパス | 1,033,800 | 2,428.00 | 2,510,066,400 | |
| 理研計器 | 10,400 | 5,170.00 | 53,768,000 | |
| タムロン | 12,600 | 3,465.00 | 43,659,000 | |
| HOYA | 358,700 | 14,940.00 | 5,358,978,000 | 貸付有価証券 5,400株 |
| シード | 6,600 | 592.00 | 3,907,200 | |
| ノーリツ鋼機 | 15,900 | 2,317.00 | 36,840,300 | 貸付有価証券 2,200株 |
| A&Dホロンホールディングス | 24,500 | 1,331.00 | 32,609,500 | 貸付有価証券 1,800株 (1,800株) |
| 朝日インテック | 187,700 | 2,522.00 | 473,379,400 | |
| シチズン時計 | 184,700 | 767.00 | 141,664,900 | 貸付有価証券 55,000株 (5,900株) |
| リズム | 4,100 | 2,005.00 | 8,220,500 | |
| 大研医器 | 9,800 | 498.00 | 4,880,400 | |
| メニコン | 57,700 | 2,899.00 | 167,272,300 | 貸付有価証券 2,700株 |
| シンシア | 1,200 | 600.00 | 720,000 | 貸付有価証券 600株 (600株) |
| 松風 | 7,600 | 2,031.00 | 15,435,600 | 貸付有価証券 600株 (600株) |
| セイコーグループ | 26,000 | 2,741.00 | 71,266,000 | |
| ニプロ | 140,000 | 1,027.00 | 143,780,000 | 貸付有価証券 2,100株 |
| KYORITSU | 19,400 | 148.00 | 2,871,200 | |
| 中本パックス | 4,000 | 1,578.00 | 6,312,000 | |
| スノーピーク | 28,700 | 2,063.00 | 59,208,100 | 貸付有価証券 13,400株 (1,300株) |
| パラマウントベッドホールディングス | 38,800 | 2,431.00 | 94,322,800 | 貸付有価証券 2,700株 |
| トランザクション | 11,100 | 1,793.00 | 19,902,300 | 貸付有価証券 600株 |
| 粧美堂 | 3,500 | 383.00 | 1,340,500 | 貸付有価証券 2,000株 |
| ニホンフラッシュ | 15,700 | 1,075.00 | 16,877,500 | |
| 前田工織 | 14,200 | 3,255.00 | 46,221,000 | 貸付有価証券 6,600株 (6,300株) |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| 永大産業 | 13,900 | 222.00 | 3,085,800 | |
| アートネイチャー | 17,300 | 773.00 | 13,372,900 | |
| バンダイナムコホールディングス | 460,100 | 3,097.00 | 1,424,929,700 | 貸付有価証券 700株 |
| アイフィスジャパン | 3,600 | 619.00 | 2,228,400 | 貸付有価証券 200株 |
| SHOEI | 38,000 | 2,531.00 | 96,178,000 | |
| フランスベッドホールディングス | 20,800 | 1,111.00 | 23,108,800 | |
| パイロットコーポレーション | 26,300 | 4,540.00 | 119,402,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 萩原工業 | 11,200 | 1,271.00 | 14,235,200 | 貸付有価証券 5,200株 |
| フジシールインターナショナル | 34,000 | 1,542.00 | 52,428,000 | |
| タカラトミー | 77,600 | 1,520.00 | 117,952,000 | |
| 広済堂ホールディングス | 8,800 | 2,649.00 | 23,311,200 | 貸付有価証券 1,900株 (1,800株) |
| エステールホールディングス | 3,000 | 608.00 | 1,824,000 | |
| タカノ | 4,800 | 741.00 | 3,556,800 | 貸付有価証券 2,500株 |
| プロネクサス | 13,900 | 993.00 | 13,802,700 | |
| ホクシン | 10,000 | 136.00 | 1,360,000 | 貸付有価証券 4,700株 (1,100株) |
| ウッドワン | 4,300 | 1,133.00 | 4,871,900 | 貸付有価証券 2,000株 (1,500株) |
| 大建工業 | 10,200 | 2,411.00 | 24,592,200 | |
| 凸版印刷 | 219,600 | 2,873.00 | 630,910,800 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 大日本印刷 | 183,500 | 3,935.00 | 722,072,500 | 貸付有価証券 800株 |
| 共同印刷 | 4,700 | 2,838.00 | 13,338,600 | |
| NISSHA | 31,900 | 1,892.00 | 60,354,800 | 貸付有価証券 600株 |
| 光村印刷 | 1,100 | 1,251.00 | 1,376,100 | |
| TAKARA & COMPANY | 10,700 | 2,456.00 | 26,279,200 | 貸付有価証券 5,000株 |
| アシックス | 155,000 | 3,875.00 | 600,625,000 | 貸付有価証券 11,100株 |
| ツツミ | 2,900 | 2,231.00 | 6,469,900 | |
| ローランド | 12,400 | 4,275.00 | 53,010,000 | |
| 小松ウオール工業 | 6,200 | 2,387.00 | 14,799,400 | |
| ヤマハ | 105,900 | 5,370.00 | 568,683,000 | 貸付有価証券 900株 |

| | | | | |
|--------------|-----------|----------|---------------|--------------------|
| 河合楽器製作所 | 4,500 | 3,185.00 | 14,332,500 | |
| クリナップ | 18,800 | 715.00 | 13,442,000 | |
| ビジョン | 107,000 | 2,106.00 | 225,342,000 | 貸付有価証券 100株 |
| キングジム | 14,800 | 917.00 | 13,571,600 | 貸付有価証券 6,900株 |
| リンテック | 33,700 | 2,231.00 | 75,184,700 | |
| イトーキ | 34,400 | 837.00 | 28,792,800 | |
| 任天堂 | 1,060,400 | 5,725.00 | 6,070,790,000 | 貸付有価証券 17,000株 |
| 三菱鉛筆 | 23,800 | 1,797.00 | 42,768,600 | |
| タカラスタンダード | 30,900 | 1,677.00 | 51,819,300 | 貸付有価証券 1,100株 |
| コクヨ | 80,900 | 1,999.00 | 161,719,100 | |
| ナカバヤシ | 18,100 | 481.00 | 8,706,100 | |
| グローブライド | 13,600 | 2,490.00 | 33,864,000 | |
| オカムラ | 50,600 | 1,515.00 | 76,659,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 美津濃 | 16,700 | 3,380.00 | 56,446,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 東京電力ホールディングス | 1,514,000 | 492.00 | 744,888,000 | 貸付有価証券 187,800株 |
| 中部電力 | 618,900 | 1,573.00 | 973,529,700 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 関西電力 | 648,600 | 1,482.00 | 961,225,200 | |
| 中国電力 | 267,500 | 728.00 | 194,740,000 | 貸付有価証券 700株 |
| 北陸電力 | 158,500 | 670.00 | 106,195,000 | 貸付有価証券 7,100株 |
| 東北電力 | 410,600 | 726.00 | 298,095,600 | 貸付有価証券 900株 |
| 四国電力 | 143,400 | 826.00 | 118,448,400 | |
| 九州電力 | 387,200 | 840.00 | 325,248,000 | |
| 北海道電力 | 162,300 | 529.00 | 85,856,700 | |
| 沖縄電力 | 39,300 | 1,120.00 | 44,016,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 電源開発 | 126,500 | 2,225.00 | 281,462,500 | |
| エフオン | 10,900 | 673.00 | 7,335,700 | |
| イーレックス | 29,800 | 1,803.00 | 53,729,400 | 貸付有価証券 600株 |
| レノバ | 44,700 | 1,626.00 | 72,682,200 | 貸付有価証券 5,100株 |
| 東京瓦斯 | 355,100 | 2,912.00 | 1,034,051,200 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------|---------|-----------|---------------|--------------------|
| | | | | 700 株 |
| 大阪瓦斯 | 340,200 | 2,248.00 | 764,769,600 | |
| 東邦瓦斯 | 66,100 | 2,560.00 | 169,216,000 | |
| 北海道瓦斯 | 10,000 | 2,087.00 | 20,870,000 | |
| 広島ガス | 35,400 | 376.00 | 13,310,400 | |
| 西部ガスホールディングス | 15,800 | 1,948.00 | 30,778,400 | |
| 静岡ガス | 38,300 | 1,157.00 | 44,313,100 | 貸付有価証券 900 株 |
| メタウォーター | 21,000 | 1,799.00 | 37,779,000 | |
| SBSホールディングス | 15,000 | 3,170.00 | 47,550,000 | 貸付有価証券 1,800 株 |
| 東武鉄道 | 184,500 | 3,590.00 | 662,355,000 | 貸付有価証券 300 株 |
| 相鉄ホールディングス | 55,500 | 2,679.00 | 148,684,500 | |
| 東急 | 471,000 | 1,955.00 | 920,805,000 | 貸付有価証券 32,500 株 |
| 京浜急行電鉄 | 190,500 | 1,341.00 | 255,460,500 | |
| 小田急電鉄 | 254,600 | 2,069.00 | 526,767,400 | 貸付有価証券 11,500 株 |
| 京王電鉄 | 88,800 | 5,180.00 | 459,984,000 | 貸付有価証券 4,800 株 |
| 京成電鉄 | 108,300 | 5,020.00 | 543,666,000 | 貸付有価証券 1,100 株 |
| 富士急行 | 20,700 | 5,320.00 | 110,124,000 | 貸付有価証券 200 株 |
| 東日本旅客鉄道 | 284,800 | 7,923.00 | 2,256,470,400 | |
| 西日本旅客鉄道 | 214,600 | 6,007.00 | 1,289,102,200 | |
| 東海旅客鉄道 | 129,400 | 16,785.00 | 2,171,979,000 | 貸付有価証券 2,600 株 |
| 西武ホールディングス | 203,200 | 1,571.00 | 319,227,200 | |
| 鴻池運輸 | 28,600 | 1,647.00 | 47,104,200 | |
| 西日本鉄道 | 44,900 | 2,516.00 | 112,968,400 | 貸付有価証券 3,200 株 |
| ハマキョウレックス | 13,100 | 3,545.00 | 46,439,500 | |
| サカイ引越センター | 8,000 | 4,825.00 | 38,600,000 | |
| 近鉄グループホールディングス | 167,700 | 4,685.00 | 785,674,500 | 貸付有価証券 7,000 株 |
| 阪急阪神ホールディングス | 223,600 | 4,340.00 | 970,424,000 | 貸付有価証券 6,800 株 |
| 南海電気鉄道 | 80,100 | 3,250.00 | 260,325,000 | 貸付有価証券 600 株 |
| 京阪ホールディングス | 92,400 | 3,795.00 | 350,658,000 | |

| | | | | |
|--------------------------|---------|----------|---------------|-------------------|
| 神戸電鉄 | 4,600 | 3,235.00 | 14,881,000 | |
| 名古屋鉄道 | 185,300 | 2,245.00 | 415,998,500 | |
| 山陽電気鉄道 | 12,600 | 2,396.00 | 30,189,600 | 貸付有価証券 5,800株 |
| アルプス物流 | 13,400 | 1,234.00 | 16,535,600 | |
| ヤマトホールディングス | 214,700 | 2,382.00 | 511,415,400 | 貸付有価証券 100株 |
| 山九 | 42,700 | 5,090.00 | 217,343,000 | |
| 丸運 | 6,400 | 243.00 | 1,555,200 | 貸付有価証券 1,300株 |
| 丸全昭和運輸 | 10,400 | 3,460.00 | 35,984,000 | |
| センコーグループホール ディングス | 88,800 | 975.00 | 86,580,000 | |
| トナミホールディングス | 3,700 | 4,645.00 | 17,186,500 | |
| ニッコンホールディング ス | 53,700 | 2,705.00 | 145,258,500 | 貸付有価証券 300株 |
| 日本石油輸送 | 1,300 | 2,670.00 | 3,471,000 | |
| 福山通運 | 12,800 | 3,695.00 | 47,296,000 | |
| セイノーホールディング ス | 104,400 | 1,516.00 | 158,270,400 | 貸付有価証券 200株 |
| エスライン | 3,700 | 806.00 | 2,982,200 | |
| 神奈川中央交通 | 4,700 | 3,210.00 | 15,087,000 | |
| AZ-COM丸和ホール ディングス | 40,500 | 2,028.00 | 82,134,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| C&Fロジホールディン グス | 16,100 | 1,225.00 | 19,722,500 | |
| 九州旅客鉄道 | 118,600 | 3,090.00 | 366,474,000 | |
| SGホールディングス | 321,800 | 2,119.00 | 681,894,200 | |
| NIPPON EXPRESS ホールディン | 62,600 | 8,300.00 | 519,580,000 | 貸付有価証券 7,400株 |
| 日本郵船 | 448,600 | 3,210.00 | 1,440,006,000 | 貸付有価証券 26,100株 |
| 商船三井 | 295,600 | 3,245.00 | 959,222,000 | 貸付有価証券 33,800株 |
| 川崎汽船 | 126,000 | 3,465.00 | 436,590,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| NSユニテッド海運 | 9,000 | 3,605.00 | 32,445,000 | 貸付有価証券 4,200株 |
| 明治海運 | 12,700 | 612.00 | 7,772,400 | 貸付有価証券 6,700株 |
| 飯野海運 | 61,600 | 833.00 | 51,312,800 | |
| 共栄タンカー | 2,400 | 915.00 | 2,196,000 | 貸付有価証券 100株 |

| | | | | |
|----------------|---------|----------|---------------|--------------------------|
| 乾汽船 | 21,300 | 1,648.00 | 35,102,400 | 貸付有価証券 9,400株(1,400株) |
| 日本航空 | 411,800 | 2,646.00 | 1,089,622,800 | 貸付有価証券 7,000株 |
| A N Aホールディングス | 456,300 | 3,014.00 | 1,375,288,200 | 貸付有価証券 45,200株 |
| パスコ | 2,500 | 1,568.00 | 3,920,000 | |
| トランコム | 4,900 | 6,820.00 | 33,418,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 日新 | 12,700 | 2,305.00 | 29,273,500 | |
| 三菱倉庫 | 36,000 | 3,455.00 | 124,380,000 | 貸付有価証券 600株 |
| 三井倉庫ホールディングス | 15,700 | 4,075.00 | 63,977,500 | 貸付有価証券 400株 |
| 住友倉庫 | 45,200 | 2,306.00 | 104,231,200 | |
| 澁澤倉庫 | 6,700 | 2,365.00 | 15,845,500 | |
| 東陽倉庫 | 17,300 | 286.00 | 4,947,800 | |
| 日本トランスシティ | 33,700 | 664.00 | 22,376,800 | |
| ケイヒン | 2,300 | 1,726.00 | 3,969,800 | |
| 中央倉庫 | 8,100 | 1,088.00 | 8,812,800 | |
| 川西倉庫 | 2,200 | 1,007.00 | 2,215,400 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 安田倉庫 | 11,400 | 985.00 | 11,229,000 | |
| ファイズホールディングス | 2,400 | 1,517.00 | 3,640,800 | |
| 東洋埠頭 | 3,700 | 1,459.00 | 5,398,300 | 貸付有価証券 100株 |
| 上組 | 80,400 | 3,030.00 | 243,612,000 | 貸付有価証券 1,700株 |
| サンリツ | 2,900 | 748.00 | 2,169,200 | |
| キムラユニティー | 6,200 | 1,128.00 | 6,993,600 | |
| キューソー流通システム | 7,800 | 1,023.00 | 7,979,400 | 貸付有価証券 3,800株 |
| 東海運 | 7,600 | 305.00 | 2,318,000 | 貸付有価証券 3,500株(1,500株) |
| エーアイティー | 10,500 | 1,615.00 | 16,957,500 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 内外トランスライン | 6,000 | 2,556.00 | 15,336,000 | |
| 日本コンセプト | 5,200 | 1,654.00 | 8,600,800 | |
| N E C ネットズエスアイ | 56,300 | 1,846.00 | 103,929,800 | |
| クロスキャット | 9,600 | 1,251.00 | 12,009,600 | 貸付有価証券 1,300株 |
| システナ | 283,200 | 291.00 | 82,411,200 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|----------------------------|
| デジタルアーツ | 10,700 | 5,620.00 | 60,134,000 | |
| 日鉄ソリューションズ | 28,700 | 3,970.00 | 113,939,000 | |
| キューブシステム | 10,000 | 1,167.00 | 11,670,000 | 貸付有価証券 3,400株 |
| コア | 7,500 | 1,711.00 | 12,832,500 | |
| 手間いらず | 2,800 | 4,520.00 | 12,656,000 | |
| ラクーンホールディングス | 14,000 | 722.00 | 10,108,000 | 貸付有価証券 6,500株 |
| ソリトンシステムズ | 8,700 | 1,019.00 | 8,865,300 | |
| ソフトクリエイトホールディングス | 13,800 | 1,727.00 | 23,832,600 | |
| T I S | 184,200 | 3,905.00 | 719,301,000 | 貸付有価証券 3,900株 |
| J N S ホールディングス | 6,000 | 415.00 | 2,490,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| グリー | 45,200 | 714.00 | 32,272,800 | 貸付有価証券 200株 |
| GMOペパボ | 2,400 | 1,707.00 | 4,096,800 | |
| コーエーテクモホールディングス | 105,500 | 2,422.00 | 255,521,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 三菱総合研究所 | 8,300 | 5,050.00 | 41,915,000 | |
| ボルテージ | 3,700 | 313.00 | 1,158,100 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| 電算 | 1,500 | 1,798.00 | 2,697,000 | |
| A G S | 5,500 | 720.00 | 3,960,000 | |
| ファインデックス | 13,400 | 645.00 | 8,643,000 | |
| ブレインパッド | 12,600 | 705.00 | 8,883,000 | 貸付有価証券 500株 |
| K L a b | 33,600 | 388.00 | 13,036,800 | 貸付有価証券 13,900株 (2,100株) |
| ポルトゥウィンホールディングス | 28,800 | 934.00 | 26,899,200 | 貸付有価証券 900株 |
| ネクソン | 436,200 | 3,005.00 | 1,310,781,000 | 貸付有価証券 42,300株 |
| アイスタイル | 49,000 | 517.00 | 25,333,000 | 貸付有価証券 22,900株 (3,500株) |
| エムアップホールディングス | 20,600 | 1,203.00 | 24,781,800 | 貸付有価証券 9,500株 |
| エイチーム | 9,900 | 679.00 | 6,722,100 | |
| エニグモ | 21,400 | 419.00 | 8,966,600 | 貸付有価証券 1,600株 |
| テクノスジャパン | 10,800 | 567.00 | 6,123,600 | |
| e n i s h | 9,900 | 541.00 | 5,355,900 | 貸付有価証券 2,000株 (1,100株) |

| | | | | |
|--------------------------|--------|-----------|-------------|-------------------------|
| コロプラ | 65,300 | 640.00 | 41,792,000 | 貸付有価証券 900株 |
| オルトプラス | 10,000 | 204.00 | 2,040,000 | 貸付有価証券 4,100株 |
| ブロードリーフ | 98,400 | 440.00 | 43,296,000 | 貸付有価証券 20,000株 |
| クロス・マーケティング グループ | 7,900 | 689.00 | 5,443,100 | 貸付有価証券 300株 |
| デジタルハーツホールデ ィングス | 10,500 | 1,501.00 | 15,760,500 | |
| システム情報 | 13,400 | 781.00 | 10,465,400 | |
| メディアドゥ | 6,800 | 1,367.00 | 9,295,600 | |
| じげん | 49,100 | 517.00 | 25,384,700 | 貸付有価証券 400株 |
| ブイキューブ | 20,200 | 522.00 | 10,544,400 | 貸付有価証券 4,300株 |
| エンカレッジ・テクノ ロジ | 3,000 | 526.00 | 1,578,000 | |
| サイバーリンクス | 4,200 | 903.00 | 3,792,600 | |
| ディー・エル・イー | 9,300 | 241.00 | 2,241,300 | 貸付有価証券 1,800株 |
| フィックスターズ | 19,000 | 1,406.00 | 26,714,000 | |
| CARTA HOLD I NGS | 7,900 | 1,468.00 | 11,597,200 | 貸付有価証券 1,200株 |
| オブティム | 13,900 | 938.00 | 13,038,200 | |
| セレス | 6,800 | 1,417.00 | 9,635,600 | 貸付有価証券 800株 |
| SHIFT | 11,200 | 24,450.00 | 273,840,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| ティーガイア | 17,600 | 1,648.00 | 29,004,800 | |
| セック | 1,800 | 3,245.00 | 5,841,000 | |
| テクマトリックス | 30,800 | 1,826.00 | 56,240,800 | 貸付有価証券 100株 |
| プロシップ | 7,400 | 1,374.00 | 10,167,600 | |
| ガンホー・オンライン・ エンターテイメント | 49,300 | 2,704.00 | 133,307,200 | 貸付有価証券 18,000株 |
| GMOペイメントゲート ウェイ | 33,700 | 10,690.00 | 360,253,000 | 貸付有価証券 200株 |
| ザッパラス | 3,600 | 359.00 | 1,292,400 | 貸付有価証券 1,400株 (800株) |
| システムリサーチ | 5,300 | 2,403.00 | 12,735,900 | |
| インターネットイニシア ティブ | 94,000 | 2,812.00 | 264,328,000 | |
| さくらインターネット | 18,900 | 665.00 | 12,568,500 | 貸付有価証券 600株 |

| | | | | |
|---------------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| ヴィンクス | 3,900 | 1,401.00 | 5,463,900 | 貸付有価証券 300株 |
| GMOグローバルサイ ン・ホールディングス | 5,100 | 4,135.00 | 21,088,500 | 貸付有価証券 500株(100株) |
| SRAホールディングス | 8,600 | 3,085.00 | 26,531,000 | |
| システムインテグレータ | 3,900 | 428.00 | 1,669,200 | |
| 朝日ネット | 18,100 | 591.00 | 10,697,100 | |
| eBASE | 23,700 | 715.00 | 16,945,500 | |
| アバントグループ | 21,300 | 1,369.00 | 29,159,700 | 貸付有価証券 200株 |
| アドソル日進 | 7,100 | 1,837.00 | 13,042,700 | |
| ODKソリューションズ | 2,900 | 597.00 | 1,731,300 | |
| フリービット | 8,800 | 1,529.00 | 13,455,200 | 貸付有価証券 2,400株 |
| コムチュア | 22,300 | 2,045.00 | 45,603,500 | |
| サイバーコム | 2,100 | 1,568.00 | 3,292,800 | |
| アステリア | 13,200 | 623.00 | 8,223,600 | 貸付有価証券 6,200株(3,600株) |
| アイル | 7,900 | 2,760.00 | 21,804,000 | |
| マークライنز | 9,100 | 2,311.00 | 21,030,100 | |
| メディカル・データ・ビ ジョン | 25,100 | 850.00 | 21,335,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| gumi | 24,700 | 729.00 | 18,006,300 | 貸付有価証券 8,100株 |
| ショーケース | 3,000 | 310.00 | 930,000 | |
| モバイルファクトリー | 2,700 | 910.00 | 2,457,000 | 貸付有価証券 1,100株(1,100株) |
| テラスカイ | 7,300 | 2,607.00 | 19,031,100 | 貸付有価証券 100株(100株) |
| デジタル・インフォメー ション・テクノロジー | 9,700 | 1,637.00 | 15,878,900 | |
| PCIホールディングス | 5,000 | 1,039.00 | 5,195,000 | 貸付有価証券 700株(400株) |
| アイビーシー | 2,000 | 597.00 | 1,194,000 | 貸付有価証券 1,000株(900株) |
| ネオジャパン | 5,600 | 926.00 | 5,185,600 | |
| PR TIMES | 4,200 | 1,405.00 | 5,901,000 | 貸付有価証券 600株 |
| ラクス | 79,700 | 2,066.00 | 164,660,200 | |
| ランドコンピュータ | 3,200 | 1,122.00 | 3,590,400 | |
| ダブルスタンダード | 6,800 | 2,098.00 | 14,266,400 | 貸付有価証券 1,700株 |
| オープンドア | 11,800 | 1,448.00 | 17,086,400 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-------------------|--------|----------|-------------|--------------------------|
| | | | | 5,500株(3,500株) |
| マイネット | 4,200 | 328.00 | 1,377,600 | |
| アカツキ | 8,000 | 2,271.00 | 18,168,000 | |
| ベネフィットジャパン | 800 | 1,293.00 | 1,034,400 | |
| Ubicomホールディングス | 5,200 | 2,377.00 | 12,360,400 | |
| カナミックネットワーク | 18,100 | 501.00 | 9,068,100 | |
| ノムラシステムコーポレーション | 12,300 | 113.00 | 1,389,900 | |
| チェンジホールディングス | 41,200 | 2,266.00 | 93,359,200 | 貸付有価証券 2,000株 |
| シンクロ・フード | 8,300 | 468.00 | 3,884,400 | 貸付有価証券 300株(300株) |
| オークネット | 8,300 | 1,717.00 | 14,251,100 | 貸付有価証券 3,500株 |
| キャピタル・アセット・プランニング | 2,500 | 706.00 | 1,765,000 | |
| セグエグループ | 3,600 | 807.00 | 2,905,200 | |
| エイトレッド | 2,000 | 1,456.00 | 2,912,000 | |
| マクロミル | 33,100 | 900.00 | 29,790,000 | |
| ビーグリー | 2,200 | 1,232.00 | 2,710,400 | 貸付有価証券 100株 |
| オロ | 5,100 | 2,403.00 | 12,255,300 | |
| ユーザーローカル | 6,100 | 1,877.00 | 11,449,700 | 貸付有価証券 2,800株(1,000株) |
| テモナ | 3,000 | 285.00 | 855,000 | 貸付有価証券 600株 |
| ニーズウェル | 3,600 | 1,086.00 | 3,909,600 | |
| マネーフォワード | 40,600 | 5,390.00 | 218,834,000 | 貸付有価証券 2,500株 |
| サインポスト | 5,100 | 593.00 | 3,024,300 | 貸付有価証券 1,800株(800株) |
| Sun Asterisk | 11,900 | 994.00 | 11,828,600 | 貸付有価証券 200株 |
| 電算システムホールディングス | 8,100 | 2,678.00 | 21,691,800 | |
| Appier Group | 63,800 | 1,435.00 | 91,553,000 | 貸付有価証券 300株 |
| ソルクシーズ | 10,600 | 360.00 | 3,816,000 | 貸付有価証券 100株 |
| フェイス | 3,600 | 518.00 | 1,864,800 | 貸付有価証券 400株 |
| プロトコーポレーション | 21,100 | 1,182.00 | 24,940,200 | |
| ハイマックス | 5,300 | 1,440.00 | 7,632,000 | |

| | | | | |
|------------------------|---------|----------|---------------|-----------------------------|
| 野村総合研究所 | 335,600 | 3,485.00 | 1,169,566,000 | 貸付有価証券 100株 |
| サイバネットシステム | 14,100 | 879.00 | 12,393,900 | 貸付有価証券 2,200株 |
| C Eホールディングス | 6,700 | 571.00 | 3,825,700 | 貸付有価証券 300株 (200株) |
| 日本システム技術 | 5,500 | 2,068.00 | 11,374,000 | |
| インテージホールディングス | 19,000 | 1,588.00 | 30,172,000 | 貸付有価証券 1,300株 (1,300株) |
| 東邦システムサイエンス | 3,700 | 1,124.00 | 4,158,800 | |
| ソースネクスト | 85,600 | 226.00 | 19,345,600 | 貸付有価証券 35,600株 (7,100株) |
| インフォコム | 21,700 | 2,225.00 | 48,282,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| シンプレクス・ホールディングス | 28,800 | 2,433.00 | 70,070,400 | |
| HEROZ | 5,700 | 1,264.00 | 7,204,800 | 貸付有価証券 2,600株 (600株) |
| ラクスル | 40,400 | 1,345.00 | 54,338,000 | 貸付有価証券 18,800株 (10,700株) |
| メルカリ | 101,400 | 2,665.00 | 270,231,000 | 貸付有価証券 7,900株 |
| I P S | 5,500 | 2,536.00 | 13,948,000 | 貸付有価証券 900株 (900株) |
| F I G | 15,100 | 289.00 | 4,363,900 | 貸付有価証券 7,900株 |
| システムサポート | 6,500 | 1,886.00 | 12,259,000 | |
| イーソル | 10,800 | 989.00 | 10,681,200 | |
| アルテリア・ネットワークス | 15,700 | 1,283.00 | 20,143,100 | |
| 東海ソフト | 1,900 | 1,053.00 | 2,000,700 | |
| ウイングアーク1st | 17,400 | 2,142.00 | 37,270,800 | 貸付有価証券 800株 |
| ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス | 4,500 | 1,580.00 | 7,110,000 | |
| サーバーワークス | 3,400 | 2,010.00 | 6,834,000 | 貸付有価証券 300株 (300株) |
| 東名 | 1,000 | 2,019.00 | 2,019,000 | 貸付有価証券 500株 |
| ヴィッツ | 1,300 | 1,185.00 | 1,540,500 | |
| トビラシステムズ | 3,300 | 963.00 | 3,177,900 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| S a n s a n | 55,100 | 1,685.00 | 92,843,500 | 貸付有価証券 1,000株 |
| L i n k - U | 3,100 | 985.00 | 3,053,500 | |

| | | | | |
|------------------|-----------|-----------|---------------|--------------------------|
| ギフトィ | 18,300 | 2,369.00 | 43,352,700 | 貸付有価証券 100株 |
| メドレー | 22,600 | 3,690.00 | 83,394,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ベース | 5,700 | 6,070.00 | 34,599,000 | |
| JMDC | 27,700 | 5,500.00 | 152,350,000 | 貸付有価証券 2,700株 |
| フォーカスシステムズ | 12,300 | 1,033.00 | 12,705,900 | |
| クレスコ | 13,000 | 1,798.00 | 23,374,000 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 161,800 | 1,321.00 | 213,737,800 | 貸付有価証券 500株 |
| オービック | 56,300 | 21,300.00 | 1,199,190,000 | |
| ジャストシステム | 24,200 | 3,955.00 | 95,711,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| TDCソフト | 14,200 | 1,522.00 | 21,612,400 | |
| Zホールディングス | 2,397,200 | 355.30 | 851,725,160 | 貸付有価証券 209,200株 |
| トレンドマイクロ | 97,300 | 6,610.00 | 643,153,000 | 貸付有価証券 10,600株 (700株) |
| IDホールディングス | 11,300 | 1,127.00 | 12,735,100 | |
| 日本オラクル | 32,200 | 10,590.00 | 340,998,000 | 貸付有価証券 300株 |
| アルファシステムズ | 5,300 | 4,210.00 | 22,313,000 | |
| フューチャー | 41,900 | 1,656.00 | 69,386,400 | |
| CAC Holdings | 10,300 | 1,747.00 | 17,994,100 | |
| SBテクノロジー | 7,100 | 2,458.00 | 17,451,800 | |
| トーセ | 3,800 | 742.00 | 2,819,600 | 貸付有価証券 100株 |
| オービックビジネスコンサルタント | 33,200 | 5,140.00 | 170,648,000 | |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 90,400 | 3,485.00 | 315,044,000 | 貸付有価証券 100株 |
| アイティフォー | 22,200 | 879.00 | 19,513,800 | |
| 東計電算 | 2,300 | 6,180.00 | 14,214,000 | |
| エクスネット | 1,800 | 1,003.00 | 1,805,400 | |
| 大塚商会 | 95,500 | 5,060.00 | 483,230,000 | 貸付有価証券 25,700株 |
| サイボウズ | 23,200 | 2,621.00 | 60,807,200 | 貸付有価証券 700株 |
| 電通国際情報サービス | 20,500 | 4,905.00 | 100,552,500 | |
| ACCESS | 19,900 | 851.00 | 16,934,900 | |
| デジタルガレージ | 29,900 | 4,895.00 | 146,360,500 | |

| | | | | |
|----------------------------|---------|----------|-------------|-------------------------|
| EMシステムズ | 28,100 | 791.00 | 22,227,100 | 貸付有価証券 1,100株 |
| ウェザーニューズ | 5,200 | 6,860.00 | 35,672,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| C I J | 28,000 | 556.00 | 15,568,000 | 貸付有価証券 800株 |
| ビジネスエンジニアリン グ | 2,800 | 3,635.00 | 10,178,000 | 貸付有価証券 1,300株 (300株) |
| 日本エンタープライズ | 13,600 | 144.00 | 1,958,400 | 貸付有価証券 100株 |
| WOWOW | 12,700 | 1,284.00 | 16,306,800 | 貸付有価証券 4,300株 |
| スカラ | 15,600 | 762.00 | 11,887,200 | |
| インテリジェント ウェ イブ | 6,900 | 726.00 | 5,009,400 | |
| WOW WORLD G ROUP | 1,400 | 1,497.00 | 2,095,800 | 貸付有価証券 400株 (100株) |
| I M A G I C A G R O U P | 14,100 | 617.00 | 8,699,700 | 貸付有価証券 2,800株 (800株) |
| ネットワンシステムズ | 62,800 | 3,315.00 | 208,182,000 | |
| システムソフト | 58,600 | 81.00 | 4,746,600 | 貸付有価証券 300株 |
| アルゴグラフィックス | 15,400 | 3,915.00 | 60,291,000 | |
| マーベラス | 27,400 | 675.00 | 18,495,000 | |
| エイベックス | 28,600 | 1,523.00 | 43,557,800 | |
| B I P R O G Y | 62,000 | 3,600.00 | 223,200,000 | |
| 都築電気 | 8,900 | 1,505.00 | 13,394,500 | |
| T B S ホールディングス | 86,200 | 2,121.00 | 182,830,200 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 日本テレビホールディン グス | 149,100 | 1,253.00 | 186,822,300 | 貸付有価証券 400株 |
| 朝日放送グループホール ディングス | 15,800 | 663.00 | 10,475,400 | 貸付有価証券 200株 |
| テレビ朝日ホールディン グス | 40,900 | 1,579.00 | 64,581,100 | |
| スカパー J S A T ホール ディングス | 149,400 | 568.00 | 84,859,200 | |
| テレビ東京ホールディン グス | 12,100 | 2,550.00 | 30,855,000 | |
| 日本BS放送 | 4,700 | 890.00 | 4,183,000 | 貸付有価証券 1,200株 |
| ビジョン | 22,200 | 1,606.00 | 35,653,200 | |
| スマートバリュー | 3,200 | 432.00 | 1,382,400 | |
| USEN-NEXT H OLDINGS | 18,900 | 2,971.00 | 56,151,900 | 貸付有価証券 1,300株 |

| | | | | |
|--------------------------|-----------|-----------|---------------|-------------------------|
| ワイヤレスゲート | 5,700 | 234.00 | 1,333,800 | 貸付有価証券 500株 (500株) |
| 日本通信 | 155,500 | 260.00 | 40,430,000 | 貸付有価証券 8,000株 |
| クロップス | 2,100 | 1,108.00 | 2,326,800 | |
| 日本電信電話 | 2,158,400 | 4,190.00 | 9,043,696,000 | |
| KDDI | 1,301,700 | 4,221.00 | 5,494,475,700 | 貸付有価証券 12,400株 |
| ソフトバンク | 2,706,000 | 1,533.50 | 4,149,651,000 | 貸付有価証券 20,100株 |
| 光通信 | 19,800 | 18,450.00 | 365,310,000 | 貸付有価証券 300株 |
| エムティーアイ | 11,500 | 511.00 | 5,876,500 | 貸付有価証券 3,100株 |
| GMOインターネットグループ | 62,200 | 2,683.00 | 166,882,600 | 貸付有価証券 5,600株 |
| ファイバーゲート | 9,100 | 1,262.00 | 11,484,200 | |
| アイドママーケティング コミュニケーション | 3,000 | 288.00 | 864,000 | |
| KADOKAWA | 89,100 | 2,872.00 | 255,895,200 | 貸付有価証券 6,700株 |
| 学研ホールディングス | 28,000 | 873.00 | 24,444,000 | |
| ゼンリン | 28,800 | 934.00 | 26,899,200 | |
| 昭文社ホールディングス | 5,600 | 296.00 | 1,657,600 | 貸付有価証券 1,000株 (500株) |
| インプレスホールディングス | 11,500 | 226.00 | 2,599,000 | |
| アイネット | 10,200 | 1,487.00 | 15,167,400 | |
| 松竹 | 9,600 | 12,240.00 | 117,504,000 | |
| 東宝 | 105,400 | 5,410.00 | 570,214,000 | 貸付有価証券 10,500株 |
| 東映 | 4,600 | 17,980.00 | 82,708,000 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 528,500 | 1,878.00 | 992,523,000 | 貸付有価証券 6,000株 |
| ピー・シー・エー | 9,700 | 1,127.00 | 10,931,900 | 貸付有価証券 700株 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 7,200 | 1,856.00 | 13,363,200 | |
| D T S | 35,900 | 3,280.00 | 117,752,000 | 貸付有価証券 400株 |
| スクウェア・エニックス ホールディングス | 84,700 | 6,580.00 | 557,326,000 | |
| シーイーシー | 23,600 | 1,417.00 | 33,441,200 | |
| カプコン | 167,400 | 5,270.00 | 882,198,000 | 貸付有価証券 5,100株 |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|-----------------------|
| アイ・エス・ビー | 8,600 | 1,506.00 | 12,951,600 | |
| ジャステック | 10,300 | 1,238.00 | 12,751,400 | |
| S C S K | 137,500 | 2,132.00 | 293,150,000 | |
| N S W | 6,600 | 2,137.00 | 14,104,200 | |
| アイネス | 11,800 | 1,421.00 | 16,767,800 | |
| T K C | 26,900 | 3,660.00 | 98,454,000 | |
| 富士ソフト | 19,000 | 8,330.00 | 158,270,000 | |
| N S D | 60,100 | 2,585.00 | 155,358,500 | 貸付有価証券 1,200株 |
| コナミグループ | 72,100 | 6,660.00 | 480,186,000 | 貸付有価証券 3,400株 |
| 福井コンピュータホールディングス | 11,700 | 2,654.00 | 31,051,800 | |
| J B C Cホールディングス | 12,300 | 2,244.00 | 27,601,200 | |
| ミロク情報サービス | 15,300 | 1,735.00 | 26,545,500 | 貸付有価証券 1,900株 |
| ソフトバンクグループ | 830,900 | 5,182.00 | 4,305,723,800 | 貸付有価証券 29,700株 |
| 高千穂交易 | 4,900 | 2,375.00 | 11,637,500 | 貸付有価証券 2,800株 |
| オルバヘルスケアホールディングス | 2,100 | 1,786.00 | 3,750,600 | 貸付有価証券 100株 |
| 伊藤忠食品 | 4,000 | 5,400.00 | 21,600,000 | |
| エレマテック | 15,900 | 1,878.00 | 29,860,200 | |
| あらた | 13,600 | 4,360.00 | 59,296,000 | |
| トーメンデバイス | 2,600 | 5,500.00 | 14,300,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 東京エレクトロン デバイス | 6,600 | 8,040.00 | 53,064,000 | |
| 円谷フィールズホールディングス | 30,500 | 1,737.00 | 52,978,500 | 貸付有価証券 6,200株 |
| 双日 | 188,600 | 2,835.00 | 534,681,000 | 貸付有価証券 200株 |
| アルフレッサ ホールディングス | 178,400 | 2,017.00 | 359,832,800 | 貸付有価証券 8,600株 |
| 横浜冷凍 | 48,400 | 1,114.00 | 53,917,600 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 神栄 | 1,800 | 1,131.00 | 2,035,800 | 貸付有価証券 800株 |
| ラサ商事 | 6,300 | 1,475.00 | 9,292,500 | 貸付有価証券 300株 (300株) |
| アルコニックス | 23,400 | 1,423.00 | 33,298,200 | |
| 神戸物産 | 137,500 | 3,950.00 | 543,125,000 | |

| | | | | |
|---------------------|--------|----------|-------------|-------------------------|
| ハイパー | 2,600 | 452.00 | 1,175,200 | |
| あい ホールディングス | 28,400 | 2,413.00 | 68,529,200 | |
| ディーブイエックス | 3,800 | 1,010.00 | 3,838,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| ダイワボウホールディングス | 72,600 | 2,646.00 | 192,099,600 | |
| マクニカホールディングス | 42,000 | 4,475.00 | 187,950,000 | |
| ラクト・ジャパン | 6,900 | 2,046.00 | 14,117,400 | 貸付有価証券 2,800株 |
| グリムス | 7,400 | 2,167.00 | 16,035,800 | 貸付有価証券 300株 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 26,000 | 943.00 | 24,518,000 | |
| 八洲電機 | 14,400 | 1,290.00 | 18,576,000 | |
| メディアスホールディングス | 11,400 | 841.00 | 9,587,400 | 貸付有価証券 5,300株 (300株) |
| レスターホールディングス | 17,000 | 2,199.00 | 37,383,000 | |
| ジュテックホールディングス | 3,200 | 1,202.00 | 3,846,400 | |
| 大光 | 5,800 | 630.00 | 3,654,000 | 貸付有価証券 3,100株 (400株) |
| OCHIホールディングス | 3,100 | 1,229.00 | 3,809,900 | |
| TOKAIホールディングス | 87,700 | 875.00 | 76,737,500 | 貸付有価証券 5,300株 |
| 黒谷 | 3,800 | 605.00 | 2,299,000 | 貸付有価証券 1,300株 (800株) |
| Cominix | 2,700 | 779.00 | 2,103,300 | |
| 三洋貿易 | 20,000 | 1,309.00 | 26,180,000 | |
| ビューティガレージ | 2,800 | 3,770.00 | 10,556,000 | |
| ウイン・パートナーズ | 12,900 | 1,012.00 | 13,054,800 | |
| ミタチ産業 | 3,500 | 1,385.00 | 4,847,500 | |
| シップヘルスケアホールディングス | 63,900 | 2,438.00 | 155,788,200 | 貸付有価証券 200株 |
| 明治電機工業 | 6,600 | 1,212.00 | 7,999,200 | |
| デリカフーズホールディングス | 5,400 | 623.00 | 3,364,200 | |
| スターティアホールディングス | 2,700 | 1,521.00 | 4,106,700 | |
| コメダホールディングス | 43,500 | 2,618.00 | 113,883,000 | |
| ピーバンドットコム | 1,900 | 505.00 | 959,500 | |
| アセンテック | 6,000 | 565.00 | 3,390,000 | |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| 富士興産 | 3,100 | 1,193.00 | 3,698,300 | 貸付有価証券 400株(400株) |
| 協栄産業 | 1,300 | 1,991.00 | 2,588,300 | |
| フルサト・マルカホールディングス | 17,700 | 2,831.00 | 50,108,700 | |
| ヤマエグループホールディングス | 10,000 | 2,247.00 | 22,470,000 | |
| 小野建 | 17,400 | 1,546.00 | 26,900,400 | 貸付有価証券 900株 |
| 南陽 | 2,600 | 2,321.00 | 6,034,600 | |
| 佐島電機 | 8,700 | 1,770.00 | 15,399,000 | 貸付有価証券 2,700株(2,700株) |
| エコートレーディング | 2,700 | 769.00 | 2,076,300 | |
| 伯東 | 10,200 | 4,570.00 | 46,614,000 | 貸付有価証券 1,200株(800株) |
| コンドーテック | 13,700 | 1,020.00 | 13,974,000 | |
| 中山福 | 7,300 | 345.00 | 2,518,500 | 貸付有価証券 1,100株(1,000株) |
| ナガイレーベン | 22,400 | 2,141.00 | 47,958,400 | |
| 三菱食品 | 16,400 | 3,520.00 | 57,728,000 | |
| 松田産業 | 13,500 | 2,330.00 | 31,455,000 | |
| 第一興商 | 68,800 | 2,485.00 | 170,968,000 | 貸付有価証券 1,900株 |
| メディパルホールディングス | 169,900 | 2,097.00 | 356,280,300 | |
| S P K | 7,900 | 1,691.00 | 13,358,900 | |
| 萩原電気ホールディングス | 6,800 | 3,555.00 | 24,174,000 | |
| アズワン | 25,300 | 5,950.00 | 150,535,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| スズデン | 6,200 | 2,233.00 | 13,844,600 | |
| 尾家産業 | 3,300 | 1,220.00 | 4,026,000 | |
| シモジマ | 12,200 | 1,133.00 | 13,822,600 | |
| ドウシシャ | 18,800 | 2,105.00 | 39,574,000 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 小津産業 | 3,100 | 1,788.00 | 5,542,800 | 貸付有価証券 1,600株(600株) |
| 高速 | 9,200 | 2,176.00 | 20,019,200 | |
| たけびし | 6,800 | 1,667.00 | 11,335,600 | |
| リックス | 2,800 | 2,905.00 | 8,134,000 | 貸付有価証券 200株(200株) |
| 丸文 | 15,900 | 1,270.00 | 20,193,000 | 貸付有価証券 1,600株 |

| | | | | |
|--------------|-----------|----------|---------------|-----------------------|
| ハピネット | 15,100 | 1,969.00 | 29,731,900 | |
| 橋本総業ホールディングス | 7,000 | 1,125.00 | 7,875,000 | |
| 日本ライフライン | 52,100 | 946.00 | 49,286,600 | |
| タカショー | 15,500 | 721.00 | 11,175,500 | 貸付有価証券 1,500株 |
| I DOM | 53,700 | 841.00 | 45,161,700 | 貸付有価証券 3,600株 |
| 進和 | 10,900 | 2,124.00 | 23,151,600 | 貸付有価証券 300株 (300株) |
| エスケイジャパン | 3,400 | 548.00 | 1,863,200 | |
| ダイトロン | 7,000 | 2,669.00 | 18,683,000 | |
| シークス | 25,300 | 1,384.00 | 35,015,200 | 貸付有価証券 100株 |
| 田中商事 | 3,900 | 647.00 | 2,523,300 | |
| オーハシテクニカ | 8,600 | 1,635.00 | 14,061,000 | |
| 白銅 | 6,400 | 2,689.00 | 17,209,600 | |
| ダイコー通産 | 1,400 | 1,258.00 | 1,761,200 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| 伊藤忠商事 | 1,095,000 | 4,671.00 | 5,114,745,000 | |
| 丸紅 | 1,386,700 | 1,936.00 | 2,684,651,200 | |
| 高島 | 2,200 | 2,930.00 | 6,446,000 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| 長瀬産業 | 81,500 | 2,343.00 | 190,954,500 | |
| 蝶理 | 9,500 | 2,660.00 | 25,270,000 | |
| 豊田通商 | 155,700 | 5,940.00 | 924,858,000 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 三共生興 | 25,500 | 586.00 | 14,943,000 | |
| 兼松 | 69,000 | 1,914.00 | 132,066,000 | 貸付有価証券 1,900株 |
| ツカモトコーポレーション | 2,000 | 1,539.00 | 3,078,000 | |
| 三井物産 | 1,261,200 | 4,311.00 | 5,437,033,200 | |
| 日本紙パルプ商事 | 9,400 | 5,490.00 | 51,606,000 | |
| カメイ | 18,900 | 1,632.00 | 30,844,800 | |
| 東都水産 | 700 | 6,610.00 | 4,627,000 | 貸付有価証券 400株 |
| OUGホールディングス | 2,000 | 2,469.00 | 4,938,000 | |
| スターゼン | 13,500 | 2,356.00 | 31,806,000 | |
| 山善 | 47,900 | 1,046.00 | 50,103,400 | |
| 椿本興業 | 2,900 | 3,985.00 | 11,556,500 | |

| | | | | |
|---------------------|-----------|----------|---------------|-----------------------|
| 住友商事 | 1,100,500 | 2,602.00 | 2,863,501,000 | |
| 内田洋行 | 7,200 | 5,260.00 | 37,872,000 | |
| 三菱商事 | 1,099,100 | 5,342.00 | 5,871,392,200 | |
| 第一実業 | 6,300 | 5,790.00 | 36,477,000 | |
| キャノンマーケティング ジャパン | 41,200 | 3,325.00 | 136,990,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 西華産業 | 7,000 | 2,295.00 | 16,065,000 | |
| 佐藤商事 | 12,300 | 1,420.00 | 17,466,000 | |
| 菱洋エレクトロ | 15,100 | 2,550.00 | 38,505,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 東京産業 | 16,200 | 912.00 | 14,774,400 | 貸付有価証券 500株 |
| ユアサ商事 | 16,000 | 4,015.00 | 64,240,000 | 貸付有価証券 900株 |
| 神鋼商事 | 4,500 | 5,920.00 | 26,640,000 | |
| トルク | 7,400 | 210.00 | 1,554,000 | |
| 阪和興業 | 31,900 | 4,345.00 | 138,605,500 | |
| 正栄食品工業 | 11,800 | 4,000.00 | 47,200,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| カナデン | 11,900 | 1,216.00 | 14,470,400 | |
| RYODEN | 14,300 | 2,035.00 | 29,100,500 | 貸付有価証券 6,600株 |
| 岩谷産業 | 40,500 | 6,540.00 | 264,870,000 | 貸付有価証券 4,400株 |
| ナイス | 3,700 | 1,350.00 | 4,995,000 | |
| ニチモウ | 1,700 | 3,190.00 | 5,423,000 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| 極東貿易 | 10,600 | 1,546.00 | 16,387,600 | 貸付有価証券 300株 (100株) |
| アステナホールディング ス | 30,700 | 456.00 | 13,999,200 | 貸付有価証券 1,900株 |
| 三愛オブリ | 47,000 | 1,474.00 | 69,278,000 | |
| 稲畑産業 | 35,900 | 2,942.00 | 105,617,800 | |
| G S I クレオス | 10,300 | 1,932.00 | 19,899,600 | |
| 明和産業 | 23,600 | 667.00 | 15,741,200 | 貸付有価証券 3,100株 |
| クワザワホールディング ス | 4,400 | 476.00 | 2,094,400 | 貸付有価証券 1,900株 |
| ワキタ | 32,700 | 1,408.00 | 46,041,600 | |
| 東邦ホールディングス | 44,200 | 2,712.00 | 119,870,400 | 貸付有価証券 10,200株 |
| サンゲツ | 44,600 | 2,297.00 | 102,446,200 | |

| | | | | |
|-------------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| ミツウロコグループホールディングス | 22,700 | 1,345.00 | 30,531,500 | |
| シナネンホールディングス | 5,700 | 3,780.00 | 21,546,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 伊藤忠エネクス | 44,000 | 1,227.00 | 53,988,000 | |
| サンリオ | 50,300 | 6,100.00 | 306,830,000 | |
| サンワテクノス | 9,100 | 2,095.00 | 19,064,500 | |
| リョーサン | 18,800 | 3,360.00 | 63,168,000 | |
| 新光商事 | 23,900 | 1,226.00 | 29,301,400 | |
| トーヨー | 7,600 | 2,402.00 | 18,255,200 | |
| 三信電気 | 7,200 | 2,362.00 | 17,006,400 | 貸付有価証券 1,200株 |
| 東陽テクニカ | 18,000 | 1,433.00 | 25,794,000 | |
| モスフードサービス | 26,100 | 3,155.00 | 82,345,500 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 加賀電子 | 14,400 | 5,110.00 | 73,584,000 | |
| ソーダニッカ | 10,100 | 793.00 | 8,009,300 | 貸付有価証券 200株 |
| 立花エレテック | 13,000 | 2,128.00 | 27,664,000 | |
| フォーバル | 7,000 | 1,123.00 | 7,861,000 | |
| PAL TAC | 27,900 | 5,040.00 | 140,616,000 | 貸付有価証券 1,500株 |
| 三谷産業 | 31,000 | 316.00 | 9,796,000 | |
| 太平洋興発 | 4,800 | 824.00 | 3,955,200 | 貸付有価証券 600株 (600株) |
| 西本Wismettac ホールディングス | 4,500 | 3,990.00 | 17,955,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ヤマシタヘルスケアホールディングス | 1,100 | 2,194.00 | 2,413,400 | 貸付有価証券 500株 |
| コア商事ホールディングス | 10,000 | 717.00 | 7,170,000 | 貸付有価証券 4,600株 (400株) |
| KPPグループホールディングス | 41,400 | 660.00 | 27,324,000 | 貸付有価証券 11,900株 (1,700株) |
| ヤマタネ | 7,800 | 1,686.00 | 13,150,800 | |
| 丸紅建材リース | 1,200 | 2,019.00 | 2,422,800 | |
| 日鉄物産 | 4,100 | 9,280.00 | 38,048,000 | |
| 泉州電業 | 8,900 | 3,115.00 | 27,723,500 | 貸付有価証券 3,000株 |
| トラスコ中山 | 37,300 | 2,287.00 | 85,305,100 | |
| オートバックスセブン | 61,800 | 1,535.00 | 94,863,000 | |
| モリト | 12,700 | 1,088.00 | 13,817,600 | 貸付有価証券 100株 |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| 加藤産業 | 22,000 | 3,795.00 | 83,490,000 | |
| 北恵 | 3,100 | 752.00 | 2,331,200 | 貸付有価証券 1,600株 |
| イエローハット | 31,400 | 1,882.00 | 59,094,800 | |
| J Kホールディングス | 13,600 | 1,071.00 | 14,565,600 | |
| 日伝 | 10,500 | 2,103.00 | 22,081,500 | 貸付有価証券 200株 |
| 北沢産業 | 7,300 | 473.00 | 3,452,900 | 貸付有価証券 3,200株 (500株) |
| 杉本商事 | 7,900 | 2,001.00 | 15,807,900 | |
| 因幡電機産業 | 46,100 | 3,080.00 | 141,988,000 | |
| 東テク | 5,900 | 4,370.00 | 25,783,000 | |
| ミスミグループ本社 | 268,200 | 3,380.00 | 906,516,000 | |
| アルテック | 7,700 | 262.00 | 2,017,400 | 貸付有価証券 500株 |
| タキヒヨー | 3,300 | 1,016.00 | 3,352,800 | 貸付有価証券 200株 |
| 蔵王産業 | 2,300 | 2,271.00 | 5,223,300 | |
| スズケン | 52,000 | 3,940.00 | 204,880,000 | |
| ジェコス | 10,600 | 870.00 | 9,222,000 | |
| グローセル | 16,600 | 415.00 | 6,889,000 | |
| ローソン | 44,100 | 6,250.00 | 275,625,000 | 貸付有価証券 1,300株 |
| サンエー | 13,600 | 4,675.00 | 63,580,000 | |
| カワチ薬品 | 13,900 | 2,177.00 | 30,260,300 | 貸付有価証券 300株 |
| エービーシー・マート | 25,900 | 7,760.00 | 200,984,000 | 貸付有価証券 300株 |
| ハードオフコーポレーション | 5,500 | 1,386.00 | 7,623,000 | |
| アスクル | 36,700 | 1,737.00 | 63,747,900 | 貸付有価証券 16,500株 |
| ゲオホールディングス | 17,400 | 1,687.00 | 29,353,800 | 貸付有価証券 600株 |
| アダストリア | 21,500 | 2,544.00 | 54,696,000 | |
| ジーフット | 9,400 | 277.00 | 2,603,800 | 貸付有価証券 4,100株 |
| シー・ヴィ・エス・ベイ エリア | 1,800 | 484.00 | 871,200 | |
| くら寿司 | 20,800 | 3,205.00 | 66,664,000 | 貸付有価証券 9,700株 (1,400株) |
| キャンドウ | 6,300 | 2,437.00 | 15,353,100 | 貸付有価証券 2,100株 |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|-----------------------------|
| I Kホールディングス | 4,400 | 398.00 | 1,751,200 | 貸付有価証券 2,000株 (300株) |
| パルグループホールディングス | 17,400 | 3,175.00 | 55,245,000 | |
| エディオン | 70,300 | 1,353.00 | 95,115,900 | 貸付有価証券 33,000株 (17,300株) |
| サーラコーポレーション | 37,300 | 777.00 | 28,982,100 | |
| ワッツ | 6,700 | 708.00 | 4,743,600 | |
| ハローズ | 8,100 | 3,220.00 | 26,082,000 | 貸付有価証券 800株 |
| フジオフードグループ本社 | 19,700 | 1,456.00 | 28,683,200 | 貸付有価証券 3,000株 |
| あみやき亭 | 4,300 | 3,690.00 | 15,867,000 | 貸付有価証券 2,000株 |
| ひらまつ | 29,600 | 326.00 | 9,649,600 | 貸付有価証券 4,700株 (4,400株) |
| 大黒天物産 | 5,500 | 5,340.00 | 29,370,000 | 貸付有価証券 2,500株 (900株) |
| ハニーズホールディングス | 14,000 | 1,566.00 | 21,924,000 | 貸付有価証券 6,500株 |
| ファーマライズホールディングス | 3,000 | 635.00 | 1,905,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| アルペン | 14,700 | 2,004.00 | 29,458,800 | 貸付有価証券 6,800株 |
| ハブ | 4,500 | 813.00 | 3,658,500 | 貸付有価証券 1,000株 |
| クオールホールディングス | 24,400 | 1,234.00 | 30,109,600 | 貸付有価証券 1,000株 |
| ジンズホールディングス | 10,500 | 3,045.00 | 31,972,500 | 貸付有価証券 4,800株 |
| ビックカメラ | 94,500 | 1,113.00 | 105,178,500 | 貸付有価証券 38,600株 (700株) |
| DCMホールディングス | 108,500 | 1,342.00 | 145,607,000 | 貸付有価証券 5,100株 |
| Monotaro | 251,900 | 2,014.00 | 507,326,600 | 貸付有価証券 14,400株 |
| 東京一番フーズ | 3,200 | 497.00 | 1,590,400 | |
| DDホールディングス | 8,900 | 1,184.00 | 10,537,600 | 貸付有価証券 3,100株 (100株) |
| きちりホールディングス | 3,200 | 866.00 | 2,771,200 | 貸付有価証券 1,800株 |
| アークランドサービスホールディングス | 14,600 | 2,999.00 | 43,785,400 | 貸付有価証券 4,800株 |
| J. フロント リテイリング | 220,900 | 1,401.00 | 309,480,900 | 貸付有価証券 1,000株 |
| ドトール・日レスホールディングス | 31,500 | 2,083.00 | 65,614,500 | |

| | | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| マツキヨココカラ&カンパニー | 107,800 | 7,240.00 | 780,472,000 | 貸付有価証券 300株 |
| ブロンコビリー | 9,500 | 2,771.00 | 26,324,500 | 貸付有価証券 4,400株 |
| Z O Z O | 117,400 | 2,915.00 | 342,221,000 | |
| トレジャー・ファクトリー | 8,600 | 1,658.00 | 14,258,800 | 貸付有価証券 1,600株 (1,100株) |
| 物語コーポレーション | 29,700 | 2,918.00 | 86,664,600 | 貸付有価証券 11,100株 (300株) |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 299,200 | 1,448.00 | 433,241,600 | |
| H a m e e | 6,100 | 1,008.00 | 6,148,800 | 貸付有価証券 1,700株 (300株) |
| マーケットエンタープライズ | 1,400 | 1,336.00 | 1,870,400 | 貸付有価証券 400株 (400株) |
| ウエルシアホールディングス | 92,200 | 2,917.00 | 268,947,400 | 貸付有価証券 700株 |
| クリエイティブSDホールディングス | 29,400 | 3,380.00 | 99,372,000 | 貸付有価証券 13,600株 |
| 丸善CHIホールディングス | 16,300 | 361.00 | 5,884,300 | 貸付有価証券 8,100株 |
| ミサワ | 2,500 | 618.00 | 1,545,000 | |
| ティーライフ | 1,900 | 1,355.00 | 2,574,500 | 貸付有価証券 1,000株 |
| エー・ピーホールディングス | 2,900 | 797.00 | 2,311,300 | 貸付有価証券 1,500株 |
| チムニー | 4,300 | 1,375.00 | 5,912,500 | 貸付有価証券 2,100株 |
| シュッピン | 13,200 | 872.00 | 11,510,400 | 貸付有価証券 2,500株 (1,000株) |
| オイシックス・ラ・大地 | 23,900 | 2,593.00 | 61,972,700 | 貸付有価証券 8,700株 (3,500株) |
| ネクステージ | 40,600 | 2,283.00 | 92,689,800 | 貸付有価証券 19,000株 (2,800株) |
| ジョイフル本田 | 52,800 | 1,780.00 | 93,984,000 | 貸付有価証券 19,300株 |
| 鳥貴族ホールディングス | 6,600 | 2,402.00 | 15,853,200 | |
| ホットランド | 13,600 | 1,604.00 | 21,814,400 | 貸付有価証券 6,300株 (600株) |
| すかいらくホールディングス | 242,900 | 1,837.00 | 446,207,300 | 貸付有価証券 114,100株 |
| S F Pホールディングス | 9,700 | 2,035.00 | 19,739,500 | |
| 綿半ホールディングス | 13,700 | 1,410.00 | 19,317,000 | |
| ヨシックスホールディングス | 2,700 | 2,339.00 | 6,315,300 | |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 57,900 | 1,165.00 | 67,453,500 | 貸付有価証券 5,900株 (900株) |

| | | | | |
|----------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 8,000 | 940.00 | 7,520,000 | 貸付有価証券 3,700株(1,700株) |
| BEENOS | 7,500 | 1,929.00 | 14,467,500 | 貸付有価証券 3,700株 |
| あさひ | 14,800 | 1,300.00 | 19,240,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 日本調剤 | 12,100 | 1,115.00 | 13,491,500 | 貸付有価証券 3,300株(2,900株) |
| コスモス薬品 | 17,600 | 13,820.00 | 243,232,000 | 貸付有価証券 8,200株 |
| トーエル | 6,100 | 759.00 | 4,629,900 | 貸付有価証券 3,400株(200株) |
| セブン&アイ・ホールディングス | 612,400 | 6,273.00 | 3,841,585,200 | 貸付有価証券 195,700株 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 133,700 | 1,002.00 | 133,967,400 | |
| ツルハホールディングス | 37,300 | 9,110.00 | 339,803,000 | 貸付有価証券 17,100株 |
| サンマルクホールディングス | 14,300 | 1,889.00 | 27,012,700 | |
| フェリシモ | 3,100 | 1,004.00 | 3,112,400 | 貸付有価証券 300株(200株) |
| トリドールホールディングス | 44,200 | 2,950.00 | 130,390,000 | 貸付有価証券 17,200株 |
| TOKYO BASE | 18,300 | 418.00 | 7,649,400 | 貸付有価証券 8,500株(8,500株) |
| ウイルプラスホールディングス | 2,200 | 1,074.00 | 2,362,800 | 貸付有価証券 500株(500株) |
| JMホールディングス | 13,400 | 1,989.00 | 26,652,600 | |
| サツドラホールディングス | 6,300 | 844.00 | 5,317,200 | 貸付有価証券 3,300株(1,400株) |
| アレンザホールディングス | 13,300 | 998.00 | 13,273,400 | |
| 串カツ田中ホールディングス | 4,700 | 1,706.00 | 8,018,200 | 貸付有価証券 700株 |
| バロックジャパンリミテッド | 11,500 | 860.00 | 9,890,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| クスリのアオキホールディングス | 15,800 | 6,670.00 | 105,386,000 | 貸付有価証券 7,400株(200株) |
| 力の源ホールディングス | 7,900 | 1,371.00 | 10,830,900 | |
| FOOD & LIFE COMPANIE | 94,800 | 3,300.00 | 312,840,000 | |
| メディカルシステムネットワーク | 15,400 | 395.00 | 6,083,000 | |
| 一家ホールディングス | 3,100 | 639.00 | 1,980,900 | |
| ジャパングラフトホールディングス | 4,000 | 575.00 | 2,300,000 | 貸付有価証券 1,800株(100株) |

| | | | | |
|----------------------|---------|----------|-------------|-------------------------|
| はるやまホールディングス | 5,800 | 525.00 | 3,045,000 | 貸付有価証券 3,100株 |
| ノジマ | 58,000 | 1,489.00 | 86,362,000 | 貸付有価証券 500株 |
| カップ・クリエイト | 27,900 | 1,525.00 | 42,547,500 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| ライトオン | 10,400 | 578.00 | 6,011,200 | 貸付有価証券 1,400株 (100株) |
| 良品計画 | 194,000 | 1,407.00 | 272,958,000 | |
| パリティホールディングス | 17,300 | 327.00 | 5,657,100 | 貸付有価証券 200株 |
| アドヴァングループ | 16,900 | 962.00 | 16,257,800 | |
| アルビス | 5,800 | 2,436.00 | 14,128,800 | |
| コナカ | 15,100 | 358.00 | 5,405,800 | |
| ハウス オブ ローゼ | 1,700 | 1,609.00 | 2,735,300 | |
| G-7ホールディングス | 22,100 | 1,417.00 | 31,315,700 | |
| イオン北海道 | 26,300 | 831.00 | 21,855,300 | 貸付有価証券 12,100株 |
| コジマ | 29,400 | 559.00 | 16,434,600 | 貸付有価証券 14,300株 |
| ヒマラヤ | 4,300 | 955.00 | 4,106,500 | 貸付有価証券 600株 (300株) |
| コーナン商事 | 24,000 | 3,655.00 | 87,720,000 | |
| エコス | 6,600 | 1,875.00 | 12,375,000 | |
| ワタミ | 21,400 | 959.00 | 20,522,600 | 貸付有価証券 200株 |
| マルシェ | 4,500 | 432.00 | 1,944,000 | 貸付有価証券 1,800株 (100株) |
| パン・パシフィック・インターナショナルホ | 358,700 | 2,547.00 | 913,608,900 | 貸付有価証券 12,100株 |
| 西松屋チェーン | 39,300 | 1,601.00 | 62,919,300 | 貸付有価証券 9,400株 |
| ゼンショーホールディングス | 97,300 | 4,310.00 | 419,363,000 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 幸楽苑ホールディングス | 11,600 | 1,067.00 | 12,377,200 | 貸付有価証券 2,100株 |
| ハークスレイ | 4,800 | 723.00 | 3,470,400 | 貸付有価証券 600株 (300株) |
| サイゼリヤ | 26,300 | 3,380.00 | 88,894,000 | 貸付有価証券 2,600株 |
| V Tホールディングス | 67,500 | 545.00 | 36,787,500 | |
| 魚力 | 5,500 | 2,184.00 | 12,012,000 | |
| ポプラ | 3,600 | 274.00 | 986,400 | 貸付有価証券 1,800株 |
| フジ・コーポレーション | 10,000 | 1,322.00 | 13,220,000 | |

| | | | | |
|--------------------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| ユナイテッドアローズ | 19,000 | 1,978.00 | 37,582,000 | |
| ハイデイ日高 | 26,400 | 2,320.00 | 61,248,000 | 貸付有価証券 11,100株 |
| YU-WA Creat i o n H o l d i | 8,200 | 202.00 | 1,656,400 | 貸付有価証券 100株 |
| コロワイド | 81,900 | 2,106.00 | 172,481,400 | 貸付有価証券 37,900株 (4,300株) |
| ピーシーデポコーポレー ション | 19,800 | 299.00 | 5,920,200 | |
| 壺番屋 | 14,000 | 5,250.00 | 73,500,000 | |
| トップカルチャー | 4,500 | 195.00 | 877,500 | 貸付有価証券 100株 |
| P L A N T | 3,200 | 725.00 | 2,320,000 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| スギホールディングス | 35,800 | 5,790.00 | 207,282,000 | |
| 薬王堂ホールディングス | 9,900 | 2,451.00 | 24,264,900 | 貸付有価証券 300株 (200株) |
| スクロール | 26,400 | 890.00 | 23,496,000 | |
| ヨンドシーホールディン グス | 15,300 | 1,774.00 | 27,142,200 | 貸付有価証券 300株 |
| 木曽路 | 26,900 | 2,411.00 | 64,855,900 | 貸付有価証券 8,600株 |
| S R S ホールディングス | 29,300 | 1,016.00 | 29,768,800 | |
| 千趣会 | 32,700 | 418.00 | 13,668,600 | 貸付有価証券 6,100株 |
| タカキュー | 9,700 | 78.00 | 756,600 | 貸付有価証券 5,300株 |
| リテールパートナーズ | 26,400 | 1,581.00 | 41,738,400 | 貸付有価証券 1,200株 |
| ケーヨー | 28,600 | 823.00 | 23,537,800 | 貸付有価証券 100株 |
| 上新電機 | 15,800 | 1,942.00 | 30,683,600 | |
| 日本瓦斯 | 95,200 | 2,018.00 | 192,113,600 | 貸付有価証券 500株 |
| ロイヤルホールディン グス | 34,400 | 2,801.00 | 96,354,400 | 貸付有価証券 16,100株 |
| 東天紅 | 1,000 | 814.00 | 814,000 | |
| いなげや | 17,300 | 1,590.00 | 27,507,000 | 貸付有価証券 8,000株 (1,300株) |
| チョダ | 17,000 | 846.00 | 14,382,000 | 貸付有価証券 6,500株 |
| ライフコーポレーション | 15,500 | 2,990.00 | 46,345,000 | 貸付有価証券 100株 |
| リンガーハット | 22,900 | 2,392.00 | 54,776,800 | 貸付有価証券 8,200株 |
| M r M a x H D | 24,900 | 623.00 | 15,512,700 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-------------------------|---------|-----------|---------------|--------------------------|
| | | | | 100株 |
| テンアライド | 15,400 | 265.00 | 4,081,000 | 貸付有価証券 8,000株(1,600株) |
| AOKIホールディングス | 33,000 | 900.00 | 29,700,000 | |
| オークワ | 28,400 | 900.00 | 25,560,000 | 貸付有価証券 5,600株 |
| コメリ | 27,300 | 3,065.00 | 83,674,500 | |
| 青山商事 | 38,000 | 932.00 | 35,416,000 | 貸付有価証券 300株 |
| しまむら | 20,900 | 12,430.00 | 259,787,000 | 貸付有価証券 900株 |
| はせがわ | 6,600 | 340.00 | 2,244,000 | |
| 高島屋 | 134,000 | 1,960.00 | 262,640,000 | 貸付有価証券 7,800株 |
| 松屋 | 30,100 | 1,159.00 | 34,885,900 | 貸付有価証券 6,300株 |
| エイチ・ツー・オー テイリング | 86,500 | 1,583.00 | 136,929,500 | 貸付有価証券 600株 |
| 近鉄百貨店 | 7,600 | 2,493.00 | 18,946,800 | |
| 丸井グループ | 131,100 | 2,496.00 | 327,225,600 | 貸付有価証券 2,600株 |
| アクシアル リテイリング | 12,100 | 3,380.00 | 40,898,000 | |
| 井筒屋 | 6,600 | 325.00 | 2,145,000 | 貸付有価証券 3,300株 |
| イオン | 602,400 | 2,757.00 | 1,660,816,800 | 貸付有価証券 13,400株 |
| イズミ | 27,000 | 3,185.00 | 85,995,000 | |
| 平和堂 | 29,700 | 2,066.00 | 61,360,200 | 貸付有価証券 700株 |
| フジ | 27,300 | 1,771.00 | 48,348,300 | 貸付有価証券 1,700株 |
| ヤオコー | 20,100 | 7,200.00 | 144,720,000 | 貸付有価証券 3,300株 |
| ゼビオホールディングス | 24,100 | 1,217.00 | 29,329,700 | |
| ケーズホールディングス | 125,600 | 1,208.00 | 151,724,800 | 貸付有価証券 29,200株 |
| Olympicグループ | 5,100 | 537.00 | 2,738,700 | 貸付有価証券 400株 |
| 日産東京販売ホールディングス | 17,600 | 344.00 | 6,054,400 | |
| シルバーライフ | 3,400 | 1,277.00 | 4,341,800 | 貸付有価証券 1,800株 |
| Genky Drug Stores | 7,800 | 4,005.00 | 31,239,000 | 貸付有価証券 3,600株(900株) |

| | | | | |
|-------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| ナルミヤ・インターナショナル | 2,200 | 959.00 | 2,109,800 | 貸付有価証券 200株 |
| ブックオフグループホールディングス | 9,000 | 1,318.00 | 11,862,000 | 貸付有価証券 4,200株(800株) |
| ギフトホールディングス | 3,800 | 5,080.00 | 19,304,000 | 貸付有価証券 1,700株(200株) |
| アインホールディングス | 24,500 | 5,650.00 | 138,425,000 | |
| 元気寿司 | 5,000 | 3,410.00 | 17,050,000 | |
| ヤマダホールディングス | 728,600 | 441.00 | 321,312,600 | 貸付有価証券 74,500株 |
| アークランズ | 26,000 | 1,616.00 | 42,016,000 | 貸付有価証券 10,200株(3,600株) |
| ニトリホールディングス | 71,900 | 18,240.00 | 1,311,456,000 | |
| グルメ杵屋 | 14,400 | 1,078.00 | 15,523,200 | |
| 愛眼 | 10,200 | 168.00 | 1,713,600 | 貸付有価証券 100株 |
| ケーユーホールディングス | 10,400 | 1,465.00 | 15,236,000 | |
| 吉野家ホールディングス | 69,500 | 2,500.00 | 173,750,000 | 貸付有価証券 4,600株(1,600株) |
| 松屋フーズホールディングス | 8,400 | 4,305.00 | 36,162,000 | |
| サガミホールディングス | 28,500 | 1,345.00 | 38,332,500 | 貸付有価証券 10,400株 |
| 関西フードマーケット | 16,000 | 1,548.00 | 24,768,000 | 貸付有価証券 300株 |
| 王将フードサービス | 11,700 | 6,220.00 | 72,774,000 | |
| ミニストップ | 12,900 | 1,431.00 | 18,459,900 | 貸付有価証券 5,700株 |
| アークス | 32,600 | 2,514.00 | 81,956,400 | 貸付有価証券 300株 |
| バローホールディングス | 33,900 | 2,104.00 | 71,325,600 | |
| ベルク | 8,800 | 6,030.00 | 53,064,000 | |
| 大庄 | 7,500 | 1,175.00 | 8,812,500 | 貸付有価証券 2,200株 |
| ファーストリテイリング | 79,900 | 31,050.00 | 2,480,895,000 | 貸付有価証券 9,700株 |
| サンドラッグ | 67,500 | 3,840.00 | 259,200,000 | |
| サックスパーホールディングス | 16,900 | 891.00 | 15,057,900 | 貸付有価証券 700株(700株) |
| ヤマザワ | 2,500 | 1,301.00 | 3,252,500 | 貸付有価証券 1,100株(500株) |
| やまや | 2,900 | 2,701.00 | 7,832,900 | 貸付有価証券 700株 |
| ベルーナ | 42,800 | 751.00 | 32,142,800 | 貸付有価証券 2,500株 |

| | | | | |
|---------------------|------------|----------|---------------|------------------------------|
| いよぎんホールディングス | 196,800 | 788.00 | 155,078,400 | 貸付有価証券 15,300株 |
| しずおかフィナンシャルグループ | 373,800 | 1,022.00 | 382,023,600 | 貸付有価証券 9,800株 |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ | 139,300 | 903.00 | 125,787,900 | |
| 楽天銀行 | 27,100 | 1,845.00 | 49,999,500 | |
| 島根銀行 | 4,400 | 483.00 | 2,125,200 | 貸付有価証券 100株 |
| じもとホールディングス | 11,400 | 394.00 | 4,491,600 | 貸付有価証券 100株 |
| めぶきフィナンシャルグループ | 820,800 | 344.00 | 282,355,200 | 貸付有価証券 63,000株 |
| 東京きらぼしフィナンシャルグループ | 21,200 | 2,958.00 | 62,709,600 | 貸付有価証券 1,100株 |
| 九州フィナンシャルグループ | 291,000 | 498.00 | 144,918,000 | 貸付有価証券 300株 |
| ゆうちょ銀行 | 463,500 | 1,081.00 | 501,043,500 | 貸付有価証券 109,100株 (38,200株) |
| 富山第一銀行 | 55,000 | 676.00 | 37,180,000 | 貸付有価証券 20,000株 (5,100株) |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 911,700 | 517.00 | 471,348,900 | |
| 西日本フィナンシャルホールディングス | 102,700 | 1,110.00 | 113,997,000 | |
| 三十三フィナンシャルグループ | 14,800 | 1,582.00 | 23,413,600 | |
| 第四北越フィナンシャルグループ | 26,000 | 3,020.00 | 78,520,000 | |
| ひろぎんホールディングス | 215,800 | 679.00 | 146,528,200 | 貸付有価証券 12,100株 |
| おきなわフィナンシャルグループ | 15,700 | 2,040.00 | 32,028,000 | |
| 十六フィナンシャルグループ | 21,400 | 2,981.00 | 63,793,400 | 貸付有価証券 900株 |
| 北國フィナンシャルホールディングス | 18,600 | 4,835.00 | 89,931,000 | 貸付有価証券 4,100株 |
| プロクレアホールディングス | 20,300 | 2,160.00 | 43,848,000 | |
| あいちフィナンシャルグループ | 23,100 | 2,131.00 | 49,226,100 | 貸付有価証券 900株 |
| SBI新生銀行 | 38,600 | 2,472.00 | 95,419,200 | 貸付有価証券 11,000株 |
| あおぞら銀行 | 104,000 | 2,479.00 | 257,816,000 | 貸付有価証券 48,500株 (12,800株) |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 10,359,500 | 863.00 | 8,940,248,500 | 貸付有価証券 122,400株 |

| | | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|-------------------|
| りそなホールディングス | 2,090,700 | 672.30 | 1,405,577,610 | 貸付有価証券 72,700株 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 300,600 | 5,018.00 | 1,508,410,800 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 1,208,800 | 5,678.00 | 6,863,566,400 | |
| 千葉銀行 | 461,000 | 876.00 | 403,836,000 | 貸付有価証券 19,800株 |
| 群馬銀行 | 321,000 | 462.00 | 148,302,000 | |
| 武蔵野銀行 | 21,200 | 2,174.00 | 46,088,800 | 貸付有価証券 1,600株 |
| 千葉興業銀行 | 30,100 | 542.00 | 16,314,200 | 貸付有価証券 2,100株 |
| 筑波銀行 | 72,600 | 208.00 | 15,100,800 | |
| 七十七銀行 | 53,000 | 2,235.00 | 118,455,000 | 貸付有価証券 2,700株 |
| 秋田銀行 | 11,100 | 1,747.00 | 19,391,700 | |
| 山形銀行 | 18,400 | 1,069.00 | 19,669,600 | |
| 岩手銀行 | 11,300 | 2,143.00 | 24,215,900 | |
| 東邦銀行 | 130,800 | 224.00 | 29,299,200 | |
| 東北銀行 | 6,300 | 981.00 | 6,180,300 | 貸付有価証券 200株 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 132,100 | 2,541.00 | 335,666,100 | 貸付有価証券 4,400株 |
| スルガ銀行 | 145,800 | 526.00 | 76,690,800 | 貸付有価証券 800株 |
| 八十二銀行 | 339,300 | 588.00 | 199,508,400 | 貸付有価証券 9,900株 |
| 山梨中央銀行 | 17,000 | 1,106.00 | 18,802,000 | |
| 大垣共立銀行 | 31,500 | 1,834.00 | 57,771,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 福井銀行 | 14,800 | 1,464.00 | 21,667,200 | |
| 清水銀行 | 6,600 | 1,443.00 | 9,523,800 | |
| 富山銀行 | 2,000 | 1,632.00 | 3,264,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 滋賀銀行 | 27,500 | 2,815.00 | 77,412,500 | 貸付有価証券 500株 |
| 南都銀行 | 24,900 | 2,442.00 | 60,805,800 | |
| 百五銀行 | 155,600 | 389.00 | 60,528,400 | 貸付有価証券 1,400株 |
| 京都銀行 | 52,400 | 6,760.00 | 354,224,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 紀陽銀行 | 59,200 | 1,629.00 | 96,436,800 | 貸付有価証券 2,600株 |
| ほくほくフィナンシャル | 105,100 | 969.00 | 101,841,900 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| グループ | | | | 3,700株 |
| 山陰合同銀行 | 103,500 | 768.00 | 79,488,000 | 貸付有価証券 2,200株 |
| 鳥取銀行 | 4,100 | 1,169.00 | 4,792,900 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 百十四銀行 | 15,100 | 1,838.00 | 27,753,800 | |
| 四国銀行 | 26,300 | 860.00 | 22,618,000 | |
| 阿波銀行 | 23,200 | 2,015.00 | 46,748,000 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 大分銀行 | 9,900 | 2,053.00 | 20,324,700 | |
| 宮崎銀行 | 10,800 | 2,403.00 | 25,952,400 | |
| 佐賀銀行 | 9,700 | 1,667.00 | 16,169,900 | |
| 琉球銀行 | 37,900 | 906.00 | 34,337,400 | |
| セブン銀行 | 592,600 | 282.00 | 167,113,200 | 貸付有価証券 27,700株 |
| みずほフィナンシャルグループ | 2,392,300 | 2,015.00 | 4,820,484,500 | 貸付有価証券 100株 |
| 高知銀行 | 4,400 | 678.00 | 2,983,200 | 貸付有価証券 500株 (500株) |
| 山口フィナンシャルグループ | 182,600 | 837.00 | 152,836,200 | 貸付有価証券 2,000株 |
| 長野銀行 | 4,000 | 1,477.00 | 5,908,000 | |
| 名古屋銀行 | 10,900 | 3,420.00 | 37,278,000 | |
| 北洋銀行 | 250,600 | 284.00 | 71,170,400 | |
| 大光銀行 | 3,800 | 1,099.00 | 4,176,200 | |
| 愛媛銀行 | 22,300 | 845.00 | 18,843,500 | |
| トマト銀行 | 4,200 | 1,025.00 | 4,305,000 | |
| 京葉銀行 | 75,700 | 557.00 | 42,164,900 | 貸付有価証券 3,800株 |
| 栃木銀行 | 75,700 | 269.00 | 20,363,300 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 北日本銀行 | 5,800 | 2,051.00 | 11,895,800 | |
| 東和銀行 | 30,400 | 548.00 | 16,659,200 | |
| 福島銀行 | 13,500 | 224.00 | 3,024,000 | 貸付有価証券 1,200株 (1,100株) |
| 大東銀行 | 5,000 | 643.00 | 3,215,000 | |
| トモニホールディングス | 133,700 | 366.00 | 48,934,200 | |
| フィデアホールディングス | 17,100 | 1,328.00 | 22,708,800 | 貸付有価証券 400株 (400株) |
| 池田泉州ホールディングス | 211,800 | 236.00 | 49,984,800 | 貸付有価証券 6,900株 |
| F P G | 55,900 | 1,082.00 | 60,483,800 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------------|-----------|----------|---------------|----------------------------|
| | | | | 300株 |
| ジャパンインベストメントアドバイザー | 13,500 | 1,140.00 | 15,390,000 | 貸付有価証券 1,600株 |
| マーキュリアホールディングス | 7,600 | 723.00 | 5,494,800 | |
| SBIホールディングス | 239,500 | 2,662.00 | 637,549,000 | 貸付有価証券 23,700株(900株) |
| 日本アジア投資 | 10,200 | 253.00 | 2,580,600 | |
| ジャフコグループ | 55,200 | 1,747.00 | 96,434,400 | |
| 大和証券グループ本社 | 1,182,800 | 632.00 | 747,529,600 | |
| 野村ホールディングス | 3,046,400 | 485.00 | 1,477,504,000 | |
| 岡三証券グループ | 145,200 | 434.00 | 63,016,800 | 貸付有価証券 41,300株(17,900株) |
| 丸三証券 | 55,000 | 418.00 | 22,990,000 | 貸付有価証券 14,800株 |
| 東洋証券 | 54,900 | 325.00 | 17,842,500 | 貸付有価証券 16,000株 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 180,000 | 358.00 | 64,440,000 | 貸付有価証券 24,800株 |
| 光世証券 | 2,900 | 414.00 | 1,200,600 | |
| 水戸証券 | 44,400 | 295.00 | 13,098,000 | |
| いちよし証券 | 30,500 | 591.00 | 18,025,500 | |
| 松井証券 | 97,700 | 769.00 | 75,131,300 | 貸付有価証券 6,800株 |
| マネックスグループ | 178,200 | 512.00 | 91,238,400 | 貸付有価証券 2,400株 |
| 極東証券 | 20,600 | 623.00 | 12,833,800 | |
| 岩井コスモホールディングス | 18,900 | 1,332.00 | 25,174,800 | |
| アイザワ証券グループ | 23,900 | 746.00 | 17,829,400 | 貸付有価証券 300株 |
| マネーパートナーズグループ | 13,400 | 264.00 | 3,537,600 | |
| スパークス・グループ | 18,400 | 1,490.00 | 27,416,000 | |
| 小林洋行 | 5,500 | 240.00 | 1,320,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| かんぽ生命保険 | 200,800 | 2,236.00 | 448,988,800 | |
| SOMPOホールディングス | 283,900 | 5,709.00 | 1,620,785,100 | |
| アニコムホールディングス | 56,200 | 533.00 | 29,954,600 | 貸付有価証券 200株 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 336,600 | 4,550.00 | 1,531,530,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 第一生命ホールディング | 808,100 | 2,516.50 | 2,033,583,650 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|-------------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------------|
| ス | | | | 1,600株 |
| 東京海上ホールディングス | 1,635,000 | 2,756.50 | 4,506,877,500 | |
| T&Dホールディングス | 443,900 | 1,717.00 | 762,176,300 | 貸付有価証券 4,900株 |
| アドバンスクリエイト | 9,600 | 1,125.00 | 10,800,000 | 貸付有価証券 3,200株 |
| 全国保証 | 43,300 | 4,910.00 | 212,603,000 | 貸付有価証券 9,700株 |
| あんしん保証 | 6,300 | 263.00 | 1,656,900 | |
| ジェイリース | 4,300 | 2,005.00 | 8,621,500 | 貸付有価証券 2,000株 (1,700株) |
| イントラスト | 4,900 | 948.00 | 4,645,200 | |
| 日本モーゲージサービス | 7,100 | 604.00 | 4,288,400 | 貸付有価証券 3,500株 |
| C a s a | 5,000 | 869.00 | 4,345,000 | 貸付有価証券 2,100株 |
| アルヒ | 20,400 | 1,088.00 | 22,195,200 | 貸付有価証券 6,900株 (6,700株) |
| プレミアムグループ | 27,900 | 1,622.00 | 45,253,800 | 貸付有価証券 800株 (800株) |
| ネットプロテクションズ ホールディングス | 54,700 | 515.00 | 28,170,500 | 貸付有価証券 12,500株 (11,000 株) |
| クレディセゾン | 104,800 | 1,906.00 | 199,748,800 | 貸付有価証券 600株 |
| 芙蓉総合リース | 15,200 | 9,880.00 | 150,176,000 | 貸付有価証券 700株 |
| みずほリース | 24,600 | 3,885.00 | 95,571,000 | |
| 東京センチュリー | 30,900 | 4,660.00 | 143,994,000 | 貸付有価証券 4,700株 |
| 日本証券金融 | 66,300 | 1,072.00 | 71,073,600 | |
| アイフル | 273,900 | 369.00 | 101,069,100 | 貸付有価証券 1,700株 |
| リコーリース | 15,700 | 3,980.00 | 62,486,000 | 貸付有価証券 100株 |
| イオンフィナンシャルサ ービス | 95,000 | 1,223.00 | 116,185,000 | 貸付有価証券 100株 |
| アコム | 295,200 | 334.00 | 98,596,800 | 貸付有価証券 3,600株 |
| ジャックス | 17,600 | 4,630.00 | 81,488,000 | |
| オリエントコーポレーシ ョン | 43,200 | 1,137.00 | 49,118,400 | 貸付有価証券 4,000株 |
| オリックス | 1,085,800 | 2,331.00 | 2,530,999,800 | |
| 三菱HCキャピタル | 644,900 | 713.00 | 459,813,700 | 貸付有価証券 2,500株 |

| | | | | |
|------------------|---------|-----------|---------------|---------------------------|
| 九州リースサービス | 6,000 | 874.00 | 5,244,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 日本取引所グループ | 464,800 | 2,205.00 | 1,024,884,000 | |
| イー・ギャランティ | 26,800 | 2,101.00 | 56,306,800 | |
| アサックス | 5,800 | 621.00 | 3,601,800 | 貸付有価証券 500株 |
| NECキャピタルソリューション | 8,100 | 2,724.00 | 22,064,400 | 貸付有価証券 800株 |
| 大東建託 | 60,600 | 13,090.00 | 793,254,000 | |
| いちご | 190,500 | 252.00 | 48,006,000 | 貸付有価証券 38,400株 |
| 日本駐車場開発 | 175,100 | 241.00 | 42,199,100 | 貸付有価証券 42,100株 |
| スター・マイカ・ホールディングス | 14,900 | 642.00 | 9,565,800 | |
| SREホールディングス | 8,100 | 3,205.00 | 25,960,500 | 貸付有価証券 3,700株 (1,500株) |
| ADワークスグループ | 32,400 | 182.00 | 5,896,800 | 貸付有価証券 900株 (700株) |
| ヒューリック | 385,800 | 1,163.00 | 448,685,400 | 貸付有価証券 17,700株 |
| 三栄建築設計 | 8,000 | 1,497.00 | 11,976,000 | 貸付有価証券 400株 (400株) |
| 野村不動産ホールディングス | 103,400 | 3,345.00 | 345,873,000 | 貸付有価証券 6,100株 |
| 三重交通グループホールディングス | 35,400 | 593.00 | 20,992,200 | |
| サムティ | 26,300 | 2,215.00 | 58,254,500 | 貸付有価証券 9,900株 |
| ディア・ライフ | 28,200 | 727.00 | 20,501,400 | |
| コーセーアールイー | 4,100 | 768.00 | 3,148,800 | 貸付有価証券 2,300株 |
| 地主 | 12,600 | 1,954.00 | 24,620,400 | 貸付有価証券 5,900株 |
| プレサンスコーポレーション | 26,100 | 2,018.00 | 52,669,800 | |
| ハウスコム | 2,100 | 1,048.00 | 2,200,800 | |
| JPMC | 8,400 | 1,149.00 | 9,651,600 | |
| サンセイラディック | 3,800 | 880.00 | 3,344,000 | |
| エストラスト | 1,600 | 640.00 | 1,024,000 | |
| フージャースホールディングス | 25,500 | 859.00 | 21,904,500 | |
| オープンハウスグループ | 60,600 | 5,700.00 | 345,420,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| 東急不動産ホールディングス | 497,300 | 679.00 | 337,666,700 | 貸付有価証券 2,200株 |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|-----------------------|
| 飯田グループホールディングス | 144,900 | 2,445.00 | 354,280,500 | 貸付有価証券 18,900株 |
| イーランド | 2,000 | 1,507.00 | 3,014,000 | |
| ムゲンエステート | 8,600 | 647.00 | 5,564,200 | |
| ビーロット | 8,800 | 611.00 | 5,376,800 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| ファーストブラザーズ | 2,500 | 895.00 | 2,237,500 | 貸付有価証券 1,300株 |
| And Doホールディングス | 9,800 | 1,051.00 | 10,299,800 | |
| シーアールイー | 9,200 | 1,272.00 | 11,702,400 | 貸付有価証券 100株 |
| プロパティエージェント | 1,600 | 1,128.00 | 1,804,800 | |
| ケイアイスター不動産 | 8,000 | 4,300.00 | 34,400,000 | 貸付有価証券 200株 |
| アグレ都市デザイン | 2,300 | 1,556.00 | 3,578,800 | 貸付有価証券 100株 |
| グッドコムアセット | 15,300 | 790.00 | 12,087,000 | |
| ジェイ・エス・ビー | 4,100 | 4,350.00 | 17,835,000 | |
| ロードスターキャピタル | 9,400 | 1,403.00 | 13,188,200 | 貸付有価証券 3,000株 |
| テンポイノベーション | 3,900 | 1,223.00 | 4,769,700 | |
| グローバル・リンク・マネジメント | 2,500 | 1,169.00 | 2,922,500 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| フェイスネットワーク | 3,500 | 811.00 | 2,838,500 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| パーク24 | 128,900 | 2,161.00 | 278,552,900 | 貸付有価証券 6,800株 |
| パラカ | 5,800 | 2,033.00 | 11,791,400 | |
| 三井不動産 | 714,800 | 2,667.00 | 1,906,371,600 | 貸付有価証券 3,600株 |
| 三菱地所 | 998,100 | 1,666.00 | 1,662,834,600 | 貸付有価証券 200株 |
| 平和不動産 | 26,800 | 3,880.00 | 103,984,000 | |
| 東京建物 | 157,600 | 1,701.00 | 268,077,600 | 貸付有価証券 61,300株 |
| 京阪神ビルディング | 27,800 | 1,215.00 | 33,777,000 | |
| 住友不動産 | 299,000 | 3,107.00 | 928,993,000 | 貸付有価証券 8,200株 |
| テーオーシー | 29,900 | 631.00 | 18,866,900 | 貸付有価証券 3,500株 |
| 東京楽天地 | 2,700 | 4,260.00 | 11,502,000 | |
| レオパレス21 | 186,200 | 387.00 | 72,059,400 | 貸付有価証券 16,500株 |
| スターツコーポレーション | 23,700 | 2,589.00 | 61,359,300 | |

| | | | | |
|-------------------|---------|----------|-------------|----------------------------|
| ン | | | | |
| フジ住宅 | 23,100 | 704.00 | 16,262,400 | |
| 空港施設 | 20,000 | 574.00 | 11,480,000 | |
| 明和地所 | 6,200 | 833.00 | 5,164,600 | |
| ゴールドクレスト | 15,700 | 1,777.00 | 27,898,900 | |
| エスリード | 7,800 | 2,223.00 | 17,339,400 | 貸付有価証券 400株 |
| 日神グループホールディングス | 26,500 | 470.00 | 12,455,000 | |
| 日本エスコン | 37,100 | 869.00 | 32,239,900 | |
| MIRARTHホールディングス | 83,600 | 387.00 | 32,353,200 | |
| AVANTIA | 7,200 | 830.00 | 5,976,000 | 貸付有価証券 300株 |
| イオンモール | 85,800 | 1,855.00 | 159,159,000 | |
| 毎日コムネット | 4,700 | 830.00 | 3,901,000 | 貸付有価証券 2,200株(400株) |
| ファースト住建 | 5,200 | 1,100.00 | 5,720,000 | 貸付有価証券 900株 |
| カチタス | 44,500 | 2,634.00 | 117,213,000 | |
| トーセイ | 27,500 | 1,655.00 | 45,512,500 | 貸付有価証券 200株 |
| 穴吹興産 | 2,500 | 2,324.00 | 5,810,000 | 貸付有価証券 1,100株 |
| サンフロンティア不動産 | 27,600 | 1,334.00 | 36,818,400 | |
| FJネクストホールディングス | 17,400 | 1,036.00 | 18,026,400 | 貸付有価証券 2,600株 |
| インテリックス | 3,100 | 565.00 | 1,751,500 | |
| ランドビジネス | 4,700 | 283.00 | 1,330,100 | |
| サンネクスタグループ | 3,800 | 1,008.00 | 3,830,400 | |
| グランディハウス | 10,800 | 562.00 | 6,069,600 | |
| 日本空港ビルデング | 58,500 | 6,660.00 | 389,610,000 | |
| 明豊ファシリティワークス | 6,700 | 797.00 | 5,339,900 | |
| 日本工営 | 10,400 | 3,795.00 | 39,468,000 | |
| LIFULL | 59,000 | 216.00 | 12,744,000 | 貸付有価証券 10,500株(10,500株) |
| MIXI | 39,300 | 2,847.00 | 111,887,100 | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 15,600 | 2,507.00 | 39,109,200 | |
| 日本M&Aセンターホールディングス | 296,300 | 1,001.00 | 296,596,300 | 貸付有価証券 21,900株 |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| メンバーズ | 5,000 | 1,303.00 | 6,515,000 | 貸付有価証券 800株 |
| 中広 | 1,900 | 398.00 | 756,200 | |
| UTグループ | 25,400 | 2,606.00 | 66,192,400 | |
| アイティメディア | 6,600 | 1,276.00 | 8,421,600 | |
| E・Jホールディングス | 10,100 | 1,631.00 | 16,473,100 | 貸付有価証券 3,400株 |
| オープンアップグループ | 51,800 | 1,923.00 | 99,611,400 | |
| コシダカホールディングス | 51,700 | 1,120.00 | 57,904,000 | 貸付有価証券 14,200株 |
| アルトナー | 3,300 | 1,410.00 | 4,653,000 | |
| パソナグループ | 20,900 | 1,867.00 | 39,020,300 | 貸付有価証券 2,800株 |
| CDS | 3,300 | 1,830.00 | 6,039,000 | |
| リンクアンドモチベーション | 49,700 | 481.00 | 23,905,700 | 貸付有価証券 4,500株 (4,500株) |
| エス・エム・エス | 65,700 | 3,045.00 | 200,056,500 | |
| サニーサイドアップグループ | 4,000 | 732.00 | 2,928,000 | 貸付有価証券 300株 (300株) |
| パーソルホールディングス | 193,300 | 2,789.00 | 539,113,700 | |
| リニカル | 7,600 | 699.00 | 5,312,400 | |
| クックパッド | 47,200 | 191.00 | 9,015,200 | 貸付有価証券 7,800株 (5,800株) |
| エスクリ | 5,500 | 457.00 | 2,513,500 | 貸付有価証券 2,600株 |
| アイ・ケイ・ケイホールディングス | 6,600 | 660.00 | 4,356,000 | 貸付有価証券 1,700株 |
| 学情 | 7,800 | 1,616.00 | 12,604,800 | 貸付有価証券 2,600株 |
| スタジオアリス | 8,600 | 2,155.00 | 18,533,000 | 貸付有価証券 4,100株 |
| シミックホールディングス | 8,300 | 1,983.00 | 16,458,900 | |
| エプコ | 2,900 | 751.00 | 2,177,900 | 貸付有価証券 1,300株 (300株) |
| NJS | 3,800 | 2,298.00 | 8,732,400 | |
| 総合警備保障 | 64,100 | 3,855.00 | 247,105,500 | |
| カカコム | 126,700 | 1,825.00 | 231,227,500 | |
| セントケア・ホールディング | 11,000 | 781.00 | 8,591,000 | |
| サイネックス | 2,300 | 573.00 | 1,317,900 | |
| ルネサンス | 12,100 | 950.00 | 11,495,000 | 貸付有価証券 1,000株 (600株) |

| | | | | |
|------------------|---------|----------|---------------|---------------------------|
| ディップ | 30,200 | 3,380.00 | 102,076,000 | 貸付有価証券 900株 |
| デジタルホールディングス | 13,500 | 1,195.00 | 16,132,500 | |
| 新日本科学 | 18,300 | 2,230.00 | 40,809,000 | 貸付有価証券 6,900株 |
| キャリアデザインセンター | 2,800 | 1,617.00 | 4,527,600 | |
| ベネフィット・ワン | 80,000 | 1,870.00 | 149,600,000 | 貸付有価証券 3,400株 |
| エムスリー | 341,200 | 3,031.00 | 1,034,177,200 | 貸付有価証券 900株 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 8,600 | 461.00 | 3,964,600 | |
| プラス | 1,500 | 1,131.00 | 1,696,500 | |
| アウトソーシング | 102,800 | 1,428.00 | 146,798,400 | |
| ウェルネット | 10,200 | 630.00 | 6,426,000 | 貸付有価証券 3,600株 (3,600株) |
| ワールドホールディングス | 7,800 | 2,766.00 | 21,574,800 | 貸付有価証券 700株 |
| ディー・エヌ・エー | 69,000 | 1,947.00 | 134,343,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 博報堂D Yホールディングス | 220,200 | 1,585.00 | 349,017,000 | 貸付有価証券 20,800株 |
| ぐるなび | 31,700 | 361.00 | 11,443,700 | 貸付有価証券 3,800株 |
| タカミヤ | 23,400 | 449.00 | 10,506,600 | 貸付有価証券 100株 |
| ジャパンベストレスキューシステム | 8,600 | 721.00 | 6,200,600 | |
| ファンコミュニケーションズ | 33,800 | 416.00 | 14,060,800 | |
| ライク | 6,400 | 1,844.00 | 11,801,600 | 貸付有価証券 3,000株 |
| ビジネス・ブレークスルー | 5,000 | 431.00 | 2,155,000 | |
| エスプール | 49,600 | 613.00 | 30,404,800 | 貸付有価証券 2,400株 |
| WDBホールディングス | 8,800 | 2,054.00 | 18,075,200 | |
| ティア | 7,900 | 455.00 | 3,594,500 | |
| CDG | 1,400 | 1,359.00 | 1,902,600 | |
| アドウェイズ | 23,700 | 701.00 | 16,613,700 | 貸付有価証券 6,000株 (4,100株) |
| バリューコマース | 13,000 | 1,339.00 | 17,407,000 | |
| インフォマート | 179,200 | 297.00 | 53,222,400 | 貸付有価証券 8,700株 |

| | | | | |
|------------------------|---------|----------|---------------|-------------------------|
| J Pホールディングス | 49,700 | 318.00 | 15,804,600 | 貸付有価証券 4,500株 |
| C Lホールディングス | 4,800 | 933.00 | 4,478,400 | 貸付有価証券 2,200株 |
| プレステージ・インター ナショナル | 72,700 | 593.00 | 43,111,100 | |
| アミューズ | 9,400 | 1,843.00 | 17,324,200 | |
| ドリームインキュベータ | 5,300 | 2,752.00 | 14,585,600 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| クイック | 13,200 | 1,985.00 | 26,202,000 | |
| T A C | 6,500 | 204.00 | 1,326,000 | 貸付有価証券 200株 |
| 電通グループ | 169,700 | 4,875.00 | 827,287,500 | 貸付有価証券 29,100株 |
| テイクアンドギヴ・ニ ーズ | 4,600 | 1,351.00 | 6,214,600 | 貸付有価証券 1,900株 (200株) |
| びあ | 5,800 | 3,410.00 | 19,778,000 | |
| イオンファンタジー | 7,400 | 3,225.00 | 23,865,000 | 貸付有価証券 3,000株 |
| シーティーエス | 19,100 | 739.00 | 14,114,900 | |
| ネクシィーズグループ | 4,100 | 651.00 | 2,669,100 | |
| H. U. グループホール ディングス | 50,500 | 2,795.00 | 141,147,500 | 貸付有価証券 2,900株 |
| アルプス技研 | 15,000 | 2,567.00 | 38,505,000 | |
| 日本空調サービス | 18,500 | 737.00 | 13,634,500 | |
| オリエンタルランド | 913,700 | 4,860.00 | 4,440,582,000 | |
| ダスキン | 38,400 | 3,330.00 | 127,872,000 | |
| 明光ネットワークジャ パン | 21,000 | 651.00 | 13,671,000 | |
| ファルコホールディン グス | 7,800 | 2,019.00 | 15,748,200 | |
| 秀英予備校 | 3,000 | 409.00 | 1,227,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ラウンドワン | 144,400 | 648.00 | 93,571,200 | 貸付有価証券 40,200株 |
| リゾートトラスト | 68,200 | 2,252.00 | 153,586,400 | 貸付有価証券 1,200株 |
| ビー・エム・エル | 21,400 | 3,090.00 | 66,126,000 | |
| りらいあコミュニケー ションズ | 28,200 | 1,460.00 | 41,172,000 | 貸付有価証券 500株 (500株) |
| リゾー教育 | 78,500 | 286.00 | 22,451,000 | 貸付有価証券 400株 |
| 早稲田アカデミー | 9,600 | 1,409.00 | 13,526,400 | 貸付有価証券 2,300株 |
| ユー・エス・エス | 177,600 | 2,260.00 | 401,376,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|--------------------|---------|----------|-------------|--------------------------|
| | | | | 1,400株 |
| 東京個別指導学院 | 20,500 | 542.00 | 11,111,000 | 貸付有価証券 2,500株(600株) |
| サイバーエージェント | 381,400 | 1,130.00 | 430,982,000 | 貸付有価証券 26,900株 |
| 楽天グループ | 800,100 | 670.00 | 536,067,000 | 貸付有価証券 259,900株 |
| クリーク・アンド・リバー社 | 10,100 | 2,061.00 | 20,816,100 | 貸付有価証券 3,900株(900株) |
| SBIグローバルアセットマネジメント | 28,200 | 498.00 | 14,043,600 | |
| テー・オー・ダブリュー | 33,800 | 332.00 | 11,221,600 | 貸付有価証券 300株 |
| 山田コンサルティンググループ | 8,700 | 1,975.00 | 17,182,500 | |
| セントラルスポーツ | 6,500 | 2,558.00 | 16,627,000 | 貸付有価証券 2,500株 |
| フルキャストホールディングス | 16,500 | 2,423.00 | 39,979,500 | |
| エン・ジャパン | 31,200 | 2,396.00 | 74,755,200 | |
| リソルホールディングス | 1,200 | 4,850.00 | 5,820,000 | 貸付有価証券 600株(200株) |
| テクノプロ・ホールディングス | 102,100 | 3,430.00 | 350,203,000 | |
| アトラグループ | 3,000 | 185.00 | 555,000 | |
| インターワークス | 3,400 | 362.00 | 1,230,800 | |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 9,000 | 2,152.00 | 19,368,000 | 貸付有価証券 3,300株 |
| Keepers 技研 | 10,700 | 5,810.00 | 62,167,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ファーストロジック | 1,600 | 875.00 | 1,400,000 | 貸付有価証券 200株(200株) |
| 三機サービス | 2,000 | 1,153.00 | 2,306,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| Gunosy | 13,700 | 577.00 | 7,904,900 | 貸付有価証券 2,900株 |
| デザインワン・ジャパン | 3,300 | 180.00 | 594,000 | 貸付有価証券 900株(800株) |
| イー・ガーディアン | 6,500 | 2,287.00 | 14,865,500 | 貸付有価証券 3,000株(500株) |
| リブセンス | 6,200 | 281.00 | 1,742,200 | 貸付有価証券 2,500株(1,200株) |
| ジャパンマテリアル | 52,800 | 2,065.00 | 109,032,000 | 貸付有価証券 2,400株 |
| ベクトル | 27,100 | 1,265.00 | 34,281,500 | |
| ウチヤマホールディングス | 5,700 | 278.00 | 1,584,600 | 貸付有価証券 200株(200株) |

| | | | | |
|-----------------------|-----------|----------|---------------|---------------------------|
| チャーム・ケア・コーポレーション | 14,400 | 1,112.00 | 16,012,800 | 貸付有価証券 1,400株 |
| キャリアリンク | 6,300 | 2,244.00 | 14,137,200 | 貸付有価証券 2,200株 (1,200株) |
| I B J | 10,600 | 640.00 | 6,784,000 | 貸付有価証券 4,900株 (3,600株) |
| アサンテ | 8,500 | 1,652.00 | 14,042,000 | |
| バリューHR | 15,100 | 1,518.00 | 22,921,800 | 貸付有価証券 5,200株 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 13,900 | 3,310.00 | 46,009,000 | 貸付有価証券 400株 |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 6,100 | 1,088.00 | 6,636,800 | |
| ERIホールディングス | 3,400 | 1,415.00 | 4,811,000 | |
| アピスト | 2,100 | 3,040.00 | 6,384,000 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| シグマクス・ホールディングス | 26,200 | 1,209.00 | 31,675,800 | 貸付有価証券 300株 |
| ウィルグループ | 14,400 | 1,098.00 | 15,811,200 | 貸付有価証券 800株 |
| エスクロー・エージェン ト・ジャパン | 14,100 | 142.00 | 2,002,200 | |
| メドピア | 15,200 | 1,114.00 | 16,932,800 | 貸付有価証券 3,400株 |
| レアジョブ | 2,600 | 1,492.00 | 3,879,200 | 貸付有価証券 100株 |
| リクルートホールディング ス | 1,278,200 | 3,831.00 | 4,896,784,200 | 貸付有価証券 18,300株 |
| エラン | 22,800 | 994.00 | 22,663,200 | |
| 土木管理総合試験所 | 5,600 | 335.00 | 1,876,000 | |
| 日本郵政 | 2,262,800 | 1,130.50 | 2,558,095,400 | |
| ベルシステム24ホール ディングス | 23,100 | 1,427.00 | 32,963,700 | 貸付有価証券 1,800株 |
| 鎌倉新書 | 19,600 | 907.00 | 17,777,200 | 貸付有価証券 2,800株 |
| SMN | 3,200 | 472.00 | 1,510,400 | 貸付有価証券 600株 |
| 一蔵 | 1,700 | 584.00 | 992,800 | |
| グローバルキッズCOM PANY | 2,500 | 671.00 | 1,677,500 | 貸付有価証券 1,200株 (1,200株) |
| エアトリ | 12,600 | 2,638.00 | 33,238,800 | 貸付有価証券 5,800株 |
| アトラエ | 10,200 | 825.00 | 8,415,000 | 貸付有価証券 100株 |
| ストライク | 7,300 | 3,475.00 | 25,367,500 | 貸付有価証券 1,200株 (800株) |

| | | | | |
|--------------------------|---------|----------|-------------|---------------------------|
| ソラスト | 47,600 | 651.00 | 30,987,600 | |
| セラク | 5,300 | 1,648.00 | 8,734,400 | 貸付有価証券 100株 |
| インソース | 37,500 | 1,252.00 | 46,950,000 | 貸付有価証券 800株 |
| ベйкаレント・コンサル ディング | 136,700 | 5,100.00 | 697,170,000 | 貸付有価証券 40,700株 |
| Orchestra H oldings | 3,700 | 1,541.00 | 5,701,700 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| アイモバイル | 7,700 | 1,286.00 | 9,902,200 | |
| キャリアインデックス | 4,600 | 342.00 | 1,573,200 | |
| MS-Japan | 4,400 | 1,028.00 | 4,523,200 | 貸付有価証券 600株 |
| 船場 | 2,300 | 768.00 | 1,766,400 | |
| ジャパンエレベーターサ ービスホールディン | 61,500 | 1,977.00 | 121,585,500 | 貸付有価証券 2,600株 |
| フルテック | 1,900 | 1,109.00 | 2,107,100 | |
| グリーンズ | 4,500 | 1,510.00 | 6,795,000 | 貸付有価証券 1,000株 |
| ツナググループ・ホール ディングス | 3,800 | 712.00 | 2,705,600 | |
| GameWith | 4,000 | 366.00 | 1,464,000 | 貸付有価証券 1,900株 (100株) |
| MS&Consulti ng | 1,600 | 613.00 | 980,800 | |
| ウェルビー | 12,700 | 696.00 | 8,839,200 | |
| エル・ティー・エス | 2,200 | 2,589.00 | 5,695,800 | |
| ミダックホールディング ス | 10,500 | 2,004.00 | 21,042,000 | 貸付有価証券 500株 |
| 日総工産 | 12,900 | 795.00 | 10,255,500 | 貸付有価証券 1,500株 |
| キュービーネットホール ディングス | 8,200 | 1,423.00 | 11,668,600 | |
| RPAホールディングス | 23,400 | 368.00 | 8,611,200 | 貸付有価証券 4,400株 (4,400株) |
| スプリックス | 3,900 | 942.00 | 3,673,800 | |
| マネジメントソリューシ ョンズ | 9,500 | 3,180.00 | 30,210,000 | 貸付有価証券 4,400株 |
| プロレド・パートナーズ | 4,200 | 502.00 | 2,108,400 | |
| and factory | 4,000 | 385.00 | 1,540,000 | |
| テノ.ホールディングス | 1,600 | 764.00 | 1,222,400 | |
| フロンティア・マネジメ ント | 5,800 | 934.00 | 5,417,200 | 貸付有価証券 500株 (100株) |
| ピアラ | 2,200 | 530.00 | 1,166,000 | 貸付有価証券 100株 |

| | | | | |
|--------------------|--------|----------|-------------|----------------------------|
| コプロ・ホールディングス | 2,200 | 1,491.00 | 3,280,200 | |
| ギークス | 1,900 | 1,164.00 | 2,211,600 | 貸付有価証券 800株 |
| アンビスホールディングス | 18,500 | 2,853.00 | 52,780,500 | 貸付有価証券 8,600株 |
| カーブスホールディングス | 47,200 | 775.00 | 36,580,000 | 貸付有価証券 500株 |
| フォーラムエンジニアリング | 10,100 | 850.00 | 8,585,000 | |
| Fast Fitness Japan | 5,900 | 1,793.00 | 10,578,700 | |
| ダイレクトマーケティングミックス | 20,700 | 1,307.00 | 27,054,900 | 貸付有価証券 1,300株 |
| ポピンズ | 2,600 | 1,762.00 | 4,581,200 | |
| LITALICO | 13,400 | 2,686.00 | 35,992,400 | |
| アドバンテッジリスクマネジメント | 6,100 | 464.00 | 2,830,400 | |
| リログループ | 96,100 | 2,085.00 | 200,368,500 | |
| 東祥 | 12,000 | 1,365.00 | 16,380,000 | 貸付有価証券 700株 |
| ビーウィズ | 4,300 | 1,987.00 | 8,544,100 | |
| TREホールディングス | 36,300 | 1,215.00 | 44,104,500 | |
| 人・夢・技術グループ | 6,500 | 1,544.00 | 10,036,000 | |
| 大栄環境 | 43,900 | 1,891.00 | 83,014,900 | 貸付有価証券 200株 |
| 日本管財ホールディングス | 18,100 | 2,672.00 | 48,363,200 | |
| エイチ・アイ・エス | 45,100 | 1,993.00 | 89,884,300 | 貸付有価証券 18,000株 |
| ラックランド | 7,200 | 3,250.00 | 23,400,000 | 貸付有価証券 1,800株 (1,800株) |
| 共立メンテナンス | 29,600 | 5,420.00 | 160,432,000 | 貸付有価証券 13,700株 (9,600株) |
| イチネンホールディングス | 18,300 | 1,335.00 | 24,430,500 | |
| 建設技術研究所 | 8,900 | 3,525.00 | 31,372,500 | |
| スペース | 12,500 | 955.00 | 11,937,500 | |
| 燦ホールディングス | 7,300 | 2,324.00 | 16,965,200 | |
| スバル興業 | 800 | 9,550.00 | 7,640,000 | |
| 東京テアトル | 4,900 | 1,140.00 | 5,586,000 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| タナベコンサルティンググループ | 5,200 | 910.00 | 4,732,000 | |
| ナガワ | 4,600 | 6,380.00 | 29,348,000 | 貸付有価証券 |

| | | | | |
|----------------|---------------------------|----------|---------------------------|-------------------------|
| | | | | 1,400株 |
| 東京都競馬 | 14,500 | 4,210.00 | 61,045,000 | |
| 常磐興産 | 4,600 | 1,256.00 | 5,777,600 | 貸付有価証券 2,600株 |
| カナモト | 31,600 | 2,272.00 | 71,795,200 | 貸付有価証券 200株 |
| ニシオホールディングス | 16,000 | 3,310.00 | 52,960,000 | |
| トランス・コスモス | 21,500 | 3,315.00 | 71,272,500 | 貸付有価証券 600株 |
| 乃村工藝社 | 75,300 | 937.00 | 70,556,100 | |
| 藤田観光 | 7,700 | 3,570.00 | 27,489,000 | 貸付有価証券 200株 (200株) |
| KNT-CTホールディングス | 10,300 | 1,547.00 | 15,934,100 | 貸付有価証券 600株 |
| トーカイ | 15,300 | 2,029.00 | 31,043,700 | |
| 白洋舎 | 1,700 | 2,200.00 | 3,740,000 | 貸付有価証券 700株 |
| セコム | 175,800 | 8,822.00 | 1,550,907,600 | |
| セントラル警備保障 | 9,300 | 2,806.00 | 26,095,800 | 貸付有価証券 100株 |
| 丹青社 | 33,500 | 830.00 | 27,805,000 | |
| メイテック | 67,400 | 2,251.00 | 151,717,400 | |
| 応用地質 | 16,100 | 2,078.00 | 33,455,800 | |
| 船井総研ホールディングス | 35,900 | 2,604.00 | 93,483,600 | |
| 進学会ホールディングス | 4,400 | 296.00 | 1,302,400 | 貸付有価証券 2,100株 (200株) |
| オオバ | 8,300 | 784.00 | 6,507,200 | 貸付有価証券 4,800株 (200株) |
| いであ | 3,000 | 1,610.00 | 4,830,000 | 貸付有価証券 100株 |
| 学究社 | 6,900 | 2,223.00 | 15,338,700 | 貸付有価証券 400株 (400株) |
| ベネッセホールディングス | 64,400 | 1,970.00 | 126,868,000 | 貸付有価証券 2,900株 |
| イオンディライト | 19,100 | 3,035.00 | 57,968,500 | |
| ナック | 7,600 | 959.00 | 7,288,400 | |
| ダイセキ | 35,200 | 4,110.00 | 144,672,000 | 貸付有価証券 300株 |
| ステップ | 6,300 | 1,795.00 | 11,308,500 | 貸付有価証券 100株 (100株) |
| 小計 | 銘柄数：2,143 組入時価比率：98.0% | | 501,080,719,500 100.0% | |
| 合計 | | | 501,080,719,500 | |

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

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

(2)株式以外の有価証券(2023年5月10日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 2023年5月10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 | 9,407,786,600 | — | 9,915,625,000 | 507,603,275 |
| 合計 | 9,407,786,600 | — | 9,915,625,000 | 507,603,275 |

(注)時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2023年5月10日現在)

| | |
|----------|-------------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 19,517,550,359 |
| コール・ローン | 1,813,986,126 |
| 株式 | 1,481,755,270,080 |
| 投資証券 | 32,513,474,981 |
| 派生商品評価勘定 | 629,402,768 |
| 未収入金 | 121,244,903 |
| 未収配当金 | 1,520,046,666 |
| 差入委託証拠金 | 5,511,244,999 |
| 流動資産合計 | 1,543,382,220,882 |
| 資産合計 | 1,543,382,220,882 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 29,255,358 |
| 未払解約金 | 1,655,580,306 |
| 未払利息 | 2,973 |
| その他未払費用 | 6,944,900 |
| 流動負債合計 | 1,691,783,537 |

| | |
|------------------|-----------------------|
| 負債合計 | 1, 691, 783, 537 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 317, 097, 722, 497 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金 (△) | 1, 224, 592, 714, 848 |
| 元本等合計 | 1, 541, 690, 437, 345 |
| 純資産合計 | 1, 541, 690, 437, 345 |
| 負債純資産合計 | 1, 543, 382, 220, 882 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|----------------------------|-----------|
| 2023年5月10日現在 | |
| 1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | |
| 1口当たり純資産額 | 4.8619円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (48,619円) |

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

| |
|------------------------------|
| 自 2022年5月11日 至 2023年5月10日 |
|------------------------------|

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2023年5月10日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2023年5月10日現在

| | |
|----------------------------------|------------------|
| 期首 | 2022年5月11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 | 277,899,529,064円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 60,508,365,313円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 21,310,171,880円 |
| 期末元本額 | 317,097,722,497円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 28,279,732円 |
| バランスセレクト50 | 88,015,341円 |
| バランスセレクト70 | 110,978,788円 |
| 野村外国株式インデックスファンド | 501,297,257円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 2,836,190,203円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 3,691,031,969円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 4,313,217,005円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 8,639,730円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 9,439,549円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 15,793,718円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 25,010,024円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 24,034,205円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 41,935,221円 |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け) | 45,042,862,171円 |

| | |
|--|---------------------|
| のむラップ・ファンド (保守型) | 1, 227, 395, 778 円 |
| のむラップ・ファンド (普通型) | 12, 211, 975, 448 円 |
| のむラップ・ファンド (積極型) | 13, 537, 239, 153 円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 9, 426, 101 円 |
| 野村インデックスファンド・外国株式 | 8, 755, 343, 178 円 |
| マイ・ロード | 1, 299, 947, 099 円 |
| ネクストコア | 14, 879, 418 円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 183, 504, 386 円 |
| 野村外国株インデックスBコース (野村SMA・EW向け) | 2, 755, 054, 687 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (配分変更コース) | 333, 851, 408 円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 10, 502, 160 円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 2, 711, 298 円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 1, 706, 713 円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 1, 363, 513 円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 1, 257, 203 円 |
| のむラップ・ファンド (やや保守型) | 271, 175, 201 円 |
| のむラップ・ファンド (やや積極型) | 1, 223, 617, 967 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプI) | 4, 067, 155 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプII) | 3, 920, 368 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプIII) | 35, 695, 245 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプIV) | 11, 623, 841 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプV) | 45, 909, 278 円 |
| 野村6資産均等バランス | 1, 773, 449, 632 円 |
| 野村つみたて外国株投信 | 15, 296, 269, 658 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, 485, 257, 473 円 |
| 世界6資産分散ファンド | 39, 380, 630 円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 8, 359, 050 円 |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信 | 1, 836, 693, 707 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 | 7, 327, 201, 736 円 |
| ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 外国株式 | 6, 758, 408, 304 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) | 103, 957, 027 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) | 57, 370, 419 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) | 423, 960, 206 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) | 374, 582, 851 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) | 709, 270 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, 021, 499 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) | 211, 078 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) | 516, 800 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) | 7, 400, 309 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) | 333, 255, 159 円 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用) | 3, 795, 651 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) | 24, 947, 419 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) | 69, 774, 853 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, 990, 687, 029 円 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 16, 184, 396 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, 235, 520, 252 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, 596, 596, 276 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) | 990, 172 円 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 1, 338, 899 円 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | 8, 461, 140 円 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 8, 389, 906 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) | 95, 503, 698, 852 円 |

| | |
|----------------------------------|------------------|
| マイバランス30 (確定拠出年金向け) | 1,966,108,954 円 |
| マイバランス50 (確定拠出年金向け) | 7,713,962,791 円 |
| マイバランス70 (確定拠出年金向け) | 7,835,940,246 円 |
| マイバランスDC30 | 839,734,261 円 |
| マイバランスDC50 | 1,972,902,838 円 |
| マイバランスDC70 | 1,867,897,483 円 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I | 42,560,779,360 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 564,817,530 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 38,484,059 円 |
| マイターゲット2050 (確定拠出年金向け) | 519,341,539 円 |
| マイターゲット2030 (確定拠出年金向け) | 513,163,378 円 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け) | 476,503,350 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 20,533,309 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 9,846,519 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 56,009,479 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030 | 11,425,015 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 11,117,608 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 8,266,797 円 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け) | 318,573,363 円 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け) | 226,702,432 円 |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け) | 149,268,853 円 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け) | 187,599,316 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 6,419,796 円 |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け) | 66,825,271 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) | 99,290,053 円 |
| みらいバランス・株式10 (富士通企業年金基金DC向け) | 59,420,191 円 |
| 野村DCバランスファンド (年金運用戦略タイプ) | 26,507,542 円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2023年5月10日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|----|-----|------------------------|---------|--------|---------------|----|
| | | | | 単価 | 金額 | |
| 株式 | 米ドル | BAKER HUGHES CO | 221,000 | 28.19 | 6,229,990.00 | |
| | | HALLIBURTON CO | 202,000 | 30.10 | 6,080,200.00 | |
| | | SCHLUMBERGER LTD | 313,600 | 47.17 | 14,792,512.00 | |
| | | APA CORPORATION | 72,000 | 33.16 | 2,387,520.00 | |
| | | CHENIERE ENERGY INC | 49,500 | 149.58 | 7,404,210.00 | |
| | | CHESAPEAKE ENERGY CORP | 26,100 | 78.09 | 2,038,149.00 | |
| | | CHEVRON CORP | 407,700 | 159.12 | 64,873,224.00 | |
| | | CONOCOPHILLIPS | 276,500 | 101.53 | 28,073,045.00 | |
| | | COTERRA ENERGY INC | 177,000 | 24.84 | 4,396,680.00 | |
| | | DEVON ENERGY CORP | 135,600 | 49.17 | 6,667,452.00 | |
| | | DIAMONDBACK ENERGY INC | 36,700 | 132.91 | 4,877,797.00 | |
| | | EOG RESOURCES INC | 130,000 | 113.77 | 14,790,100.00 | |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|----------|---------------|
| EQT CORP | 70,000 | 32.32 | 2,262,400.00 |
| EXXON MOBIL CORP | 913,900 | 109.14 | 99,743,046.00 |
| HESS CORP | 61,300 | 136.16 | 8,346,608.00 |
| HF SINCLAIR CORP | 34,200 | 39.37 | 1,346,454.00 |
| KINDER MORGAN INC | 444,000 | 16.85 | 7,481,400.00 |
| MARATHON OIL CORP | 138,000 | 22.90 | 3,160,200.00 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 103,800 | 110.94 | 11,515,572.00 |
| OCCIDENTAL PETE CORP | 162,800 | 58.96 | 9,598,688.00 |
| ONEOK INC | 97,700 | 63.86 | 6,239,122.00 |
| OVINTIV INC | 53,500 | 34.78 | 1,860,730.00 |
| PHILLIPS 66 | 105,800 | 93.98 | 9,943,084.00 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 49,700 | 211.24 | 10,498,628.00 |
| TARGA RESOURCES CORP | 48,000 | 71.18 | 3,416,640.00 |
| TEXAS PACIFIC LAND CORP | 1,350 | 1,393.61 | 1,881,373.50 |
| VALERO ENERGY CORP | 86,200 | 108.40 | 9,344,080.00 |
| WILLIAMS COS | 273,000 | 29.45 | 8,039,850.00 |
| AIR PRODUCTS | 49,100 | 279.94 | 13,745,054.00 |
| ALBEMARLE CORP | 26,100 | 195.17 | 5,093,937.00 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 24,600 | 104.54 | 2,571,684.00 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 43,500 | 67.79 | 2,948,865.00 |
| CORTEVA INC | 157,800 | 57.10 | 9,010,380.00 |
| DOW INC | 156,600 | 53.67 | 8,404,722.00 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 110,200 | 64.27 | 7,082,554.00 |
| EASTMAN CHEMICAL CO. | 27,200 | 80.13 | 2,179,536.00 |
| ECOLAB INC | 57,400 | 172.85 | 9,921,590.00 |
| FMC CORP | 28,400 | 110.50 | 3,138,200.00 |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 55,300 | 90.31 | 4,994,143.00 |
| LINDE PLC | 109,600 | 364.70 | 39,971,120.00 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 58,200 | 91.27 | 5,311,914.00 |
| MOSAIC CO/THE | 76,000 | 37.17 | 2,824,920.00 |
| PPG INDUSTRIES | 52,800 | 137.14 | 7,240,992.00 |
| RPM INTERNATIONAL INC | 27,800 | 79.75 | 2,217,050.00 |
| SHERWIN-WILLIAMS | 54,600 | 229.35 | 12,522,510.00 |
| WESTLAKE CORPORATION | 7,500 | 118.14 | 886,050.00 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 13,500 | 398.69 | 5,382,315.00 |

| | | | |
|---------------------------------------|---------|--------|---------------|
| VULCAN MATERIALS CO | 30,000 | 193.11 | 5,793,300.00 |
| AMCOR PLC | 335,000 | 10.31 | 3,453,850.00 |
| AVERY DENNISON CORP | 18,000 | 170.13 | 3,062,340.00 |
| BALL CORP | 68,700 | 57.03 | 3,917,961.00 |
| CROWN HOLDINGS INC | 27,100 | 83.41 | 2,260,411.00 |
| IP (INTERNATIONAL PAPER CO) | 73,000 | 32.12 | 2,344,760.00 |
| PACKAGING CORP OP AMERICA | 20,300 | 133.35 | 2,707,005.00 |
| SEALED AIR CORP | 33,000 | 42.64 | 1,407,120.00 |
| WESTROCK CO | 57,000 | 27.68 | 1,577,760.00 |
| ALCOA CORP | 41,000 | 36.51 | 1,496,910.00 |
| CLEVELAND-CLIFFS INC | 115,000 | 15.04 | 1,729,600.00 |
| FREEMONT-MCMORAN INC | 316,000 | 36.66 | 11,584,560.00 |
| NEWMONT CORP | 177,000 | 48.15 | 8,522,550.00 |
| NUCOR CORP | 57,500 | 140.17 | 8,059,775.00 |
| RELIANCE STEEL & ALUMINUM | 12,800 | 243.18 | 3,112,704.00 |
| STEEL DYNAMICS | 39,800 | 97.52 | 3,881,296.00 |
| AXON ENTERPRISE INC | 14,700 | 226.88 | 3,335,136.00 |
| BOEING CO | 125,600 | 201.88 | 25,356,128.00 |
| GENERAL DYNAMICS | 51,700 | 211.20 | 10,919,040.00 |
| HEICO CORP | 9,300 | 171.57 | 1,595,601.00 |
| HEICO CORP-CLASS A | 17,000 | 134.98 | 2,294,660.00 |
| HOWMET AEROSPACE INC | 83,000 | 44.76 | 3,715,080.00 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 8,400 | 194.48 | 1,633,632.00 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 41,700 | 188.87 | 7,875,879.00 |
| LOCKHEED MARTIN | 52,300 | 452.04 | 23,641,692.00 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 32,600 | 442.31 | 14,419,306.00 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 326,200 | 96.27 | 31,403,274.00 |
| TEXTRON INC | 46,400 | 65.35 | 3,032,240.00 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 11,480 | 808.41 | 9,280,546.80 |
| ALLEGION PLC | 19,700 | 107.85 | 2,124,645.00 |
| CARLISLE COS INC | 11,400 | 210.81 | 2,403,234.00 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 188,000 | 42.78 | 8,042,640.00 |
| FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC | 27,500 | 65.61 | 1,804,275.00 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 151,200 | 62.98 | 9,522,576.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 7,100 | 281.51 | 1,998,721.00 |
| MASCO CORP | 49,600 | 53.76 | 2,666,496.00 |
| OWENS CORNING INC | 21,100 | 105.72 | 2,230,692.00 |
| SMITH (A. O.) CORP | 27,900 | 69.32 | 1,934,028.00 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 50,900 | 177.81 | 9,050,529.00 |
| AECOM | 28,700 | 80.15 | 2,300,305.00 |
| QUANTA SERVICES INC | 32,200 | 171.00 | 5,506,200.00 |
| AMETEK INC | 51,600 | 144.41 | 7,451,556.00 |
| EATON CORP PLC | 88,800 | 170.55 | 15,144,840.00 |
| EMERSON ELEC | 132,300 | 83.65 | 11,066,895.00 |
| GENERAC HOLDINGS INC | 13,100 | 111.77 | 1,464,187.00 |
| HUBBELL INC | 12,200 | 270.92 | 3,305,224.00 |
| PLUG POWER INC | 118,000 | 8.00 | 944,590.00 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 25,600 | 277.76 | 7,110,656.00 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 32,000 | 40.88 | 1,308,160.00 |
| 3M CORP | 122,400 | 100.80 | 12,337,920.00 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 242,500 | 101.00 | 24,492,500.00 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 149,200 | 197.13 | 29,411,796.00 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | 34,000 | 49.89 | 1,696,260.00 |
| CATERPILLAR INC DEL | 115,500 | 213.49 | 24,658,095.00 |
| CUMMINS INC | 31,400 | 221.04 | 6,940,656.00 |
| DEERE & COMPANY | 63,600 | 381.44 | 24,259,584.00 |
| DOVER CORP | 31,300 | 142.63 | 4,464,319.00 |
| FORTIVE CORP | 74,900 | 64.53 | 4,833,297.00 |
| GRACO INC | 36,800 | 77.85 | 2,864,880.00 |
| IDEX CORP | 17,100 | 208.16 | 3,559,536.00 |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 68,500 | 228.25 | 15,635,125.00 |
| INGERSOLL-RAND INC | 88,500 | 58.97 | 5,218,845.00 |
| NORDSON CORP | 11,200 | 216.79 | 2,428,048.00 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 91,700 | 85.45 | 7,835,765.00 |
| PACCAR | 115,900 | 73.33 | 8,498,947.00 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 28,200 | 339.11 | 9,562,902.00 |
| PENTAIR PLC | 37,300 | 58.42 | 2,179,066.00 |
| SNAP-ON INC | 11,500 | 257.38 | 2,959,870.00 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 32,700 | 81.71 | 2,671,917.00 |

| | | | |
|--|---------|--------|---------------|
| TORO CO | 22,700 | 105.63 | 2,397,801.00 |
| WABTEC CORP | 38,400 | 99.00 | 3,801,600.00 |
| XYLEM INC | 39,600 | 106.80 | 4,229,280.00 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 38,000 | 56.00 | 2,128,000.00 |
| FASTENAL CO | 126,000 | 54.46 | 6,861,960.00 |
| FERGUSON PLC | 45,600 | 144.39 | 6,584,184.00 |
| GRAINGER(W.W.) INC | 10,110 | 684.51 | 6,920,396.10 |
| UNITED RENTALS INC | 15,400 | 340.67 | 5,246,318.00 |
| CINTAS CORP | 20,300 | 461.54 | 9,369,262.00 |
| COPART INC | 95,500 | 79.50 | 7,592,250.00 |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A | 49,700 | 146.99 | 7,305,403.00 |
| ROLLINS INC | 47,000 | 41.57 | 1,953,790.00 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 57,200 | 142.76 | 8,165,872.00 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 90,500 | 169.46 | 15,336,130.00 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 25,900 | 101.59 | 2,631,181.00 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC | 34,800 | 115.52 | 4,020,096.00 |
| FEDEX CORPORATION | 55,300 | 228.63 | 12,643,239.00 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 162,000 | 173.01 | 28,027,620.00 |
| DELTA AIR LINES INC | 36,000 | 34.20 | 1,231,200.00 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 34,000 | 29.63 | 1,007,420.00 |
| CSX CORP | 465,000 | 32.02 | 14,889,300.00 |
| GRAB HOLDINGS LTD-CL A | 290,000 | 3.19 | 925,100.00 |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC | 17,900 | 175.91 | 3,148,789.00 |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 33,800 | 56.61 | 1,913,418.00 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 51,000 | 208.30 | 10,623,300.00 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE | 21,100 | 312.15 | 6,586,365.00 |
| U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING | 19,170 | 54.10 | 1,037,097.00 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 332,000 | 38.19 | 12,679,080.00 |
| UNION PAC CORP | 136,400 | 200.59 | 27,360,476.00 |
| APTIV PLC | 60,900 | 93.37 | 5,686,233.00 |
| BORGWARNER INC | 50,000 | 44.51 | 2,225,500.00 |
| LEAR CORP | 13,700 | 125.12 | 1,714,144.00 |
| FORD MOTOR COMPANY | 884,000 | 11.86 | 10,484,240.00 |
| GENERAL MOTORS CO | 315,000 | 33.28 | 10,483,200.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|----------|----------------|
| LUCID GROUP INC | 98,000 | 7.28 | 713,440.00 |
| RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A | 66,000 | 13.86 | 914,760.00 |
| TESLA INC | 595,700 | 169.15 | 100,762,655.00 |
| DR HORTON INC | 73,500 | 108.99 | 8,010,765.00 |
| GARMIN LTD | 33,100 | 103.96 | 3,441,076.00 |
| LENNAR CORP-A | 57,000 | 114.36 | 6,518,520.00 |
| MOHAWK INDUSTRIES | 10,900 | 98.63 | 1,075,067.00 |
| NEWELL BRANDS INC | 85,000 | 9.99 | 849,150.00 |
| NVR INC | 690 | 5,875.45 | 4,054,060.50 |
| PULTEGROUP INC | 51,000 | 67.73 | 3,454,230.00 |
| WHIRLPOOL CORP | 11,300 | 135.94 | 1,536,122.00 |
| HASBRO INC | 28,100 | 59.65 | 1,676,165.00 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 25,600 | 381.44 | 9,764,864.00 |
| NIKE INC-B | 279,600 | 125.10 | 34,977,960.00 |
| V F CORP | 72,000 | 22.01 | 1,584,720.00 |
| AIRBNB INC-CLASS A | 84,000 | 127.07 | 10,673,880.00 |
| ARAMARK | 50,000 | 35.84 | 1,792,000.00 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 8,640 | 2,634.91 | 22,765,622.40 |
| CAESARS ENTERTAINMENT INC | 48,000 | 45.42 | 2,180,160.00 |
| CARNIVAL CORP | 228,000 | 10.65 | 2,428,200.00 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 6,100 | 2,032.66 | 12,399,226.00 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 26,600 | 150.33 | 3,998,778.00 |
| DOMINOS PIZZA INC | 8,000 | 308.64 | 2,469,120.00 |
| DOORDASH INC-A | 53,100 | 67.30 | 3,573,630.00 |
| EXPEDIA GROUP INC | 33,800 | 93.26 | 3,152,188.00 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 60,700 | 145.72 | 8,845,204.00 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 77,900 | 62.37 | 4,858,623.00 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA | 59,500 | 178.99 | 10,649,905.00 |
| MCDONALD'S CORP | 162,500 | 296.66 | 48,207,250.00 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 70,000 | 43.39 | 3,037,300.00 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 52,400 | 76.96 | 4,032,704.00 |
| STARBUCKS CORP | 254,700 | 106.71 | 27,179,037.00 |
| VAIL RESORTS INC | 8,900 | 242.37 | 2,157,093.00 |
| WYNN RESORTS LTD | 24,700 | 111.70 | 2,758,990.00 |
| YUM BRANDS INC | 62,000 | 137.61 | 8,531,820.00 |

| | | | |
|--------------------------------|-----------|----------|----------------|
| GENUINE PARTS CO | 31,900 | 173.22 | 5,525,718.00 |
| LKQ CORP | 56,300 | 57.20 | 3,220,360.00 |
| POOL CORP | 8,800 | 350.98 | 3,088,624.00 |
| AMAZON.COM INC | 2,037,600 | 106.62 | 217,248,912.00 |
| EBAY INC | 121,000 | 45.81 | 5,543,010.00 |
| ETSY INC | 28,000 | 92.71 | 2,595,880.00 |
| MERCADOLIBRE INC | 10,120 | 1,248.05 | 12,630,266.00 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 13,100 | 125.52 | 1,644,312.00 |
| AUTOZONE | 4,250 | 2,726.51 | 11,587,667.50 |
| BATH & BODY WORKS INC | 50,400 | 32.24 | 1,624,896.00 |
| BEST BUY COMPANY INC | 44,700 | 72.65 | 3,247,455.00 |
| BURLINGTON STORES INC | 14,300 | 175.40 | 2,508,220.00 |
| CARMAX INC | 33,300 | 72.53 | 2,415,249.00 |
| CHEWY INC - CLASS A | 20,000 | 33.01 | 660,200.00 |
| HOME DEPOT | 226,200 | 290.58 | 65,729,196.00 |
| LOWES COS INC | 134,200 | 207.12 | 27,795,504.00 |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC, | 13,760 | 953.46 | 13,119,609.60 |
| ROSS STORES INC | 76,200 | 104.08 | 7,930,896.00 |
| TJX COS INC | 256,600 | 78.59 | 20,166,194.00 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 24,500 | 241.71 | 5,921,895.00 |
| ULTA BEAUTY INC | 11,500 | 509.09 | 5,854,535.00 |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 98,200 | 500.79 | 49,177,578.00 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 50,000 | 220.61 | 11,030,500.00 |
| DOLLAR TREE INC | 48,900 | 155.17 | 7,587,813.00 |
| KROGER CO | 152,000 | 49.16 | 7,472,320.00 |
| SYSCO CORP | 111,300 | 75.98 | 8,456,574.00 |
| TARGET CORP | 102,700 | 157.42 | 16,167,034.00 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 166,000 | 31.44 | 5,219,040.00 |
| WALMART INC | 331,300 | 152.98 | 50,682,274.00 |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B | 67,500 | 63.80 | 4,306,500.00 |
| COCA COLA CO | 911,700 | 63.39 | 57,792,663.00 |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS | 46,300 | 65.90 | 3,051,170.00 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 36,900 | 225.46 | 8,319,474.00 |
| KEURIG DR PEPPER INC | 175,000 | 32.71 | 5,724,250.00 |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B | 41,900 | 64.52 | 2,703,388.00 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|---------------|
| MONSTER BEVERAGE CORP | 173,800 | 58.69 | 10,200,322.00 |
| PEPSICO INC | 305,700 | 194.14 | 59,348,598.00 |
| ARCHER DANIELS MIDLAND | 120,800 | 75.02 | 9,062,416.00 |
| BUNGE LIMITED | 33,900 | 89.30 | 3,027,270.00 |
| CAMPBELL SOUP CO | 48,000 | 54.60 | 2,620,800.00 |
| CONAGRA BRANDS INC | 104,000 | 37.81 | 3,932,240.00 |
| DARLING INGREDIENTS INC | 33,700 | 58.34 | 1,966,058.00 |
| GENERAL MILLS | 130,800 | 89.59 | 11,718,372.00 |
| HERSHEY CO/THE | 33,000 | 274.08 | 9,044,640.00 |
| HORMEL FOODS CORP | 67,000 | 40.16 | 2,690,720.00 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 24,200 | 157.26 | 3,805,692.00 |
| KELLOGG CO | 55,200 | 70.46 | 3,889,392.00 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 165,000 | 40.88 | 6,745,200.00 |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC | 32,500 | 112.18 | 3,645,850.00 |
| MCCORMICK & CO INC. | 55,000 | 88.45 | 4,864,750.00 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 301,800 | 77.89 | 23,507,202.00 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 62,400 | 48.82 | 3,046,368.00 |
| ALTRIA GROUP INC | 400,000 | 46.44 | 18,576,000.00 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 344,000 | 95.65 | 32,903,600.00 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 54,700 | 95.94 | 5,247,918.00 |
| CLOROX CO | 26,700 | 168.13 | 4,489,071.00 |
| COLGATE PALMOLIVE CO. | 175,800 | 80.64 | 14,176,512.00 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 74,200 | 143.92 | 10,678,864.00 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 525,900 | 153.71 | 80,836,089.00 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 51,200 | 201.26 | 10,304,512.00 |
| ABBOTT LABORATORIES | 386,900 | 110.25 | 42,655,725.00 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 16,700 | 302.74 | 5,055,758.00 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC. | 110,200 | 43.08 | 4,747,416.00 |
| BECTON, DICKINSON | 63,200 | 249.65 | 15,777,880.00 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 317,000 | 53.09 | 16,829,530.00 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 49,000 | 40.92 | 2,005,080.00 |
| DEXCOM INC | 85,400 | 119.65 | 10,218,110.00 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 138,300 | 88.70 | 12,267,210.00 |
| GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC | 81,200 | 76.37 | 6,201,244.00 |
| HOLOGIC INC | 54,500 | 83.67 | 4,560,015.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|----------------|
| IDEXX LABORATORIES INC | 18,200 | 479.37 | 8,724,534.00 |
| INSULET CORP | 15,700 | 319.72 | 5,019,604.00 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 78,100 | 301.55 | 23,551,055.00 |
| MASIMO CORP | 10,600 | 184.25 | 1,953,050.00 |
| MEDTRONIC PLC | 295,200 | 89.60 | 26,449,920.00 |
| NOVOCURE LTD | 21,200 | 70.02 | 1,484,424.00 |
| RESMED INC | 32,600 | 231.13 | 7,534,838.00 |
| STERIS PLC | 22,200 | 187.12 | 4,154,064.00 |
| STRYKER CORP | 75,300 | 283.65 | 21,358,845.00 |
| TELEFLEX INC | 10,300 | 251.99 | 2,595,497.00 |
| THE COOPER COMPANIES, INC. | 11,100 | 385.29 | 4,276,719.00 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 46,900 | 136.05 | 6,380,745.00 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 34,800 | 168.25 | 5,855,100.00 |
| CARDINAL HEALTH INC | 58,300 | 84.35 | 4,917,605.00 |
| CENTENE CORP | 125,600 | 67.62 | 8,493,072.00 |
| CVS HEALTH CORP | 292,800 | 69.97 | 20,487,216.00 |
| DAVITA INC | 12,500 | 100.72 | 1,259,000.00 |
| ELEVANCE HEALTH INC | 53,100 | 460.48 | 24,451,488.00 |
| HCA HEALTHCARE INC | 47,400 | 274.05 | 12,989,970.00 |
| HENRY SCHEIN INC | 30,100 | 74.83 | 2,252,383.00 |
| HUMANA INC | 28,000 | 530.20 | 14,845,600.00 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 20,000 | 222.78 | 4,455,600.00 |
| MCKESSON CORP | 31,200 | 388.72 | 12,128,064.00 |
| MOLINA HEALTHCARE INC | 13,200 | 292.80 | 3,864,960.00 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 25,200 | 133.65 | 3,367,980.00 |
| THE CIGNA GROUP | 67,600 | 262.79 | 17,764,604.00 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 207,370 | 490.38 | 101,690,100.60 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 14,300 | 143.14 | 2,046,902.00 |
| ABBVIE INC | 392,500 | 146.83 | 57,630,775.00 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 27,800 | 207.83 | 5,777,674.00 |
| AMGEN INC | 118,400 | 234.43 | 27,756,512.00 |
| BIOGEN INC | 32,300 | 314.00 | 10,142,200.00 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 40,200 | 95.61 | 3,843,522.00 |
| EXACT SCIENCES CORP | 39,800 | 71.00 | 2,825,800.00 |
| GILEAD SCIENCES INC | 278,300 | 78.80 | 21,930,040.00 |

| | | | |
|----------------------------|-----------|----------|---------------|
| HORIZON THERAPEUTICS PLC | 48,600 | 110.87 | 5,388,282.00 |
| INCYTE CORP | 41,100 | 64.77 | 2,662,047.00 |
| MODERNA INC | 72,200 | 133.77 | 9,658,194.00 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 20,800 | 97.24 | 2,022,592.00 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 23,870 | 754.88 | 18,018,985.60 |
| SEAGEN INC | 31,100 | 200.00 | 6,220,000.00 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 9,900 | 209.60 | 2,075,040.00 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS | 56,800 | 344.83 | 19,586,344.00 |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 471,800 | 68.00 | 32,082,400.00 |
| CATALENT INC | 36,500 | 35.04 | 1,278,960.00 |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC | 95,000 | 9.31 | 884,450.00 |
| ELI LILLY & CO. | 179,200 | 428.38 | 76,765,696.00 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 13,400 | 135.43 | 1,814,762.00 |
| JOHNSON & JOHNSON | 580,200 | 161.05 | 93,441,210.00 |
| MERCK & CO INC | 562,700 | 117.43 | 66,077,861.00 |
| PFIZER INC | 1,245,500 | 38.48 | 47,926,840.00 |
| ROYALTY PHARMA PLC-CL A | 78,000 | 33.99 | 2,651,220.00 |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR | 253,000 | 9.10 | 2,302,300.00 |
| VIATRIS INC | 267,000 | 9.74 | 2,600,580.00 |
| ZOETIS INC | 104,000 | 184.37 | 19,174,480.00 |
| BANK OF AMERICA CORP | 1,602,000 | 27.66 | 44,311,320.00 |
| CITIGROUP | 432,000 | 46.52 | 20,096,640.00 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 109,000 | 26.05 | 2,839,450.00 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 151,000 | 24.67 | 3,725,170.00 |
| FIRST CITIZENS BCSHS -CL A | 2,510 | 1,093.86 | 2,745,588.60 |
| FIRST HORIZON CORP | 113,000 | 10.56 | 1,193,280.00 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 317,000 | 9.80 | 3,106,600.00 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 650,900 | 136.41 | 88,789,269.00 |
| KEYCORP | 200,000 | 9.72 | 1,944,000.00 |
| M & T BANK CORP | 37,600 | 116.73 | 4,389,048.00 |
| PNC FINANCIAL | 89,300 | 115.70 | 10,332,010.00 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 209,000 | 16.30 | 3,406,700.00 |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 297,000 | 28.60 | 8,494,200.00 |
| US BANCORP | 316,000 | 29.91 | 9,451,560.00 |
| WEBSTER FINANCIAL CORP | 37,000 | 33.32 | 1,232,840.00 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|----------|---------------|
| WELLS FARGO CO | 846,000 | 38.54 | 32,604,840.00 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 89,300 | 62.26 | 5,559,818.00 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 288,900 | 324.87 | 93,854,943.00 |
| BLOCK INC | 119,400 | 59.32 | 7,082,808.00 |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 79,000 | 22.84 | 1,804,360.00 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 133,000 | 55.65 | 7,401,450.00 |
| FISERV INC | 134,600 | 119.39 | 16,069,894.00 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 15,700 | 230.93 | 3,625,601.00 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 59,000 | 106.72 | 6,296,480.00 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 16,000 | 152.22 | 2,435,520.00 |
| MASTERCARD INC | 190,500 | 382.94 | 72,950,070.00 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 241,500 | 65.90 | 15,916,057.50 |
| TOAST INC-CLASS A | 52,000 | 19.46 | 1,011,920.00 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 361,300 | 233.26 | 84,276,838.00 |
| AFLAC INC | 132,500 | 67.42 | 8,933,150.00 |
| ALLSTATE CORP | 57,900 | 118.42 | 6,856,518.00 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 15,500 | 115.91 | 1,796,605.00 |
| AMERICAN INTL GROUP | 167,000 | 53.10 | 8,867,700.00 |
| AON PLC | 45,800 | 334.92 | 15,339,336.00 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 82,600 | 76.61 | 6,327,986.00 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 47,300 | 216.08 | 10,220,584.00 |
| ASSURANT INC | 11,300 | 130.57 | 1,475,441.00 |
| BROWN & BROWN INC | 52,800 | 65.57 | 3,462,096.00 |
| CHUBB LTD | 91,700 | 201.48 | 18,475,716.00 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 32,200 | 105.52 | 3,397,744.00 |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 5,400 | 230.34 | 1,243,836.00 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 8,500 | 382.87 | 3,254,395.00 |
| FNF GROUP | 59,000 | 34.24 | 2,020,160.00 |
| GLOBE LIFE INC | 19,700 | 108.67 | 2,140,799.00 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES | 70,800 | 70.45 | 4,987,860.00 |
| LOEWS CORP | 45,300 | 58.62 | 2,655,486.00 |
| MARKEL CORP | 2,980 | 1,368.72 | 4,078,785.60 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 109,700 | 179.38 | 19,677,986.00 |
| METLIFE INC | 149,600 | 52.79 | 7,897,384.00 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 53,600 | 70.51 | 3,779,336.00 |

| | | | |
|--|---------|--------|---------------|
| PROGRESSIVE CO | 129,300 | 135.70 | 17,546,010.00 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 80,400 | 81.50 | 6,552,600.00 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 51,700 | 183.75 | 9,499,875.00 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 24,300 | 228.87 | 5,561,541.00 |
| WR BERKLEY CORP | 48,600 | 58.95 | 2,864,970.00 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 139,800 | 263.48 | 36,834,504.00 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 33,600 | 78.88 | 2,650,368.00 |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A | 57,000 | 47.15 | 2,687,550.00 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 113,200 | 61.63 | 6,976,516.00 |
| EPAM SYSTEMS INC | 12,900 | 231.34 | 2,984,286.00 |
| GARTNER INC | 17,500 | 304.43 | 5,327,525.00 |
| GODADDY INC - CLASS A | 34,500 | 69.24 | 2,388,780.00 |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 200,600 | 121.17 | 24,306,702.00 |
| MONGODB INC | 15,100 | 250.28 | 3,779,228.00 |
| OKTA INC | 33,500 | 76.03 | 2,547,005.00 |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A | 50,300 | 163.87 | 8,242,661.00 |
| TWILIO INC - A | 37,200 | 56.00 | 2,083,200.00 |
| VERISIGN INC | 20,700 | 217.97 | 4,511,979.00 |
| WIX.COM LTD | 12,200 | 74.14 | 904,508.00 |
| ADOBE INC | 103,200 | 342.65 | 35,361,480.00 |
| ANSYS INC | 19,600 | 293.65 | 5,755,540.00 |
| ASPEN TECHNOLOGY INC | 6,100 | 169.08 | 1,031,388.00 |
| ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A | 32,600 | 133.15 | 4,340,690.00 |
| AUTODESK INC. | 47,900 | 192.73 | 9,231,767.00 |
| BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B | 45,000 | 46.31 | 2,083,950.00 |
| BILL HOLDINGS INC | 19,600 | 96.31 | 1,887,676.00 |
| BLACK KNIGHT INC | 33,000 | 53.93 | 1,779,690.00 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 60,800 | 204.03 | 12,405,024.00 |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC | 29,900 | 57.81 | 1,728,519.00 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | 21,800 | 121.51 | 2,648,918.00 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | 44,900 | 129.94 | 5,834,306.00 |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | 9,500 | 136.15 | 1,293,425.00 |
| DATADOG INC - CLASS A | 53,700 | 79.59 | 4,273,983.00 |
| DOCUSIGN INC | 45,600 | 49.43 | 2,254,008.00 |

| | | | |
|-----------------------------|-----------|--------|----------------|
| DROPBOX INC-CLASS A | 57,000 | 21.20 | 1,208,400.00 |
| DYNATRACE INC | 50,000 | 44.29 | 2,214,500.00 |
| FAIR ISAAC CORP | 5,540 | 737.24 | 4,084,309.60 |
| FORTINET INC | 146,000 | 66.40 | 9,694,400.00 |
| GEN DIGITAL INC | 128,000 | 17.00 | 2,176,000.00 |
| HUBSPOT INC | 10,200 | 447.73 | 4,566,846.00 |
| INTUIT INC | 59,200 | 427.68 | 25,318,656.00 |
| MICROSOFT CORP | 1,571,600 | 307.00 | 482,481,200.00 |
| ORACLE CORPORATION | 359,000 | 96.14 | 34,514,260.00 |
| PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A | 381,000 | 9.55 | 3,638,550.00 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 67,000 | 195.84 | 13,121,280.00 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 11,600 | 268.74 | 3,117,384.00 |
| PAYLOCITY HOLDING CORP | 8,700 | 169.58 | 1,475,346.00 |
| PTC INC | 25,500 | 129.12 | 3,292,560.00 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 23,300 | 457.55 | 10,660,915.00 |
| SALESFORCE INC | 221,940 | 201.18 | 44,649,889.20 |
| SERVICENOW INC | 44,700 | 441.39 | 19,730,133.00 |
| SPLUNK INC | 37,100 | 84.88 | 3,149,048.00 |
| SYNOPSYS INC | 33,900 | 366.95 | 12,439,605.00 |
| TYLER TECHNOLOGIES INC | 9,200 | 387.84 | 3,568,128.00 |
| UNITY SOFTWARE INC | 52,000 | 28.28 | 1,470,560.00 |
| VMWARE INC - CLASS A | 46,700 | 121.82 | 5,688,994.00 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 44,700 | 178.43 | 7,975,821.00 |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 50,000 | 63.56 | 3,178,000.00 |
| ZSCALER INC | 19,700 | 110.04 | 2,167,886.50 |
| ARISTA NETWORKS INC | 54,800 | 138.52 | 7,590,896.00 |
| CISCO SYSTEMS | 911,900 | 46.47 | 42,375,993.00 |
| F5 INC | 13,900 | 134.76 | 1,873,164.00 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 72,000 | 29.10 | 2,095,200.00 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 37,400 | 286.57 | 10,717,718.00 |
| APPLE INC | 3,530,400 | 171.77 | 606,416,808.00 |
| DELL TECHNOLOGIES-C | 59,000 | 45.98 | 2,712,820.00 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 285,000 | 14.16 | 4,035,600.00 |
| HP INC | 222,000 | 30.29 | 6,724,380.00 |
| NETAPP INC | 49,100 | 63.75 | 3,130,125.00 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|----------------|
| SEAGATE TECHNOLOGY | 44,900 | 57.31 | 2,573,219.00 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 73,000 | 33.60 | 2,452,800.00 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 132,000 | 75.19 | 9,925,080.00 |
| ARROW ELECTRS INC | 13,700 | 117.76 | 1,613,312.00 |
| CDW CORPORATION | 30,200 | 167.76 | 5,066,352.00 |
| COGNEX CORP | 38,000 | 49.54 | 1,882,520.00 |
| CORNING INC | 181,000 | 31.16 | 5,639,960.00 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 40,200 | 143.00 | 5,748,600.00 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 71,100 | 121.15 | 8,613,765.00 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 10,200 | 410.58 | 4,187,916.00 |
| TRIMBLE INC | 53,400 | 47.29 | 2,525,286.00 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 11,500 | 270.16 | 3,106,840.00 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 357,848 | 95.06 | 34,017,030.88 |
| ANALOG DEVICES INC | 113,500 | 179.62 | 20,386,870.00 |
| APPLIED MATERIALS | 190,900 | 113.84 | 21,732,056.00 |
| BROADCOM INC | 92,540 | 618.51 | 57,236,915.40 |
| ENPHASE ENERGY INC | 30,600 | 157.83 | 4,829,598.00 |
| ENTEGRIS INC | 33,400 | 78.24 | 2,613,216.00 |
| FIRST SOLAR INC | 21,400 | 178.00 | 3,809,200.00 |
| INTEL CORP | 915,500 | 30.10 | 27,556,550.00 |
| KLA CORP | 31,400 | 375.75 | 11,798,550.00 |
| LAM RESEARCH | 30,400 | 515.77 | 15,679,408.00 |
| MARVELL TECHNOLOGY INC | 191,000 | 39.99 | 7,638,090.00 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY | 122,100 | 72.71 | 8,877,891.00 |
| MICRON TECHNOLOGY | 239,600 | 60.93 | 14,598,828.00 |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | 9,800 | 401.38 | 3,933,524.00 |
| NVIDIA CORP | 545,940 | 285.71 | 155,980,517.40 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 57,200 | 165.09 | 9,443,148.00 |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 94,800 | 78.81 | 7,471,188.00 |
| QORVO INC | 22,500 | 93.14 | 2,095,650.00 |
| QUALCOMM INC | 248,800 | 105.77 | 26,315,576.00 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 35,700 | 99.82 | 3,563,574.00 |
| SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC | 12,300 | 286.26 | 3,520,998.00 |
| TERADYNE INC | 34,300 | 90.29 | 3,096,947.00 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 201,400 | 163.00 | 32,828,200.00 |

| | | | |
|-----------------------------|-----------|--------|---------------|
| WOLFSPEED INC | 26,100 | 40.86 | 1,066,446.00 |
| AT & T INC | 1,582,000 | 17.02 | 26,925,640.00 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 31,000 | 18.70 | 579,700.00 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C | 64,000 | 19.54 | 1,250,560.00 |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 932,000 | 37.57 | 35,015,240.00 |
| T-MOBILE US INC | 137,500 | 142.03 | 19,529,125.00 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 55,100 | 54.40 | 2,997,440.00 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 115,000 | 91.10 | 10,476,500.00 |
| CONSTELLATION ENERGY | 73,700 | 78.95 | 5,818,615.00 |
| DUKE ENERGY CORP | 171,800 | 98.05 | 16,844,990.00 |
| EDISON INTERNATIONAL | 85,300 | 73.63 | 6,280,639.00 |
| ENTERGY CORP | 45,100 | 106.97 | 4,824,347.00 |
| EVERGY INC | 52,000 | 62.16 | 3,232,320.00 |
| EVERSOURCE ENERGY | 77,800 | 76.45 | 5,947,810.00 |
| EXELON CORPORATION | 221,000 | 42.62 | 9,419,020.00 |
| FIRSTENERGY CORP | 120,000 | 38.91 | 4,669,200.00 |
| NEXTERA ENERGY INC | 441,000 | 75.58 | 33,330,780.00 |
| NRG ENERGY INC | 49,000 | 31.30 | 1,533,700.00 |
| PG&E CORP | 324,000 | 17.28 | 5,598,720.00 |
| PPL CORPORATION | 163,000 | 28.54 | 4,652,020.00 |
| SOUTHERN CO. | 240,900 | 74.69 | 17,992,821.00 |
| XCEL ENERGY INC | 122,800 | 69.11 | 8,486,708.00 |
| ATMOS ENERGY CORP | 31,800 | 118.50 | 3,768,300.00 |
| UGI CORP | 45,000 | 29.59 | 1,331,550.00 |
| AMEREN CORPORATION | 57,200 | 88.84 | 5,081,648.00 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 143,000 | 30.21 | 4,320,030.00 |
| CMS ENERGY CORP | 63,400 | 61.19 | 3,879,446.00 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 79,100 | 98.77 | 7,812,707.00 |
| DOMINION ENERGY INC | 186,500 | 56.50 | 10,537,250.00 |
| DTE ENERGY COMPANY | 42,900 | 113.32 | 4,861,428.00 |
| NISOURCE INC | 93,000 | 28.45 | 2,645,850.00 |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE | 109,000 | 63.71 | 6,944,390.00 |
| SEMPRA ENERGY | 70,400 | 155.71 | 10,961,984.00 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 68,900 | 94.42 | 6,505,538.00 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 43,400 | 147.88 | 6,417,992.00 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 57,000 | 42.41 | 2,417,370.00 |
| ALLY FINANCIAL INC | 68,000 | 25.28 | 1,719,040.00 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 141,000 | 153.38 | 21,626,580.00 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 84,300 | 89.01 | 7,503,543.00 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 60,200 | 96.69 | 5,820,738.00 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 97,800 | 27.46 | 2,685,588.00 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 23,900 | 293.49 | 7,014,411.00 |
| ARES MANAGEMENT CORP - A | 35,400 | 80.50 | 2,849,700.00 |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP | 171,000 | 41.54 | 7,103,340.00 |
| BLACKROCK INC | 33,460 | 635.57 | 21,266,172.20 |
| BLACKSTONE INC | 156,800 | 81.63 | 12,799,584.00 |
| CARLYLE GROUP INC/THE | 45,000 | 26.03 | 1,171,350.00 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 24,200 | 136.06 | 3,292,652.00 |
| CME GROUP INC | 80,300 | 184.63 | 14,825,789.00 |
| COINBASE GLOBAL INC -CLASS A | 26,200 | 60.21 | 1,577,502.00 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 8,400 | 402.01 | 3,376,884.00 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 65,000 | 25.12 | 1,632,800.00 |
| FUTU HOLDINGS LTD-ADR | 13,000 | 42.64 | 554,320.00 |
| GOLDMAN SACHS GROUP | 75,200 | 324.77 | 24,422,704.00 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 123,700 | 106.21 | 13,138,177.00 |
| INVESCO LTD | 77,000 | 16.19 | 1,246,630.00 |
| KKR & CO INC-A | 124,700 | 49.01 | 6,111,547.00 |
| LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | 17,400 | 192.50 | 3,349,500.00 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 8,500 | 299.77 | 2,548,045.00 |
| MOODYS CORP | 36,900 | 305.93 | 11,288,817.00 |
| MORGAN STANLEY | 281,300 | 84.37 | 23,733,281.00 |
| MSCI INC | 17,680 | 472.87 | 8,360,341.60 |
| NASDAQ INC | 74,700 | 54.56 | 4,075,632.00 |
| NORTHERN TRUST CORP | 45,000 | 72.14 | 3,246,300.00 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 42,700 | 86.35 | 3,687,145.00 |
| S&P GLOBAL INC | 73,895 | 355.27 | 26,252,676.65 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 324,000 | 47.94 | 15,532,560.00 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 26,000 | 58.33 | 1,516,580.00 |
| STATE STREET CORP | 81,700 | 68.98 | 5,635,666.00 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 49,900 | 105.16 | 5,247,484.00 |

| | | | |
|---------------------------------------|---------|----------|---------------|
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | 24,300 | 72.11 | 1,752,273.00 |
| AES CORP | 152,000 | 22.27 | 3,385,040.00 |
| VISTRA CORP | 84,000 | 24.60 | 2,066,400.00 |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 30,700 | 175.23 | 5,379,561.00 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 65,500 | 127.35 | 8,341,425.00 |
| AVANTOR INC | 150,000 | 20.37 | 3,055,500.00 |
| BIO TECHNE CORP | 34,500 | 81.08 | 2,797,260.00 |
| BIO-RAD LABORATORIES-A | 5,100 | 366.86 | 1,870,986.00 |
| CHARLES RIVER LABORATORIES | 11,300 | 187.48 | 2,118,524.00 |
| DANAHER CORP | 153,500 | 235.16 | 36,097,060.00 |
| ILLUMINA INC | 35,000 | 194.26 | 6,799,100.00 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 41,000 | 186.01 | 7,626,410.00 |
| METTLER-TOLEDO INTL | 5,010 | 1,376.20 | 6,894,762.00 |
| PERKINELMER INC | 27,400 | 124.82 | 3,420,068.00 |
| REPLIGEN CORP | 11,100 | 157.92 | 1,752,912.00 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 87,040 | 534.66 | 46,536,806.40 |
| WATERS CORP | 13,000 | 276.76 | 3,597,880.00 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES | 16,200 | 361.73 | 5,860,026.00 |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 92,500 | 213.66 | 19,763,550.00 |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS | 28,900 | 92.38 | 2,669,782.00 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 25,900 | 152.55 | 3,951,045.00 |
| CLARIVATE PLC | 65,000 | 7.84 | 509,600.00 |
| COSTAR GROUP INC | 90,700 | 74.00 | 6,711,800.00 |
| EQUIFAX INC | 27,600 | 199.29 | 5,500,404.00 |
| JACOBS SOLUTIONS INC | 27,500 | 118.76 | 3,265,900.00 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 29,800 | 80.29 | 2,392,642.00 |
| PAYCHEX INC | 71,200 | 107.25 | 7,636,200.00 |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 24,700 | 66.87 | 1,651,689.00 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 49,300 | 55.35 | 2,728,755.00 |
| TRUNSONION | 43,100 | 64.93 | 2,798,483.00 |
| VERISK ANALYTICS INC | 34,900 | 211.40 | 7,377,860.00 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 24,400 | 339.00 | 8,271,600.00 |
| COMCAST CORP-CL A | 957,100 | 39.62 | 37,920,302.00 |
| DISH NETWORK CORP-A | 51,000 | 6.46 | 329,460.00 |

| | | | | |
|-----------------------------------|-----------|--------|---------------------|--|
| FOX CORP-CLASS A | 68,000 | 31.68 | 2,154,240.00 | |
| FOX CORP-CLASS B | 30,000 | 29.12 | 873,600.00 | |
| INTERPUBLIC GROUP | 85,000 | 35.84 | 3,046,400.00 | |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C | 27,100 | 77.31 | 2,095,101.00 | |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | 34,000 | 27.76 | 943,840.00 | |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP | 17,000 | 27.83 | 473,110.00 | |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I | 86,000 | 16.93 | 1,455,980.00 | |
| OMNICOM GROUP | 45,600 | 91.67 | 4,180,152.00 | |
| PARAMOUNT GLOBAL | 139,000 | 16.53 | 2,297,670.00 | |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 171,000 | 3.42 | 584,820.00 | |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 98,000 | 64.12 | 6,283,760.00 | |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 174,700 | 75.51 | 13,191,597.00 | |
| DISNEY (WALT) CO | 404,600 | 102.18 | 41,342,028.00 | |
| ELECTRONIC ARTS | 62,000 | 125.41 | 7,775,420.00 | |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C | 43,700 | 72.00 | 3,146,400.00 | |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN | 38,600 | 77.63 | 2,996,518.00 | |
| NETFLIX INC | 98,800 | 332.14 | 32,815,432.00 | |
| ROBLOX CORP -CLASS A | 79,000 | 36.19 | 2,859,010.00 | |
| ROKU INC | 27,700 | 55.42 | 1,535,134.00 | |
| SEA LTD-ADR | 80,900 | 84.00 | 6,795,600.00 | |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | 36,500 | 124.60 | 4,547,900.00 | |
| WARNER BROS DISCOVERY INC | 513,000 | 13.41 | 6,879,330.00 | |
| ALPHABET INC-CL A | 1,325,500 | 107.35 | 142,292,425.00 | |
| ALPHABET INC-CL C | 1,215,600 | 107.94 | 131,211,864.00 | |
| MATCH GROUP INC | 63,000 | 31.91 | 2,010,330.00 | |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 499,000 | 233.37 | 116,451,630.00 | |
| PINTEREST INC- CLASS A | 129,000 | 21.47 | 2,769,630.00 | |
| SNAP INC-A | 248,000 | 8.27 | 2,050,960.00 | |
| ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC | 54,000 | 20.44 | 1,103,760.00 | |
| CBRE GROUP INC | 70,300 | 73.38 | 5,158,614.00 | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 260,000 | 4.38 | 1,138,800.00 | |
| ZILLOW GROUP INC - C | 33,200 | 47.49 | 1,576,668.00 | |
| 小計 銘柄数：600 | | | 7,884,212,614.13 | |
| | | | (1,065,551,334,799) | |
| 組入時価比率：69.1% | | | 71.8% | |

| | | | | |
|----------------------------------|--------------------------------|---------|---------------|---------------|
| カナダドル | ARC RESOURCES LTD | 148,000 | 17.17 | 2,541,160.00 |
| | CAMECO CORP | 94,000 | 38.17 | 3,587,980.00 |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 247,000 | 76.33 | 18,853,510.00 |
| | CENOVUS ENERGY INC | 321,000 | 22.00 | 7,062,000.00 |
| | ENBRIDGE INC | 452,000 | 53.35 | 24,114,200.00 |
| | IMPERIAL OIL | 50,000 | 63.29 | 3,164,500.00 |
| | KEYERA CORP | 48,000 | 32.10 | 1,540,800.00 |
| | PARKLAND CORP | 36,000 | 33.52 | 1,206,720.00 |
| | PEMBINA PIPELINE CORP | 120,000 | 43.83 | 5,259,600.00 |
| | SUNCOR ENERGY INC | 303,000 | 39.68 | 12,023,040.00 |
| | TC ENERGY CORP | 225,000 | 56.24 | 12,654,000.00 |
| | TOURMALINE OIL CORP | 72,000 | 59.24 | 4,265,280.00 |
| | NUTRIEN LTD | 116,600 | 85.37 | 9,954,142.00 |
| | CCL INDUSTRIES INC - CL B | 32,000 | 64.74 | 2,071,680.00 |
| | AGNICO EAGLE MINES LTD | 111,000 | 80.29 | 8,912,190.00 |
| | BARRICK GOLD | 396,000 | 26.50 | 10,494,000.00 |
| | FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 128,000 | 35.41 | 4,532,480.00 |
| | FRANCO-NEVADA CORP | 41,900 | 214.87 | 9,003,053.00 |
| | IVANHOE MINES LTD-CL A | 141,000 | 12.19 | 1,718,790.00 |
| | KINROSS GOLD CORP | 300,000 | 7.13 | 2,139,000.00 |
| | LUNDIN MINING CORP | 137,000 | 11.07 | 1,516,590.00 |
| | PAN AMERICAN SILVER CORP | 81,000 | 23.97 | 1,941,570.00 |
| | TECK RESOURCES LTD-CLS B | 99,000 | 61.17 | 6,055,830.00 |
| | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 100,000 | 69.48 | 6,948,000.00 |
| | WEST FRASER TIMBER | 14,200 | 101.45 | 1,440,590.00 |
| | CAE INC | 67,000 | 29.62 | 1,984,540.00 |
| | WSP GLOBAL INC | 27,700 | 179.39 | 4,969,103.00 |
| | TOROMONT INDUSTRIES LTD | 19,400 | 103.76 | 2,012,944.00 |
| | GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT | 38,000 | 50.06 | 1,902,280.00 |
| | RITCHIE BROS. AUCTIONEERS | 39,900 | 77.34 | 3,085,866.00 |
| | AIR CANADA | 43,000 | 21.12 | 908,160.00 |
| | CANADIAN NATL RAILWAY CO | 127,200 | 161.11 | 20,493,192.00 |
| CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY LTD | 207,600 | 108.40 | 22,503,840.00 | |
| TFI INTERNATIONAL INC | 17,000 | 142.02 | 2,414,340.00 | |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 58,700 | 71.10 | 4,173,570.00 | |

| | | | |
|--|---------|----------|---------------|
| BRP INC/CA- SUB VOTING | 7,400 | 100.37 | 742,738.00 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 37,000 | 40.47 | 1,497,390.00 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 66,000 | 98.24 | 6,483,840.00 |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A | 11,500 | 175.74 | 2,021,010.00 |
| DOLLARAMA INC | 59,000 | 83.91 | 4,950,690.00 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 178,000 | 67.99 | 12,102,220.00 |
| EMPIRE CO LTD A | 39,000 | 35.38 | 1,379,820.00 |
| LOBLAW COMPANIES | 35,600 | 124.18 | 4,420,808.00 |
| METRO INC | 53,000 | 77.75 | 4,120,750.00 |
| WESTON(GEORGE)LTD | 15,700 | 174.95 | 2,746,715.00 |
| SAPUTO INC | 57,000 | 35.18 | 2,005,260.00 |
| BANK OF MONTREAL | 149,900 | 117.63 | 17,632,737.00 |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX | 264,000 | 65.88 | 17,392,320.00 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 201,000 | 55.17 | 11,089,170.00 |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 73,800 | 101.18 | 7,467,084.00 |
| ROYAL BANK OF CANADA | 306,900 | 129.43 | 39,722,067.00 |
| TORONTO DOMINION BANK | 402,400 | 81.35 | 32,735,240.00 |
| ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP | 83,000 | 17.90 | 1,485,700.00 |
| NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG | 14,000 | 56.73 | 794,220.00 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 4,940 | 926.23 | 4,575,576.20 |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 64,000 | 38.86 | 2,487,040.00 |
| IA FINANCIAL CORP INC | 24,100 | 89.22 | 2,150,202.00 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 38,400 | 200.75 | 7,708,800.00 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 416,000 | 26.65 | 11,086,400.00 |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 124,000 | 36.10 | 4,476,400.00 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 128,000 | 65.19 | 8,344,320.00 |
| CGI INC | 46,300 | 136.73 | 6,330,599.00 |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 266,000 | 85.50 | 22,743,000.00 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 4,480 | 2,639.70 | 11,825,856.00 |
| DESCARTES SYSTEMS GRP(THE) | 17,800 | 104.37 | 1,857,786.00 |
| OPEN TEXT CORP | 62,000 | 55.75 | 3,456,500.00 |
| BCE INC | 14,400 | 64.06 | 922,464.00 |
| TELUS CORP | 98,600 | 27.49 | 2,710,514.00 |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B | 79,000 | 65.94 | 5,209,260.00 |

| | | | | | |
|-----|-----------------------------|---------|--------|------------------|--|
| | EMERA INC | 61,000 | 58.73 | 3,582,530.00 | |
| | FORTIS INC | 106,000 | 61.26 | 6,493,560.00 | |
| | HYDRO ONE LTD | 70,000 | 39.36 | 2,755,200.00 | |
| | ALTAGAS LTD | 60,000 | 23.71 | 1,422,600.00 | |
| | ALGONQUIN POWER & UTILITIES | 139,000 | 11.89 | 1,652,710.00 | |
| | CANADIAN UTILITIES LTD A | 27,000 | 39.28 | 1,060,560.00 | |
| | BROOKFIELD ASSET MGMT-A | 80,000 | 44.60 | 3,568,000.00 | |
| | BROOKFIELD CORP | 314,000 | 43.07 | 13,523,980.00 | |
| | IGM FINANCIAL INC | 21,000 | 39.22 | 823,620.00 | |
| | ONEX CORPORATION | 16,900 | 60.92 | 1,029,548.00 | |
| | TMX GROUP LTD | 13,200 | 142.86 | 1,885,752.00 | |
| | BROOKFIELD RENEWABLE COR-A | 29,000 | 47.36 | 1,373,440.00 | |
| | NORTHLAND POWER INC | 53,000 | 32.56 | 1,725,680.00 | |
| | THOMSON REUTERS CORP | 38,000 | 165.18 | 6,276,840.00 | |
| | QUEBECOR INC-CL B | 34,000 | 33.73 | 1,146,820.00 | |
| | FIRSTSERVICE CORP | 8,500 | 192.16 | 1,633,360.00 | |
| | 小計 銘柄数：85 | | | 544,077,236.20 | |
| | | | | (54,946,360,083) | |
| | 組入時価比率：3.6% | | | 3.7% | |
| ユーロ | TENARIS SA | 101,000 | 12.50 | 1,262,500.00 | |
| | ENI SPA | 561,000 | 13.52 | 7,584,720.00 | |
| | GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 109,000 | 10.58 | 1,153,220.00 | |
| | NESTE OYJ | 96,000 | 39.68 | 3,809,280.00 | |
| | OMV AG | 32,000 | 42.47 | 1,359,040.00 | |
| | REPSOL SA | 302,000 | 13.01 | 3,929,020.00 | |
| | TOTALENERGIES SE | 552,200 | 55.45 | 30,619,490.00 | |
| | AIR LIQUIDE SA | 115,700 | 163.50 | 18,916,950.00 | |
| | AKZO NOBEL | 39,400 | 74.68 | 2,942,392.00 | |
| | ARKEMA | 13,600 | 89.00 | 1,210,400.00 | |
| | BASF SE | 204,000 | 46.84 | 9,556,380.00 | |
| | COVESTRO AG | 43,000 | 39.98 | 1,719,140.00 | |
| | DSM-FIRMENICH AG | 39,100 | 116.98 | 4,573,918.00 | |
| | EVONIK INDUSTRIES AG | 48,000 | 19.46 | 934,080.00 | |
| | OCI | 21,000 | 22.89 | 480,690.00 | |
| | SOLVAY SA | 16,400 | 107.80 | 1,767,920.00 | |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| SYMRISE AG | 28,900 | 108.45 | 3,134,205.00 |
| UMICORE | 44,000 | 29.20 | 1,284,800.00 |
| CRH PLC | 166,000 | 45.00 | 7,470,000.00 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 30,600 | 70.00 | 2,142,000.00 |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC | 55,000 | 33.78 | 1,857,900.00 |
| ARCELORMITTAL | 118,000 | 25.22 | 2,976,550.00 |
| VOESTALPINE AG | 24,000 | 31.78 | 762,720.00 |
| STORA ENSO OYJ-R | 119,000 | 11.79 | 1,403,010.00 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 120,000 | 30.05 | 3,606,000.00 |
| AIRBUS SE | 131,900 | 121.62 | 16,041,678.00 |
| DASSAULT AVIATION SA | 6,000 | 170.50 | 1,023,000.00 |
| MTU AERO ENGINES AG | 11,900 | 227.20 | 2,703,680.00 |
| RHEINMETALL AG | 9,400 | 263.50 | 2,476,900.00 |
| SAFRAN SA | 75,800 | 137.50 | 10,422,500.00 |
| THALES SA | 23,500 | 138.20 | 3,247,700.00 |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD) | 107,000 | 52.63 | 5,631,410.00 |
| KINGSPAN GROUP PLC | 33,400 | 61.84 | 2,065,456.00 |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV | 50,094 | 31.99 | 1,602,507.06 |
| BOUYGUES | 52,000 | 32.13 | 1,670,760.00 |
| EIFFAGE SA | 18,100 | 106.00 | 1,918,600.00 |
| FERROVIAL SA | 105,847 | 29.02 | 3,071,679.94 |
| VINCI | 119,200 | 109.80 | 13,088,160.00 |
| LEGRAND SA | 59,100 | 85.64 | 5,061,324.00 |
| PRYSMIAN SPA | 59,000 | 36.81 | 2,171,790.00 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 121,000 | 155.40 | 18,803,400.00 |
| SIEMENS ENERGY AG | 120,000 | 22.24 | 2,668,800.00 |
| SIEMENS AG | 169,800 | 150.64 | 25,578,672.00 |
| ALSTOM | 71,000 | 23.65 | 1,679,150.00 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 221,000 | 12.93 | 2,857,530.00 |
| DAIMLER TRUCK HOLDING AG | 103,000 | 28.74 | 2,960,220.00 |
| GEA GROUP AG | 34,000 | 40.45 | 1,375,300.00 |
| KNORR-BREMSE AG | 15,200 | 64.30 | 977,360.00 |
| KONE OYJ | 76,000 | 52.72 | 4,006,720.00 |
| METSO CORPORATION | 145,000 | 10.70 | 1,551,500.00 |
| RATIONAL AG | 1,050 | 651.50 | 684,075.00 |

| | | | |
|-------------------------------------|---------|----------|---------------|
| WARTSILA OYJ | 101,000 | 10.80 | 1,090,800.00 |
| BRENNTAG SE | 34,100 | 74.90 | 2,554,090.00 |
| IMCD NV | 12,600 | 136.25 | 1,716,750.00 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 218,000 | 42.04 | 9,164,720.00 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 137,000 | 9.29 | 1,273,689.00 |
| ADP | 6,100 | 141.00 | 860,100.00 |
| AENA SME SA | 17,200 | 149.00 | 2,562,800.00 |
| GETLINK | 93,000 | 16.66 | 1,549,380.00 |
| CONTINENTAL AG | 23,200 | 63.96 | 1,483,872.00 |
| MICHELIN (CGDE) | 147,000 | 29.37 | 4,317,390.00 |
| VALEO SA | 45,000 | 17.14 | 771,525.00 |
| BAYER MOTOREN WERK | 73,700 | 108.72 | 8,012,664.00 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 12,500 | 103.60 | 1,295,000.00 |
| DR ING HC F PORSCHE AG | 25,500 | 113.20 | 2,886,600.00 |
| FERRARI NV | 27,800 | 269.90 | 7,503,220.00 |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 177,600 | 67.15 | 11,925,840.00 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 35,200 | 51.24 | 1,803,648.00 |
| RENAULT SA | 40,000 | 32.62 | 1,305,000.00 |
| STELLANTIS NV | 495,000 | 14.94 | 7,396,290.00 |
| VOLKSWAGEN AG | 6,300 | 153.45 | 966,735.00 |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 41,500 | 126.40 | 5,245,600.00 |
| SEB SA | 5,400 | 102.50 | 553,500.00 |
| ADIDAS AG | 35,300 | 165.50 | 5,842,150.00 |
| HERMES INTERNATIONAL | 7,070 | 1,988.20 | 14,056,574.00 |
| KERING SA | 16,750 | 549.20 | 9,199,100.00 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 61,430 | 880.40 | 54,082,972.00 |
| MONCLER SPA | 45,500 | 66.20 | 3,012,100.00 |
| PUMA SE | 24,100 | 50.84 | 1,225,244.00 |
| ACCOR SA | 39,000 | 32.66 | 1,273,740.00 |
| AMADEUS IT GROUP SA | 99,500 | 63.66 | 6,334,170.00 |
| DELIVERY HERO SE | 38,000 | 38.26 | 1,453,880.00 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 37,600 | 182.20 | 6,850,720.00 |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV | 43,000 | 15.98 | 687,312.00 |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM | 24,000 | 37.60 | 902,400.00 |

| | | | |
|-------------------------------|---------|--------|---------------|
| SODEXO | 20,400 | 97.44 | 1,987,776.00 |
| D' IETEREN GROUP | 5,700 | 167.60 | 955,320.00 |
| PROSUS NV | 177,500 | 63.42 | 11,257,050.00 |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA | 243,000 | 31.43 | 7,637,490.00 |
| ZALANDO SE | 50,000 | 31.69 | 1,584,500.00 |
| CARREFOUR SUPERMARCHE | 130,000 | 18.15 | 2,360,150.00 |
| HELLOFRESH SE | 31,800 | 23.31 | 741,258.00 |
| JERONIMO MARTINS | 64,000 | 23.12 | 1,479,680.00 |
| KESKO OYJ-B SHS | 58,000 | 19.00 | 1,102,290.00 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 235,000 | 31.80 | 7,474,175.00 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 192,500 | 58.20 | 11,203,500.00 |
| DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV | 123,000 | 12.10 | 1,488,300.00 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 25,100 | 86.80 | 2,178,680.00 |
| HEINEKEN NV | 56,800 | 103.30 | 5,867,440.00 |
| PERNOD RICARD SA | 45,800 | 214.60 | 9,828,680.00 |
| REMY COINTREAU | 4,900 | 156.85 | 768,565.00 |
| DANONE | 143,900 | 58.81 | 8,462,759.00 |
| JDE PEET'S BV | 21,000 | 27.34 | 574,140.00 |
| KERRY GROUP PLC-A | 34,300 | 95.00 | 3,258,500.00 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 22,900 | 67.66 | 1,549,414.00 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 38,300 | 74.82 | 2,865,606.00 |
| BEIERSDORF AG | 23,000 | 125.65 | 2,889,950.00 |
| LOREAL-ORD | 53,600 | 422.70 | 22,656,720.00 |
| BIOMERIEUX | 8,800 | 94.88 | 834,944.00 |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR | 8,600 | 110.00 | 946,000.00 |
| DIASORIN ITALIA SPA | 6,000 | 102.20 | 613,200.00 |
| ESSILORLUXOTTICA | 65,000 | 183.08 | 11,900,200.00 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 197,000 | 18.95 | 3,733,938.00 |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG | 61,400 | 56.52 | 3,470,328.00 |
| AMPLIFON SPA | 30,000 | 35.44 | 1,063,200.00 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE | 45,000 | 42.54 | 1,914,300.00 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 92,000 | 27.66 | 2,544,720.00 |
| ARGENX SE | 12,500 | 363.40 | 4,542,500.00 |
| GRIFOLS SA | 63,000 | 10.42 | 656,460.00 |
| BAYER AG-REG | 219,500 | 58.33 | 12,803,435.00 |

| | | | |
|---------------------------------------|-----------|----------|---------------|
| IPSEN | 9,000 | 111.10 | 999,900.00 |
| MERCK KGAA | 28,300 | 162.55 | 4,600,165.00 |
| ORION OYJ | 24,200 | 43.21 | 1,045,682.00 |
| RECORDATI SPA | 24,000 | 42.00 | 1,008,000.00 |
| SANOFI | 253,200 | 100.84 | 25,532,688.00 |
| UCB SA | 29,100 | 84.54 | 2,460,114.00 |
| ABN AMRO BANK NV-CVA | 94,000 | 14.21 | 1,336,210.00 |
| AIB GROUP PLC | 230,000 | 3.91 | 899,300.00 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A. | 1,338,000 | 6.31 | 8,442,780.00 |
| BANCO SANTANDER SA | 3,750,000 | 3.18 | 11,943,750.00 |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC | 243,000 | 9.57 | 2,325,510.00 |
| BNP PARIBAS | 245,700 | 58.42 | 14,353,794.00 |
| CAIXABANK | 1,010,000 | 3.34 | 3,376,430.00 |
| COMMERZBANK AG | 236,000 | 9.83 | 2,321,296.00 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 265,000 | 11.14 | 2,953,160.00 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 76,000 | 32.29 | 2,454,040.00 |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA | 139,000 | 12.68 | 1,762,520.00 |
| ING GROEP NV | 835,000 | 11.18 | 9,336,970.00 |
| INTESA SANPAOLO | 3,620,000 | 2.45 | 8,892,530.00 |
| KBC GROEP NV | 55,600 | 61.18 | 3,401,608.00 |
| MEDIOBANCA S. P. A. | 124,000 | 9.93 | 1,231,568.00 |
| SOCIETE GENERALE | 175,000 | 21.66 | 3,790,500.00 |
| UNICREDIT SPA | 431,000 | 19.06 | 8,215,722.00 |
| ADYEN NV | 4,780 | 1,415.00 | 6,763,700.00 |
| EDENRED | 56,900 | 58.88 | 3,350,272.00 |
| EURAZEO SE | 10,700 | 64.45 | 689,615.00 |
| EXOR NV | 24,300 | 75.50 | 1,834,650.00 |
| GROUPE BRUXELLES LAM | 21,400 | 79.52 | 1,701,728.00 |
| NEXI SPA | 130,000 | 7.50 | 975,520.00 |
| SOFINA SA | 3,700 | 200.20 | 740,740.00 |
| WENDEL | 6,000 | 101.00 | 606,000.00 |
| WORLDLINE SA | 54,000 | 39.96 | 2,157,840.00 |
| AEGON NV | 410,000 | 4.05 | 1,661,730.00 |
| AGEAS | 36,000 | 40.78 | 1,468,080.00 |

| | | | |
|-----------------------------------|-----------|--------|---------------|
| ALLIANZ SE-REG | 89,900 | 215.90 | 19,409,410.00 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 242,000 | 18.97 | 4,591,950.00 |
| AXA SA | 417,000 | 27.54 | 11,486,265.00 |
| HANNOVER RUECK SE | 13,000 | 192.20 | 2,498,600.00 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 31,300 | 335.80 | 10,510,540.00 |
| NN GROUP NV | 64,000 | 33.43 | 2,139,520.00 |
| POSTE ITALIANE SPA | 120,000 | 9.58 | 1,149,840.00 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 106,000 | 45.12 | 4,782,720.00 |
| BECHTLE AG | 20,000 | 41.72 | 834,400.00 |
| CAPGEMINI SA | 35,800 | 162.00 | 5,799,600.00 |
| DASSAULT SYSTEMES SE | 147,000 | 35.60 | 5,233,935.00 |
| NEMETSCHEK SE | 14,200 | 66.68 | 946,856.00 |
| SAP SE | 231,700 | 122.60 | 28,406,420.00 |
| NOKIA OYJ | 1,220,000 | 3.76 | 4,587,810.00 |
| ASM INTERNATIONAL NV | 10,300 | 337.35 | 3,474,705.00 |
| ASML HOLDING NV | 89,460 | 584.50 | 52,289,370.00 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 287,000 | 32.94 | 9,455,215.00 |
| STMICROELECTRONICS NV | 151,000 | 38.63 | 5,833,885.00 |
| CELLNEX TELECOM SA | 126,000 | 37.25 | 4,693,500.00 |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG | 723,000 | 21.38 | 15,461,355.00 |
| ELISA OYJ | 31,700 | 56.14 | 1,779,638.00 |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL | 72,000 | 12.31 | 886,680.00 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 730,000 | 3.33 | 2,430,900.00 |
| ORANGE SA | 435,000 | 11.71 | 5,093,850.00 |
| TELECOM ITALIA SPA | 1,930,000 | 0.26 | 515,503.00 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 210,000 | 3.12 | 656,040.00 |
| TELEFONICA SA | 1,140,000 | 4.00 | 4,567,980.00 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 25,000 | 14.49 | 362,250.00 |
| ACCIONA S. A. | 5,800 | 168.90 | 979,620.00 |
| ELIA GROUP SA/NV | 6,626 | 125.80 | 833,550.80 |
| ENDESA S. A. | 65,000 | 19.97 | 1,298,050.00 |
| ENEL SPA | 1,805,000 | 6.11 | 11,032,160.00 |
| ENERGIAS DE PORTUGAL | 628,000 | 4.80 | 3,015,656.00 |
| FORTUM OYJ | 100,000 | 13.70 | 1,370,500.00 |
| IBERDROLA SA | 1,359,358 | 11.79 | 16,026,830.82 |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|--------|------------------|
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 89,000 | 16.47 | 1,466,275.00 |
| TERNA SPA | 301,000 | 7.92 | 2,384,522.00 |
| VERBUND AG | 14,500 | 79.55 | 1,153,475.00 |
| ENAGAS SA | 60,000 | 18.22 | 1,093,200.00 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 32,000 | 28.62 | 915,840.00 |
| SNAM SPA | 460,000 | 5.09 | 2,344,160.00 |
| E.ON SE | 505,000 | 12.29 | 6,206,450.00 |
| ENGIE | 411,000 | 14.72 | 6,052,386.00 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 148,000 | 27.63 | 4,089,240.00 |
| AMUNDI SA | 12,800 | 60.05 | 768,640.00 |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 462,000 | 9.67 | 4,468,002.00 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 42,600 | 175.15 | 7,461,390.00 |
| EURONEXT NV | 18,000 | 69.35 | 1,248,300.00 |
| CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES S A | 14,000 | 32.90 | 460,600.00 |
| EDP RENOVAVEIS SA | 66,000 | 19.70 | 1,300,200.00 |
| EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGHT | 66,000 | 0.26 | 17,335.56 |
| RWE AG | 143,000 | 42.04 | 6,011,720.00 |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE | 30,600 | 62.30 | 1,906,380.00 |
| QIAGEN N.V. | 52,000 | 41.25 | 2,145,000.00 |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 5,600 | 347.10 | 1,943,760.00 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 6,000 | 245.90 | 1,475,400.00 |
| BUREAU VERITAS SA | 68,000 | 25.78 | 1,753,040.00 |
| RANDSTAD NV | 25,500 | 47.50 | 1,211,250.00 |
| TELEPERFORMANCE | 13,300 | 159.00 | 2,114,700.00 |
| WOLTERS KLUWER | 56,500 | 111.30 | 6,288,450.00 |
| PUBLICIS GROUPE | 49,800 | 69.92 | 3,482,016.00 |
| VIVENDI SE | 164,000 | 9.82 | 1,611,464.00 |
| BOLLORE SE | 202,000 | 6.04 | 1,221,090.00 |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | 163,000 | 18.84 | 3,071,735.00 |
| SCOUT24 SE | 17,900 | 58.32 | 1,043,928.00 |
| AROUNDTOWN SA | 206,000 | 1.02 | 210,841.00 |
| LEG IMMOBILIEN SE | 17,000 | 52.40 | 890,800.00 |
| VONOVIA SE | 158,000 | 18.06 | 2,853,480.00 |
| 小計 銘柄数 : 222 | | | 1,057,885,226.18 |

| | | | | |
|---------------------|-----------------------------------|-----------|--------------|-------------------|
| | | | | (156,810,327,076) |
| | 組入時価比率：10.2% | | | 10.6% |
| 英債券 | BP PLC | 4,027,000 | 4.88 | 19,673,908.50 |
| | SHELL PLC-NEW | 1,566,000 | 23.78 | 37,239,480.00 |
| | CRODA INTERNATIONAL PLC | 31,100 | 67.34 | 2,094,274.00 |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 40,000 | 19.09 | 763,800.00 |
| | ANGLO AMERICAN PLC | 279,000 | 24.47 | 6,827,130.00 |
| | ANTOFAGASTA PLC | 89,000 | 14.62 | 1,301,180.00 |
| | GLENCORE PLC | 2,280,000 | 4.46 | 10,173,360.00 |
| | RIO TINTO PLC-REG | 248,600 | 50.27 | 12,497,122.00 |
| | MONDI PLC | 113,000 | 12.85 | 1,452,615.00 |
| | BAE SYSTEMS PLC | 693,000 | 9.91 | 6,873,174.00 |
| | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 1,850,000 | 1.51 | 2,805,525.00 |
| | DCC PLC | 21,200 | 47.14 | 999,368.00 |
| | SMITHS GROUP PLC | 80,000 | 16.66 | 1,333,200.00 |
| | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 17,000 | 111.45 | 1,894,650.00 |
| | ASHTED GROUP PLC | 97,900 | 46.27 | 4,529,833.00 |
| | BUNZLE | 77,000 | 31.57 | 2,430,890.00 |
| | RENTOKIL INTIAL PLC | 554,000 | 6.35 | 3,521,224.00 |
| | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 207,000 | 4.93 | 1,021,338.00 |
| | PERSIMMON PLC | 77,000 | 13.35 | 1,028,335.00 |
| | TAYLOR WIMPEY PLC | 840,000 | 1.24 | 1,042,440.00 |
| | THE BERKELEY GRP HOLDINGS | 24,300 | 43.68 | 1,061,424.00 |
| | BURBERRY GROUP PLC | 82,000 | 25.18 | 2,064,760.00 |
| | COMPASS GROUP PLC | 390,000 | 20.65 | 8,053,500.00 |
| | ENTAIN PLC | 132,000 | 14.92 | 1,970,100.00 |
| | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 38,200 | 54.92 | 2,097,944.00 |
| | WHITBREAD PLC | 46,000 | 32.81 | 1,509,260.00 |
| | NEXT PLC | 28,600 | 67.90 | 1,941,940.00 |
| | JD SPORTS FASHION PLC | 610,000 | 1.64 | 1,003,755.00 |
| | KINGFISHER PLC | 450,000 | 2.55 | 1,147,500.00 |
| | OCADO GROUP PLC | 122,000 | 4.75 | 579,500.00 |
| | SAINSBURY | 410,000 | 2.89 | 1,187,360.00 |
| TESCO PLC | 1,610,000 | 2.84 | 4,582,060.00 | |
| COCA-COLA HBC AG-DI | 46,000 | 25.04 | 1,151,840.00 | |

| | | | |
|---------------------------------|------------|--------|---------------|
| DIAGEO PLC | 505,000 | 36.31 | 18,339,075.00 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 79,000 | 19.25 | 1,521,145.00 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 470,000 | 28.00 | 13,162,350.00 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 196,000 | 19.23 | 3,769,080.00 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 158,700 | 64.68 | 10,264,716.00 |
| HALEON PLC | 1,140,000 | 3.38 | 3,860,610.00 |
| UNILEVER PLC | 562,300 | 43.68 | 24,564,075.50 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 198,000 | 12.58 | 2,490,840.00 |
| NMC HEALTH PLC | 13,300 | 0.00 | 6.65 |
| ASTRAZENECA PLC | 343,880 | 119.14 | 40,969,863.20 |
| GSK PLC | 908,000 | 14.46 | 13,131,496.00 |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | 37,000 | 18.59 | 687,830.00 |
| BARCLAYS PLC | 3,570,000 | 1.53 | 5,482,806.00 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 4,431,000 | 5.99 | 26,554,983.00 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 15,080,000 | 0.46 | 6,956,404.00 |
| NATWEST GROUP PLC | 1,180,000 | 2.61 | 3,089,240.00 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 534,000 | 6.04 | 3,228,564.00 |
| M&G PLC | 500,000 | 1.99 | 996,500.00 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 42,000 | 22.22 | 933,240.00 |
| AVIVA PLC | 610,000 | 4.14 | 2,525,400.00 |
| LEGAL & GENERAL | 1,340,000 | 2.26 | 3,029,740.00 |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | 170,000 | 5.78 | 983,620.00 |
| PRUDENTIAL PLC | 617,000 | 11.74 | 7,246,665.00 |
| SAGE GROUP PLC (THE) | 220,000 | 8.03 | 1,766,600.00 |
| HALMA PLC | 83,000 | 23.87 | 1,981,210.00 |
| BT GROUP PLC | 1,510,000 | 1.54 | 2,328,420.00 |
| VODAFONE GROUP PLC | 5,780,000 | 0.94 | 5,449,384.00 |
| SSE PLC | 242,000 | 18.59 | 4,498,780.00 |
| NATIONAL GRID PLC | 819,000 | 11.53 | 9,443,070.00 |
| SEVERN TRENT PLC | 53,000 | 29.58 | 1,567,740.00 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 151,000 | 10.88 | 1,643,635.00 |
| 3I GROUP PLC | 213,000 | 17.70 | 3,771,165.00 |
| ABRDN PLC | 440,000 | 2.05 | 902,440.00 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 82,000 | 7.88 | 646,816.00 |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 84,100 | 83.80 | 7,047,580.00 |

| | | | | |
|--------|-------------------------------|---------|------------|------------------|
| | SCHRODERS PLC | 189,176 | 4.66 | 883,073.56 |
| | ST JAMES S PLACE PLC | 118,000 | 11.28 | 1,331,630.00 |
| | PEARSON | 143,000 | 8.26 | 1,182,038.00 |
| | EXPERIAN PLC | 205,000 | 27.08 | 5,551,400.00 |
| | INTERTEK GROUP PLC | 35,000 | 42.28 | 1,479,800.00 |
| | RELX PLC | 428,000 | 24.79 | 10,610,120.00 |
| | INFORMA PLC | 311,000 | 6.99 | 2,174,512.00 |
| | WPP PLC | 235,000 | 8.97 | 2,108,890.00 |
| | AUTO TRADER GROUP PLC | 195,000 | 6.25 | 1,220,310.00 |
| 小計 | 銘柄数 : 77 | | | 409,230,652.41 |
| | | | | (69,835,210,833) |
| | 組入時価比率 : 4.5% | | | 4.7% |
| スイスフラン | CLARIANT AG-REG | 53,000 | 14.04 | 744,120.00 |
| | EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 1,630 | 716.00 | 1,167,080.00 |
| | GIVAUDAN-REG | 2,040 | 3,116.00 | 6,356,640.00 |
| | SIKA AG-REG | 32,700 | 247.40 | 8,089,980.00 |
| | HOLCIM LTD | 122,100 | 58.22 | 7,108,662.00 |
| | SIG GROUP AG | 66,000 | 25.86 | 1,706,760.00 |
| | GEBERIT AG-REG | 7,960 | 510.80 | 4,065,968.00 |
| | ABB LTD | 351,000 | 32.53 | 11,418,030.00 |
| | SCHINDLER HOLDING AG-REG | 4,900 | 190.20 | 931,980.00 |
| | SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 9,300 | 199.10 | 1,851,630.00 |
| | VAT GROUP AG | 6,000 | 316.70 | 1,900,200.00 |
| | KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 12,400 | 273.40 | 3,390,160.00 |
| | CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A | 115,400 | 148.35 | 17,119,590.00 |
| | THE SWATCH GROUP AG-B | 6,200 | 297.90 | 1,846,980.00 |
| | THE SWATCH GROUP AG-REG | 10,500 | 54.50 | 572,250.00 |
| | BARRY CALLEBAUT AG | 810 | 1,977.00 | 1,601,370.00 |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC | 227 | 11,180.00 | 2,537,860.00 |
| | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG | 24 | 111,000.00 | 2,664,000.00 |
| | NESTLE SA-REG | 610,300 | 116.42 | 71,051,126.00 |
| | ALCON INC | 111,200 | 65.74 | 7,310,288.00 |
| | SONOVA HOLDING AG-REG | 11,600 | 275.60 | 3,196,960.00 |
| | STRAUMANN HOLDING AG-REG | 25,400 | 137.70 | 3,497,580.00 |
| | NOVARTIS AG-REG | 480,100 | 93.46 | 44,870,146.00 |

| | | | | | |
|----------------|------------------------------|---------|--------|------------------|--|
| | ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE) | 155,900 | 283.60 | 44,213,240.00 | |
| | ROCHE HOLDINGS AG-BEARER | 6,000 | 310.60 | 1,863,600.00 | |
| | BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG | 6,500 | 85.95 | 558,675.00 | |
| | BALOISE HOLDING AG | 9,900 | 142.50 | 1,410,750.00 | |
| | SWISS LIFE HOLDING AG | 6,800 | 562.40 | 3,824,320.00 | |
| | SWISS RE LTD | 67,200 | 91.16 | 6,125,952.00 | |
| | ZURICH INSURANCE GROUP AG | 33,600 | 432.50 | 14,532,000.00 | |
| | TEMENOS AG-REG | 13,700 | 72.56 | 994,072.00 | |
| | LOGITECH INTERNATIONAL-REG | 37,600 | 56.68 | 2,131,168.00 | |
| | SWISSCOM AG-REG | 5,690 | 605.20 | 3,443,588.00 | |
| | BKW AG | 4,600 | 158.80 | 730,480.00 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 789,999 | 0.77 | 609,089.22 | |
| | JULIUS BAER GROUP LTD | 46,300 | 61.92 | 2,866,896.00 | |
| | PARTNERS GROUP HOLDING AG | 5,040 | 841.80 | 4,242,672.00 | |
| | UBS GROUP AG | 748,000 | 17.45 | 13,052,600.00 | |
| | BACHEM HOLDING AG-REG B | 7,900 | 103.40 | 816,860.00 | |
| | LONZA AG-REG | 16,360 | 563.80 | 9,223,768.00 | |
| | ADECCO GROUP AG-REG | 33,000 | 29.38 | 969,540.00 | |
| | SGS SA-REG | 36,000 | 81.10 | 2,919,600.00 | |
| | SWISS PRIME SITE-REG | 17,500 | 79.70 | 1,394,750.00 | |
| 小計 | 銘柄数 : 43 | | | 320,922,980.22 | |
| | | | | (48,738,573,006) | |
| | 組入時価比率 : 3.2% | | | 3.3% | |
| スウェーデンク ローナ | BOLIDEN AB | 59,000 | 361.85 | 21,349,150.00 | |
| | BOLIDEN AB-RED SHS | 59,000 | 11.50 | 678,500.00 | |
| | HOLMEN AB-B SHARES | 19,000 | 407.50 | 7,742,500.00 | |
| | SVENSKA CELLULOSA AB-B | 137,000 | 143.35 | 19,638,950.00 | |
| | ASSA ABLOY AB-B | 226,000 | 242.50 | 54,805,000.00 | |
| | NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 338,000 | 113.95 | 38,515,100.00 | |
| | SKANSKA AB-B SHS | 77,000 | 149.30 | 11,496,100.00 | |
| | INVESTMENT AB LATOUR-B SHS | 33,000 | 223.10 | 7,362,300.00 | |
| | LIFCO AB-B SHS | 52,000 | 235.00 | 12,220,000.00 | |
| | ALFA LAVAL AB | 63,000 | 379.70 | 23,921,100.00 | |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 598,000 | 147.70 | 88,324,600.00 | |
| | ATLAS COPCO AB-B SHS | 352,000 | 130.10 | 45,795,200.00 | |

| | | | |
|----------------------------------|---------|----------|------------------|
| EPIROC AB - A | 151,000 | 202.70 | 30,607,700.00 |
| EPIROC AB - B | 89,000 | 174.40 | 15,521,600.00 |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 94,000 | 90.26 | 8,484,440.00 |
| INDUTRADE AB | 64,000 | 252.80 | 16,179,200.00 |
| SANDVIK AB | 239,000 | 205.20 | 49,042,800.00 |
| SKF AB-B SHARES | 88,000 | 184.25 | 16,214,000.00 |
| VOLVO AB-A SHS | 40,000 | 211.00 | 8,440,000.00 |
| VOLVO AB-B SHS | 330,000 | 205.90 | 67,947,000.00 |
| SECURITAS AB-B SHS | 110,857 | 85.92 | 9,524,833.44 |
| VOLVO CAR AB-B | 120,000 | 39.20 | 4,704,000.00 |
| ELECTROLUX AB-B | 53,000 | 164.75 | 8,731,750.00 |
| EVOLUTION AB | 40,600 | 1,288.20 | 52,300,920.00 |
| HENNES&MAURITZ AB-B | 162,000 | 143.30 | 23,214,600.00 |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B | 132,000 | 306.50 | 40,458,000.00 |
| GETINGE AB-B SHS | 53,000 | 246.50 | 13,064,500.00 |
| SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | 36,000 | 260.60 | 9,381,600.00 |
| NORDEA BANK ABP | 725,000 | 106.76 | 77,401,000.00 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 367,000 | 114.20 | 41,911,400.00 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A | 320,000 | 86.42 | 27,654,400.00 |
| SWEDBANK AB | 197,000 | 166.75 | 32,849,750.00 |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS | 31,000 | 286.40 | 8,878,400.00 |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 32,000 | 286.00 | 9,152,000.00 |
| INVESTOR AB-A SHS | 115,000 | 220.30 | 25,334,500.00 |
| INVESTOR AB-B SHS | 401,000 | 215.65 | 86,475,650.00 |
| KINNEVIK AB - B | 56,000 | 164.45 | 9,209,200.00 |
| LUNDBERGS AB-B SHS | 15,500 | 484.20 | 7,505,100.00 |
| ERICSSON LM-B | 658,000 | 54.65 | 35,959,700.00 |
| HEXAGON AB-B SHS | 431,000 | 115.05 | 49,586,550.00 |
| TELIA CO AB | 580,000 | 26.92 | 15,613,600.00 |
| TELE 2 AB-B SHS | 116,000 | 105.60 | 12,249,600.00 |
| EQT AB | 81,000 | 205.40 | 16,637,400.00 |
| EMBRACER GROUP AB | 134,000 | 52.36 | 7,016,240.00 |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS | 141,000 | 39.73 | 5,601,930.00 |
| SAGAX AB-B | 40,000 | 218.80 | 8,752,000.00 |
| 小計 銘柄数 : 46 | | | 1,183,453,863.44 |

| | | | | | | |
|---------------|---------------------------|-------------|-----------|------------------|-----------------|------|
| | | | | (15,692,598,229) | | |
| | 組入時価比率：1.0% | | | 1.1% | | |
| ノルウェークロ ーネ | AKER BP ASA | 72,000 | 242.50 | 17,460,000.00 | | |
| | EQUINOR ASA | 212,000 | 309.35 | 65,582,200.00 | | |
| | YARA INTERNATIONAL ASA | 37,000 | 419.60 | 15,525,200.00 | | |
| | NORSK HYDRO | 291,000 | 74.36 | 21,638,760.00 | | |
| | KONGSBERG GRUPPEN ASA | 21,000 | 475.00 | 9,975,000.00 | | |
| | MOWI ASA | 96,000 | 191.00 | 18,336,000.00 | | |
| | ORKLA ASA | 153,000 | 81.38 | 12,451,140.00 | | |
| | SALMAR ASA | 16,000 | 443.10 | 7,089,600.00 | | |
| | DNB BANK ASA | 205,000 | 185.85 | 38,099,250.00 | | |
| | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 40,000 | 181.70 | 7,268,000.00 | | |
| | TELENOR ASA | 146,000 | 129.30 | 18,877,800.00 | | |
| | ADEVINTA ASA | 63,000 | 79.30 | 4,995,900.00 | | |
| | 小計 | 銘柄数：12 | | | 237,298,850.00 | |
| | | 組入時価比率：0.2% | | | (3,035,052,291) | 0.2% |
| デンマーククロ ーネ | CHR HANSEN HOLDING A/S | 23,500 | 521.00 | 12,243,500.00 | | |
| | NOVOZYMES A/S-B SHARES | 44,500 | 347.40 | 15,459,300.00 | | |
| | ROCKWOOL A/S-B SHS | 1,700 | 1,733.00 | 2,946,100.00 | | |
| | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 227,000 | 194.40 | 44,128,800.00 | | |
| | DSV A/S | 41,700 | 1,309.50 | 54,606,150.00 | | |
| | A P MOLLER - MAERSK A/S-A | 720 | 11,770.00 | 8,474,400.00 | | |
| | AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 1,090 | 11,940.00 | 13,014,600.00 | | |
| | PANDORA A/S | 20,000 | 603.40 | 12,068,000.00 | | |
| | CARLSBERG B | 21,800 | 1,103.00 | 24,045,400.00 | | |
| | COLOPLAST-B | 25,900 | 966.00 | 25,019,400.00 | | |
| | DEMANT A/S | 20,100 | 284.80 | 5,724,480.00 | | |
| | GENMAB A/S | 14,400 | 2,690.00 | 38,736,000.00 | | |
| | NOVO NORDISK A/S-B | 367,400 | 1,141.80 | 419,497,320.00 | | |
| | DANSKE BANK AS | 155,000 | 138.85 | 21,521,750.00 | | |
| | TRYG A/S | 83,000 | 157.55 | 13,076,650.00 | | |
| | ORSTED A/S | 41,000 | 617.80 | 25,329,800.00 | | |
| | 小計 | 銘柄数：16 | | | 735,891,650.00 | |

| | | | | | |
|-----|-------------------------------|-----------|--------|------------------|--|
| | | | | (14,651,602,751) | |
| | 組入時価比率：1.0% | | | 1.0% | |
| 豪ドル | AMPOL LTD | 49,000 | 29.64 | 1,452,360.00 | |
| | SANTOS LTD. | 710,000 | 7.27 | 5,161,700.00 | |
| | WASHINGTON H. SOUL PATTINSON | 48,000 | 31.90 | 1,531,200.00 | |
| | WOODSIDE ENERGY GROUP LTD | 421,000 | 33.97 | 14,301,370.00 | |
| | ORICA LTD | 99,000 | 16.42 | 1,625,580.00 | |
| | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 101,000 | 34.16 | 3,450,160.00 | |
| | BHP GROUP LIMITED | 1,124,000 | 44.47 | 49,984,280.00 | |
| | BLUESCOPE STEEL LTD | 104,000 | 20.22 | 2,102,880.00 | |
| | FORTESCUE METALS GROUP LTD | 371,000 | 20.58 | 7,635,180.00 | |
| | IGO LTD | 150,000 | 14.63 | 2,194,500.00 | |
| | MINERAL RESOURCES LTD | 37,500 | 73.50 | 2,756,250.00 | |
| | NEWCREST MINING | 203,000 | 29.39 | 5,966,170.00 | |
| | NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 257,000 | 13.99 | 3,595,430.00 | |
| | PILBARA MINERALS LTD | 540,000 | 4.69 | 2,532,600.00 | |
| | RIO TINTO LTD | 81,800 | 111.44 | 9,115,792.00 | |
| | SOUTH32 LTD | 1,010,000 | 4.18 | 4,221,800.00 | |
| | REECE LTD | 49,000 | 18.25 | 894,250.00 | |
| | BRAMBLES LTD | 318,000 | 14.15 | 4,499,700.00 | |
| | QANTAS AIRWAYS LIMITED | 220,000 | 6.39 | 1,405,800.00 | |
| | AURIZON HOLDINGS LTD | 380,000 | 3.52 | 1,337,600.00 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 686,000 | 14.81 | 10,159,660.00 | |
| | ARISTOCRAT LEISURE LTD | 134,000 | 37.50 | 5,025,000.00 | |
| | LOTTERY CORP LTD/THE | 480,000 | 4.95 | 2,376,000.00 | |
| | WESFARMERS LIMITED | 249,000 | 51.35 | 12,786,150.00 | |
| | COLES GROUP LTD | 293,000 | 18.12 | 5,309,160.00 | |
| | ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA | 330,000 | 6.35 | 2,095,500.00 | |
| | WOOLWORTHS GROUP LTD | 271,000 | 38.55 | 10,447,050.00 | |
| | TREASURY WINE ESTATES LTD | 156,000 | 13.42 | 2,093,520.00 | |
| | COCHLEAR LTD | 14,100 | 243.04 | 3,426,864.00 | |
| | RAMSAY HEALTH CARE LTD | 41,000 | 60.58 | 2,483,780.00 | |
| | SONIC HEALTHCARE LTD | 99,000 | 35.34 | 3,498,660.00 | |
| | CSL LIMITED | 107,500 | 299.82 | 32,230,650.00 | |
| | ANZ GROUP HOLDINGS LTD | 670,000 | 24.00 | 16,080,000.00 | |

| | | | | | |
|------------|--|---------|--------|------------------|--|
| | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 376,100 | 97.34 | 36,609,574.00 | |
| | NATIONAL AUSTRALIA BANK | 698,000 | 27.36 | 19,097,280.00 | |
| | WESTPAC BANKING CORP | 783,000 | 21.77 | 17,045,910.00 | |
| | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | 540,000 | 4.93 | 2,662,200.00 | |
| | MEDIBANK PRIVATE LTD | 590,000 | 3.60 | 2,124,000.00 | |
| | QBE INSURANCE | 332,000 | 15.30 | 5,079,600.00 | |
| | SUNCORP GROUP LTD | 291,000 | 12.53 | 3,646,230.00 | |
| | WISETECH GLOBAL LTD | 33,000 | 67.99 | 2,243,670.00 | |
| | XERO LIMITED | 31,500 | 92.07 | 2,900,205.00 | |
| | TELSTRA GROUP LTD | 920,000 | 4.33 | 3,983,600.00 | |
| | ORIGIN ENERGY LTD | 370,000 | 8.43 | 3,119,100.00 | |
| | APA GROUP | 257,000 | 10.46 | 2,688,220.00 | |
| | ASX LTD | 41,500 | 69.71 | 2,892,965.00 | |
| | MACQUARIE GROUP LIMITED | 81,500 | 177.43 | 14,460,545.00 | |
| | IDP EDUCATION LTD | 46,000 | 26.64 | 1,225,440.00 | |
| | COMPUTERSHARE LTD | 125,000 | 21.96 | 2,745,000.00 | |
| | REA GROUP LTD | 12,500 | 139.14 | 1,739,250.00 | |
| | SEEK LTD | 70,000 | 23.46 | 1,642,200.00 | |
| 小計 | 銘柄数：51 | | | 359,681,585.00 | |
| | | | | (32,874,896,869) | |
| | 組入時価比率：2.1% | | | 2.2% | |
| ニュージーランドドル | AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 270,000 | 8.75 | 2,362,500.00 | |
| | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L | 127,000 | 26.75 | 3,397,250.00 | |
| | EBOS GROUP LTD | 35,000 | 44.50 | 1,557,500.00 | |
| | SPARK NEW ZEALAND LTD | 430,000 | 5.22 | 2,246,750.00 | |
| | MERCURY NZ LTD | 137,000 | 6.49 | 889,130.00 | |
| | MERIDIAN ENERGY LTD | 300,000 | 5.45 | 1,635,000.00 | |
| 小計 | 銘柄数：6 | | | 12,088,130.00 | |
| | | | | (1,035,106,571) | |
| | 組入時価比率：0.1% | | | 0.1% | |
| 香港ドル | XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD | 430,000 | 13.50 | 5,805,000.00 | |
| | CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 584,040 | 53.15 | 31,041,726.00 | |
| | TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED | 304,000 | 83.55 | 25,399,200.00 | |
| | SITC INTERNATIONAL HOLDINGS | 280,000 | 13.36 | 3,740,800.00 | |

| | | | | |
|------------------------------------|----------------------------|------------|------------------|--------------|
| MTR CORP | 340,000 | 39.65 | 13,481,000.00 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 493,000 | 51.20 | 25,241,600.00 | |
| SANDS CHINA LTD | 564,000 | 25.10 | 14,156,400.00 | |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT | 410,000 | 21.85 | 8,958,500.00 | |
| WH GROUP LIMITED | 1,759,806 | 4.37 | 7,690,352.22 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 840,000 | 24.95 | 20,958,000.00 | |
| HANG SENG BANK | 172,000 | 114.50 | 19,694,000.00 | |
| AIA GROUP LTD | 2,624,000 | 80.90 | 212,281,600.00 | |
| HKT TRUST AND HKT LTD | 849,600 | 10.28 | 8,733,888.00 | |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | 134,000 | 46.50 | 6,231,000.00 | |
| CLP HLDGS | 366,000 | 60.70 | 22,216,200.00 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 310,000 | 46.10 | 14,291,000.00 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 2,410,383 | 7.65 | 18,439,429.95 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 269,000 | 316.00 | 85,004,000.00 | |
| CK ASSET HOLDINGS LTD | 441,040 | 46.05 | 20,309,892.00 | |
| ESR GROUP LTD | 440,000 | 12.02 | 5,288,800.00 | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 460,000 | 13.54 | 6,228,400.00 | |
| HENDERSON LAND | 310,443 | 28.15 | 8,738,970.45 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 309,916 | 21.05 | 6,523,731.80 | |
| SINO LAND CO. LTD | 730,000 | 10.32 | 7,533,600.00 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 322,000 | 107.70 | 34,679,400.00 | |
| SWIRE PACIFIC-A | 104,000 | 60.20 | 6,260,800.00 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 230,000 | 21.20 | 4,876,000.00 | |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT | 383,000 | 42.45 | 16,258,350.00 | |
| 小計 | 銘柄数：28 | | 660,061,640.42 | |
| | | | (11,379,462,680) | |
| | 組入時価比率：0.7% | | 0.8% | |
| シンガポールドル | SINGAPORE TECH ENGINEERING | 380,000 | 3.65 | 1,387,000.00 |
| | JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD | 21,000 | 33.85 | 710,850.00 |
| | KEPPEL CORP. | 313,000 | 6.38 | 1,996,940.00 |
| | SEATRUM LTD | 10,173,615 | 0.13 | 1,332,743.56 |
| | SINGAPORE AIRLINES LTD | 280,000 | 5.85 | 1,638,000.00 |
| | GENTING SINGAPORE LTD | 1,410,000 | 1.11 | 1,565,100.00 |
| | WILMAR INTERNATIONAL LTD | 440,000 | 3.98 | 1,751,200.00 |

| | | | | | |
|-------|--------------------------------------|-----------|--------|---------------------|--|
| | DBS GROUP HLDGS | 402,000 | 31.70 | 12,743,400.00 | |
| | OCBC-ORD | 761,000 | 12.25 | 9,322,250.00 | |
| | UNITED OVERSEAS BANK | 266,000 | 28.17 | 7,493,220.00 | |
| | VENTURE CORP LTD | 58,000 | 15.63 | 906,540.00 | |
| | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 1,790,000 | 2.58 | 4,618,200.00 | |
| | SINGAPORE EXCHANGE LTD | 199,000 | 9.55 | 1,900,450.00 | |
| | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI | 600,000 | 3.82 | 2,292,000.00 | |
| | CITY DEVELOPMENTS LTD | 100,000 | 6.91 | 691,000.00 | |
| | UOL GROUP LIMITED | 87,000 | 6.87 | 597,690.00 | |
| | 小計 銘柄数：16 | | | 50,946,583.56 | |
| | 組入時価比率：0.3% | | | (5,190,437,933) | |
| | | | | 0.4% | |
| 新シェケル | ICL GROUP LTD | 157,000 | 21.98 | 3,450,860.00 | |
| | ELBIT SYSTEMS LTD | 5,900 | 701.00 | 4,135,900.00 | |
| | BANK HAPOALIM BM | 291,000 | 31.76 | 9,242,160.00 | |
| | BANK LEUMI LE-ISRAEL | 337,000 | 28.24 | 9,516,880.00 | |
| | FIRST INTL BANK ISRAEL | 12,000 | 134.60 | 1,615,200.00 | |
| | ISRAEL DISCOUNT BANK-A | 280,000 | 18.04 | 5,051,200.00 | |
| | MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 33,000 | 119.00 | 3,927,000.00 | |
| | NICE LTD | 13,800 | 685.00 | 9,453,000.00 | |
| | TOWER SEMICONDUCTOR LTD | 26,000 | 155.30 | 4,037,800.00 | |
| | BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO | 470,000 | 5.14 | 2,418,620.00 | |
| | AZRIELI GROUP | 8,600 | 209.50 | 1,801,700.00 | |
| | 小計 銘柄数：11 | | | 54,650,320.00 | |
| | 組入時価比率：0.1% | | | (2,014,306,959) | |
| | | | | 0.1% | |
| 合計 | | | | 1,481,755,270,080 | |
| | | | | (1,481,755,270,080) | |

(注1) 外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2) 株式以外の有価証券(2023年5月10日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|-----|------------------------------|--------|--------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 34,000 | 4,121,820.00 | |

| | | | | |
|--|------------------------------|---------|---------------|--|
| | AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 67,000 | 2,359,740.00 | |
| | AMERICAN TOWER CORP | 102,900 | 19,913,208.00 | |
| | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 103,000 | 1,929,190.00 | |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 30,700 | 5,505,124.00 | |
| | BOSTON PROPERTIES | 33,600 | 1,713,264.00 | |
| | CAMDEN PROPERTY TRUST | 21,500 | 2,377,255.00 | |
| | CROWN CASTLE INC | 96,800 | 11,330,440.00 | |
| | DIGITAL REALTY TRUST INC | 64,100 | 6,192,701.00 | |
| | EQUINIX INC | 20,490 | 14,922,047.40 | |
| | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 40,600 | 2,785,972.00 | |
| | EQUITY RESIDENTIAL | 79,100 | 4,932,676.00 | |
| | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 14,300 | 3,093,233.00 | |
| | EXTRA SPACE STORAGE INC | 29,700 | 4,645,971.00 | |
| | GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 56,000 | 2,852,640.00 | |
| | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 86,000 | 1,683,880.00 | |
| | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 123,000 | 2,590,380.00 | |
| | HOST HOTELS & RESORTS INC | 158,000 | 2,765,000.00 | |
| | INVITATION HOMES INC | 136,000 | 4,630,800.00 | |
| | IRON MOUNTAIN INC | 66,000 | 3,681,480.00 | |
| | KIMCO REALTY CORP | 133,000 | 2,415,280.00 | |
| | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 135,000 | 1,132,650.00 | |
| | MID-AMERICA APARTMENT COMM | 25,000 | 3,770,000.00 | |
| | PROLOGIS INC | 204,812 | 25,789,927.04 | |
| | PUBLIC STORAGE | 35,100 | 10,505,079.00 | |
| | REALTY INCOME CORP | 139,300 | 8,667,246.00 | |
| | REGENCY CENTERS CORP | 35,200 | 2,072,576.00 | |
| | SBA COMMUNICATIONS CORP | 24,300 | 5,689,116.00 | |
| | SIMON PROPERTY GROUP INC | 73,400 | 7,816,366.00 | |
| | SUN COMMUNITIES INC | 27,000 | 3,623,670.00 | |
| | UDR INC | 73,000 | 2,974,750.00 | |
| | VENTAS INC | 87,000 | 4,076,820.00 | |
| | VICI PROPERTIES INC | 214,000 | 7,051,300.00 | |
| | WELLTOWER INC | 105,100 | 8,231,432.00 | |
| | WEYERHAEUSER CO | 166,000 | 4,973,360.00 | |
| | WP CAREY INC | 45,100 | 3,259,828.00 | |

| | | | |
|-------|------------------------------|-----------|---|
| 小計 | 銘柄数：36 組入時価比率：1.8% | 2,885,102 | 206,076,221.44 (27,851,201,327) 85.7% |
| カナダドル | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 21,000 | 1,037,190.00 |
| | RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 28,000 | 565,880.00 |
| 小計 | 銘柄数：2 組入時価比率：0.0% | 49,000 | 1,603,070.00 (161,894,039) 0.5% |
| ユーロ | COVIVIO | 11,300 | 546,016.00 |
| | GECINA SA | 9,600 | 931,680.00 |
| | KLEPIERRE | 49,000 | 1,055,950.00 |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 27,300 | 1,236,417.00 |
| | WAREHOUSES DE PAUW SCA | 37,000 | 967,920.00 |
| 小計 | 銘柄数：5 組入時価比率：0.0% | 134,200 | 4,737,983.00 (702,311,220) 2.2% |
| 英ポンド | BRITISH LAND | 183,000 | 708,027.00 |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 152,000 | 979,792.00 |
| | SEGRO PLC | 265,000 | 2,138,020.00 |
| 小計 | 銘柄数：3 組入時価比率：0.0% | 600,000 | 3,825,839.00 (652,879,425) 2.0% |
| 豪ドル | DEXUS/AU | 252,000 | 2,003,400.00 |
| | GOODMAN GROUP | 383,000 | 7,591,060.00 |
| | GPT GROUP | 440,000 | 1,931,600.00 |
| | LENDLEASE GROUP | 135,000 | 1,063,800.00 |
| | MIRVAC GROUP | 890,000 | 2,073,700.00 |
| | SCENTRE GROUP | 1,100,000 | 3,102,000.00 |
| | STOCKLAND TRUST GROUP | 540,000 | 2,397,600.00 |
| | VICINITY CENTRES | 800,000 | 1,648,000.00 |
| 小計 | 銘柄数：8 組入時価比率：0.1% | 4,540,000 | 21,811,160.00 (1,993,540,024) 6.1% |
| 香港ドル | LINK REIT | 555,600 | 28,141,140.00 |
| 小計 | 銘柄数：1 | 555,600 | 28,141,140.00 |

| | | | | |
|----------|--|-------------|-------------|---------------------|
| | | | | (485, 153, 253) |
| | | 組入時価比率：0.0% | | 1.5% |
| シンガポールドル | CAPITALAND ASCENDAS REIT | | 710, 040 | 2, 037, 814. 80 |
| | CAPITALAND ASCOTT TRUST | | 34, 207 | 36, 259. 42 |
| | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | | 1, 160, 021 | 2, 389, 643. 26 |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 710, 029 | 1, 235, 450. 46 |
| | MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST | | 490, 000 | 842, 800. 00 |
| 小計 | 銘柄数：5 | | 3, 104, 297 | 6, 541, 967. 94 |
| | | 組入時価比率：0.0% | | (666, 495, 693) |
| | | | | 2.0% |
| 合計 | | | | 32, 513, 474, 981 |
| | | | | (32, 513, 474, 981) |

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

(注2) 外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 2023年5月10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 | 25, 656, 582, 902 | — | 26, 256, 730, 312 | 600, 147, 410 |
| 合計 | 25, 656, 582, 902 | — | 26, 256, 730, 312 | 600, 147, 410 |

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2023年5月10日現在)

資産の部

流動資産

| | |
|-----------------|----------------|
| コール・ローン | 92,718,817 |
| 国債証券 | 21,985,738,140 |
| 未収利息 | 44,421,892 |
| 前払費用 | 1,754,570 |
| 流動資産合計 | 22,124,633,419 |
| 資産合計 | 22,124,633,419 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払解約金 | 26,632,141 |
| 未払利息 | 151 |
| 流動負債合計 | 26,632,292 |
| 負債合計 | 26,632,292 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 16,728,022,987 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 5,369,978,140 |
| 元本等合計 | 22,098,001,127 |
| 純資産合計 | 22,098,001,127 |
| 負債純資産合計 | 22,124,633,419 |

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

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|----------------------------|-----------|
| 2023年5月10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 | 1.3210円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (13,210円) |

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

| |
|--|
| 自 2022年5月11日 至 2023年5月10日 |
| 1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 |

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2023年5月10日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2023年5月10日現在

| 期首 | 2022年5月11日 |
|------------------------------------|-----------------|
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 14,651,064,577円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 6,291,935,523円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 4,214,977,113円 |
| 期末元本額 | 16,728,022,987円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 573,771,163円 |
| バランスセレクト50 | 649,364,912円 |
| バランスセレクト70 | 327,514,697円 |
| ネクストコア | 189,195,513円 |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用) | 364,155,804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) | 1,404,896,619円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 26,949,291円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 62,519,512円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 24,859,856円 |
| 野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 4,963,689,325円 |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け) | 188,386,182円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 6,942,571,277円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 1,010,148,836円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2023年5月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2023年5月10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438回 | 390,000,000 | 390,530,400 | |
| | | 国庫債券 利付（2年）第439回 | 130,000,000 | 130,183,300 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第140回 | 70,000,000 | 70,166,600 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第141回 | 340,000,000 | 340,901,000 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第142回 | 190,000,000 | 190,551,000 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第143回 | 200,000,000 | 200,594,000 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第144回 | 130,000,000 | 130,425,100 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第145回 | 270,000,000 | 270,988,200 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第146回 | 150,000,000 | 150,588,000 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第147回 | 120,000,000 | 120,171,600 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第148回 | 160,000,000 | 160,198,400 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第149回 | 180,000,000 | 180,180,000 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第150回 | 160,000,000 | 160,086,400 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第151回 | 90,000,000 | 90,000,000 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第152回 | 270,000,000 | 270,988,200 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第153回 | 290,000,000 | 289,701,300 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第154回 | 100,000,000 | 100,195,000 | |
| | | 国庫債券 利付（5年）第156回 | 120,000,000 | 120,633,600 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第1回 | 50,000,000 | 63,181,000 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第2回 | 60,000,000 | 72,992,400 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第3回 | 70,000,000 | 85,081,500 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第4回 | 80,000,000 | 97,312,000 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第5回 | 60,000,000 | 70,515,000 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第6回 | 70,000,000 | 80,948,700 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第7回 | 70,000,000 | 77,445,200 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第8回 | 80,000,000 | 82,264,800 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第9回 | 70,000,000 | 53,228,000 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第10回 | 70,000,000 | 62,318,200 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第11回 | 50,000,000 | 42,871,500 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第12回 | 50,000,000 | 38,341,500 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第13回 | 80,000,000 | 60,795,200 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第14回 | 90,000,000 | 73,055,700 | |
| | | 国庫債券 利付（40年）第15回 | 120,000,000 | 106,711,200 | |
| | | 国庫債券 利付（10年）第334回 | 280,000,000 | 282,206,400 | |

| | | | | |
|-----------|-------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第335 | 200,000,000 | 201,622,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第336 | 120,000,000 | 121,122,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第337 | 100,000,000 | 100,612,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第338 | 180,000,000 | 181,539,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第339 | 150,000,000 | 151,440,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第340 | 60,000,000 | 60,645,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第341 | 200,000,000 | 201,830,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第342 | 230,000,000 | 230,952,200 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第343 | 200,000,000 | 200,840,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第344 | 210,000,000 | 210,882,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第345 | 240,000,000 | 240,952,800 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第346 | 270,000,000 | 270,988,200 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第347 | 220,000,000 | 220,631,400 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第348 | 160,000,000 | 160,312,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第349 | 180,000,000 | 180,163,800 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第350 | 220,000,000 | 219,892,200 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第351 | 180,000,000 | 179,771,400 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第352 | 170,000,000 | 169,682,100 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第353 | 80,000,000 | 79,799,200 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第354 | 80,000,000 | 79,744,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第355 | 100,000,000 | 99,606,000 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第356 | 90,000,000 | 89,575,200 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第357 | 210,000,000 | 208,832,400 | |
| 国庫債券 回 | 利付（10年）第358 | 180,000,000 | 178,781,400 | |

| | | |
|-------------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 利付（10年）第359回 | 210,000,000 | 208,162,500 |
| 国庫債券 利付（10年）第360回 | 220,000,000 | 217,692,200 |
| 国庫債券 利付（10年）第361回 | 220,000,000 | 217,291,800 |
| 国庫債券 利付（10年）第362回 | 200,000,000 | 197,156,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第363回 | 200,000,000 | 196,832,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第364回 | 200,000,000 | 196,576,000 |
| 国庫債券 利付（10年）第365回 | 240,000,000 | 235,574,400 |
| 国庫債券 利付（10年）第366回 | 170,000,000 | 168,097,700 |
| 国庫債券 利付（10年）第369回 | 230,000,000 | 232,773,800 |
| 国庫債券 利付（10年）第370回 | 70,000,000 | 70,596,400 |
| 国庫債券 利付（30年）第1回 | 30,000,000 | 34,976,400 |
| 国庫債券 利付（30年）第3回 | 30,000,000 | 34,352,100 |
| 国庫債券 利付（30年）第4回 | 30,000,000 | 35,901,300 |
| 国庫債券 利付（30年）第6回 | 20,000,000 | 23,512,200 |
| 国庫債券 利付（30年）第8回 | 20,000,000 | 22,644,200 |
| 国庫債券 利付（30年）第9回 | 20,000,000 | 21,901,600 |
| 国庫債券 利付（30年）第10回 | 30,000,000 | 31,976,100 |
| 国庫債券 利付（30年）第11回 | 40,000,000 | 44,986,800 |
| 国庫債券 利付（30年）第12回 | 30,000,000 | 34,969,500 |
| 国庫債券 利付（30年）第13回 | 60,000,000 | 69,418,200 |
| 国庫債券 利付（30年）第14回 | 70,000,000 | 84,042,700 |
| 国庫債券 利付（30年）第15回 | 80,000,000 | 97,095,200 |
| 国庫債券 利付（30年）第16回 | 70,000,000 | 85,142,400 |
| 国庫債券 利付（30年）第17回 | 70,000,000 | 84,501,900 |
| 国庫債券 利付（30年）第18回 | 60,000,000 | 71,847,600 |
| 国庫債券 利付（30年）第19回 | 70,000,000 | 83,955,200 |
| 国庫債券 利付（30年）第20回 | 60,000,000 | 73,499,400 |
| 国庫債券 利付（30年）第21回 | 40,000,000 | 48,113,200 |
| 国庫債券 利付（30年）第22回 | 30,000,000 | 36,891,900 |
| 国庫債券 利付（30年）第23回 | 40,000,000 | 49,266,400 |
| 国庫債券 利付（30年）第24回 | 20,000,000 | 24,670,000 |

| | | | |
|------------------|-------------|-------------|--|
| 国庫債券 利付（30年）第25回 | 50,000,000 | 60,505,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第26回 | 70,000,000 | 85,736,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第27回 | 70,000,000 | 86,895,900 | |
| 国庫債券 利付（30年）第28回 | 100,000,000 | 124,391,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第29回 | 110,000,000 | 135,467,200 | |
| 国庫債券 利付（30年）第30回 | 110,000,000 | 134,068,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第31回 | 120,000,000 | 144,514,800 | |
| 国庫債券 利付（30年）第32回 | 130,000,000 | 158,611,700 | |
| 国庫債券 利付（30年）第33回 | 140,000,000 | 164,232,600 | |
| 国庫債券 利付（30年）第34回 | 130,000,000 | 156,722,800 | |
| 国庫債券 利付（30年）第35回 | 130,000,000 | 152,532,900 | |
| 国庫債券 利付（30年）第36回 | 120,000,000 | 140,826,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第37回 | 100,000,000 | 115,630,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第38回 | 70,000,000 | 79,673,300 | |
| 国庫債券 利付（30年）第39回 | 80,000,000 | 92,441,600 | |
| 国庫債券 利付（30年）第40回 | 60,000,000 | 68,235,600 | |
| 国庫債券 利付（30年）第41回 | 70,000,000 | 78,306,200 | |
| 国庫債券 利付（30年）第42回 | 60,000,000 | 67,132,200 | |
| 国庫債券 利付（30年）第43回 | 60,000,000 | 67,144,800 | |
| 国庫債券 利付（30年）第44回 | 70,000,000 | 78,348,900 | |
| 国庫債券 利付（30年）第45回 | 60,000,000 | 64,812,600 | |
| 国庫債券 利付（30年）第46回 | 90,000,000 | 97,199,100 | |
| 国庫債券 利付（30年）第47回 | 60,000,000 | 65,921,400 | |
| 国庫債券 利付（30年）第48回 | 60,000,000 | 63,515,400 | |
| 国庫債券 利付（30年）第49回 | 70,000,000 | 74,070,500 | |
| 国庫債券 利付（30年）第50回 | 60,000,000 | 56,199,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第51回 | 30,000,000 | 25,001,700 | |
| 国庫債券 利付（30年）第52回 | 60,000,000 | 52,288,200 | |
| 国庫債券 利付（30年）第53回 | 30,000,000 | 26,688,300 | |
| 国庫債券 利付（30年）第54回 | 50,000,000 | 46,462,500 | |
| 国庫債券 利付（30年）第55回 | 60,000,000 | 55,615,800 | |
| 国庫債券 利付（30年）第56回 | 60,000,000 | 55,475,400 | |
| 国庫債券 利付（30年）第57回 | 50,000,000 | 46,112,000 | |
| 国庫債券 利付（30年）第58回 | 80,000,000 | 73,520,800 | |
| 国庫債券 利付（30年）第59回 | 50,000,000 | 44,744,000 | |

| | | | |
|------|-------------|------------|------------|
| 国庫債券 | 利付（30年）第60回 | 70,000,000 | 65,471,000 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第61回 | 40,000,000 | 35,524,800 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第62回 | 30,000,000 | 25,209,000 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第63回 | 40,000,000 | 32,569,600 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第64回 | 40,000,000 | 32,454,000 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第65回 | 30,000,000 | 24,301,200 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第66回 | 60,000,000 | 48,336,000 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第67回 | 80,000,000 | 67,822,400 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第68回 | 70,000,000 | 59,213,700 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第69回 | 60,000,000 | 52,050,600 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第70回 | 70,000,000 | 60,604,600 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第71回 | 60,000,000 | 51,894,000 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第72回 | 60,000,000 | 51,841,800 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第73回 | 50,000,000 | 43,158,500 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第74回 | 70,000,000 | 65,387,000 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第75回 | 70,000,000 | 70,371,000 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第76回 | 60,000,000 | 61,800,000 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第77回 | 70,000,000 | 75,539,100 |
| 国庫債券 | 利付（30年）第78回 | 20,000,000 | 20,607,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第71回 | 10,000,000 | 10,257,100 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第72回 | 20,000,000 | 20,598,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第73回 | 10,000,000 | 10,335,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第74回 | 10,000,000 | 10,351,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第75回 | 40,000,000 | 41,606,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第76回 | 37,000,000 | 38,348,280 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第77回 | 35,000,000 | 36,340,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第78回 | 10,000,000 | 10,412,900 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第79回 | 10,000,000 | 10,434,000 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第80回 | 10,000,000 | 10,455,100 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第81回 | 10,000,000 | 10,485,900 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第82回 | 15,000,000 | 15,764,250 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第83回 | 15,000,000 | 15,843,000 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第84回 | 50,000,000 | 52,679,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第85回 | 13,000,000 | 13,797,810 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第86回 | 10,000,000 | 10,670,900 |

| | | | |
|------|--------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 | 利付（20年）第88回 | 20,000,000 | 21,453,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第90回 | 20,000,000 | 21,497,000 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第91回 | 10,000,000 | 10,782,200 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第92回 | 30,000,000 | 32,286,300 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第93回 | 70,000,000 | 75,385,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第94回 | 70,000,000 | 75,655,300 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第95回 | 90,000,000 | 98,385,300 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第96回 | 85,000,000 | 92,221,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第97回 | 50,000,000 | 54,666,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第98回 | 60,000,000 | 65,338,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第99回 | 110,000,000 | 120,235,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第100回 | 70,000,000 | 77,086,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第101回 | 70,000,000 | 77,763,700 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第102回 | 60,000,000 | 66,946,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第103回 | 35,000,000 | 38,874,850 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第104回 | 10,000,000 | 11,005,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第105回 | 60,000,000 | 66,293,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第106回 | 60,000,000 | 66,612,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第107回 | 50,000,000 | 55,455,500 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第108回 | 50,000,000 | 54,899,000 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第109回 | 60,000,000 | 66,096,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第110回 | 40,000,000 | 44,528,800 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第111回 | 10,000,000 | 11,237,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第112回 | 85,000,000 | 95,005,350 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第113回 | 60,000,000 | 67,308,600 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第114回 | 80,000,000 | 90,064,000 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第115回 | 60,000,000 | 67,940,400 |
| 国庫債券 | 利付（20年）第116回 | 70,000,000 | 79,524,200 |

| | | | |
|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第117 | 70,000,000 | 79,050,300 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第118 | 40,000,000 | 44,999,600 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第119 | 50,000,000 | 55,549,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第120 | 70,000,000 | 76,788,600 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第121 | 70,000,000 | 78,462,300 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第122 | 40,000,000 | 44,546,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第123 | 70,000,000 | 79,671,900 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第124 | 40,000,000 | 45,228,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第125 | 40,000,000 | 45,957,600 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第126 | 30,000,000 | 33,993,300 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第127 | 30,000,000 | 33,762,300 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第128 | 80,000,000 | 90,276,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第129 | 20,000,000 | 22,410,400 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第130 | 50,000,000 | 56,163,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第133 | 50,000,000 | 56,295,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第140 | 100,000,000 | 112,186,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第141 | 80,000,000 | 89,874,400 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第143 | 70,000,000 | 78,003,100 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第144 | 50,000,000 | 55,242,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第145 | 120,000,000 | 134,960,400 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第146 | 120,000,000 | 135,050,400 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第147 | 130,000,000 | 145,065,700 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第148 | 130,000,000 | 143,757,900 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第149 | 140,000,000 | 154,816,200 |

| | | | |
|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第150 | 150,000,000 | 164,248,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第151 | 150,000,000 | 160,816,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第152 | 130,000,000 | 139,327,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第153 | 130,000,000 | 140,749,700 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第154 | 110,000,000 | 117,730,800 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第155 | 110,000,000 | 115,022,600 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第156 | 30,000,000 | 29,127,300 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第157 | 30,000,000 | 28,300,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第158 | 50,000,000 | 48,927,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第159 | 30,000,000 | 29,682,300 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第160 | 30,000,000 | 30,018,900 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第161 | 30,000,000 | 29,557,800 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第162 | 40,000,000 | 39,298,400 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第163 | 50,000,000 | 49,012,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第164 | 60,000,000 | 57,801,600 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第165 | 50,000,000 | 48,010,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第166 | 50,000,000 | 49,315,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第167 | 50,000,000 | 47,719,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第168 | 50,000,000 | 46,823,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第169 | 50,000,000 | 45,908,000 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第170 | 50,000,000 | 45,721,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第171 | 60,000,000 | 54,679,200 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第172 | 50,000,000 | 46,171,500 |
| 国庫債券 回 | 利付（20年）第173 | 70,000,000 | 64,381,100 |

| | | | | | |
|--|----|-------------------------|----------------|--------------------------|--|
| | | 国庫債券 利付（20年）第174回 | 70,000,000 | 64,166,200 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第175回 | 70,000,000 | 65,051,000 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第176回 | 80,000,000 | 74,107,200 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第177回 | 80,000,000 | 72,584,000 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第178回 | 60,000,000 | 55,302,600 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第179回 | 80,000,000 | 73,550,400 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第180回 | 60,000,000 | 58,050,000 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第181回 | 60,000,000 | 58,989,600 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第182回 | 60,000,000 | 60,973,200 | |
| | | 国庫債券 利付（20年）第183回 | 80,000,000 | 85,386,400 | |
| | 小計 | 銘柄数：245 組入時価比率：99.5% | 21,240,000,000 | 21,985,738,140 100.0% | |
| | 合計 | | | 21,985,738,140 | |

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2023年5月10日現在)

| | |
|----------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 3,149,992,895 |
| コール・ローン | 1,259,583,058 |
| 国債証券 | 706,124,283,352 |
| 派生商品評価勘定 | 667,082 |
| 未収入金 | 34,818,018 |
| 未収利息 | 6,443,871,991 |
| 前払費用 | 2,010,960,274 |
| その他未収収益 | 18,404,631 |
| 流動資産合計 | 719,042,581,301 |
| 資産合計 | 719,042,581,301 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |

| | |
|-----------------|-----------------|
| 派生商品評価勘定 | 644,060 |
| 未払金 | 3,690,557,809 |
| 未払解約金 | 512,882,392 |
| 未払利息 | 2,064 |
| その他未払費用 | 9,123,111 |
| 流動負債合計 | 4,213,209,436 |
| 負債合計 | 4,213,209,436 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 275,585,073,380 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 439,244,298,485 |
| 元本等合計 | 714,829,371,865 |
| 純資産合計 | 714,829,371,865 |
| 負債純資産合計 | 719,042,581,301 |

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 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</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 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。</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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p> |

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はありません。

(貸借対照表に関する注記)

| 2023年5月10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 | 2,5939円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (25,939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 | 149,071,623,219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 | 155,706,355,390円 |
| なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。 | |

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

| 自 2022 年 5 月 11 日 至 2023 年 5 月 10 日 | |
|--|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。 |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| 2023 年 5 月 10 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 | <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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023 年 5 月 10 日現在 | |
|----------------------------------|-------------------|
| 期首 | 2022 年 5 月 11 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 | 251,351,016,828 円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 54,342,500,129 円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 30,108,443,577 円 |
| 期末元本額 | 275,585,073,380 円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト 3 0 | 79,262,729 円 |
| バランスセレクト 5 0 | 82,230,109 円 |
| バランスセレクト 7 0 | 82,947,320 円 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 261,113,906 円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (安定コース) | 3,552,378,284 円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (分配コース) | 23,117,178,913 円 |
| 野村世界 6 資産分散投信 (成長コース) | 2,315,482,591 円 |
| 野村資産設計ファンド 2 0 1 5 | 21,532,024 円 |
| 野村資産設計ファンド 2 0 2 0 | 23,546,154 円 |
| 野村資産設計ファンド 2 0 2 5 | 39,046,229 円 |
| 野村資産設計ファンド 2 0 3 0 | 51,461,719 円 |
| 野村資産設計ファンド 2 0 3 5 | 41,214,731 円 |
| 野村資産設計ファンド 2 0 4 0 | 64,715,748 円 |

| | |
|---|------------------|
| 野村外国債券インデックス Bコース (野村投資一任口座向け) | 75,552,886,410 円 |
| のむラップ・ファンド (保守型) | 6,196,136,484 円 |
| のむラップ・ファンド (普通型) | 27,849,844,361 円 |
| のむラップ・ファンド (積極型) | 8,327,122,794 円 |
| 野村外国債券インデックス (野村SMA向け) | 406,617,499 円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 12,419,221 円 |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 1,044,919,335 円 |
| マイ・ロード | 7,668,985,679 円 |
| ネクストコア | 90,952,529 円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 344,790,082 円 |
| 野村外国債券インデックスBコース (野村SMA・EW向け) | 8,234,248,955 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (配分変更コース) | 1,226,860,841 円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 11,045,992 円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 4,457,658 円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 3,020,497 円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,913,625 円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 1,607,818 円 |
| のむラップ・ファンド (やや保守型) | 957,786,657 円 |
| のむラップ・ファンド (やや積極型) | 1,398,700,246 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプI) | 3,647,577 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプII) | 2,848,300 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプIII) | 9,526,478 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプIV) | 2,235,351 円 |
| インデックス・ブレンド (タイプV) | 9,663,123 円 |
| 野村6資産均等バランス | 3,332,169,758 円 |
| 野村外国債券 (含む新興国) インデックス Bコース (野村投資一任口座向け) | 7,240,735,132 円 |
| 世界6資産分散ファンド | 73,994,071 円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 5,928,237 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 | 12,124,394,438 円 |
| ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 外国債券 | 8,237,294,062 円 |
| 野村外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用) | 6,169,122 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) | 937,689,579 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) | 172,478,084 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) | 947,789,131 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) | 358,921,025 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) | 1,333,126 円 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型 (適格機関投資家専用) | 8,244,098 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) | 72,103 円 |
| 野村インデックス・バランス60VA (適格機関投資家専用) | 2,551,691,383 円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA (適格機関投資家専用) | 4,370,072 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) | 20,859,850 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) | 7,130,958 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) | 164,116,691 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) | 131,101,540 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) | 1,870,167,317 円 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 60,839,499 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) | 894,278,826 円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券 (適格機関投資家専用) | 1,958,865,680 円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 5,581,439 円 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 3,763,786 円 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | 7,966,731 円 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 6,307,778 円 |
| 野村外国債券パッシブファンド (確定拠出年金向け) | 624,859,930 円 |
| マイバランス30 (確定拠出年金向け) | 5,489,406,567 円 |

| | |
|---------------------------------|------------------|
| マイバランス50 (確定拠出年金向け) | 7,134,710,046 円 |
| マイバランス70 (確定拠出年金向け) | 5,774,314,492 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) | 24,016,890,219 円 |
| マイバランスDC30 | 2,339,740,110 円 |
| マイバランスDC50 | 1,818,604,536 円 |
| マイバランスDC70 | 1,383,015,306 円 |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 9,841,509,719 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 3,380,806,281 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 398,441,520 円 |
| マイターゲット2050 (確定拠出年金向け) | 405,205,624 円 |
| マイターゲット2030 (確定拠出年金向け) | 964,192,736 円 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け) | 397,897,777 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 25,720,298 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 61,669,590 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 30,075,093 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030 | 23,511,133 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 17,158,894 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 8,694,906 円 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け) | 337,493,824 円 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け) | 182,821,661 円 |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け) | 112,869,752 円 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け) | 140,993,698 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 4,552,920 円 |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け) | 50,223,732 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) | 62,186,053 円 |
| みらいバランス・株式10 (富士通企業年金基金DC向け) | 279,099,898 円 |
| 野村DCバランスファンド (年金運用戦略タイプ) | 49,805,580 円 |

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2023年5月10日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2023年5月10日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|-----|------------------|---------------|---------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY BOND | 63,000,000.00 | 61,335,174.60 | |
| | | US TREASURY BOND | 74,200,000.00 | 78,515,768.80 | |
| | | US TREASURY BOND | 48,200,000.00 | 53,362,668.26 | |
| | | US TREASURY BOND | 88,750,000.00 | 96,227,879.75 | |
| | | US TREASURY BOND | 100,000.00 | 108,498.04 | |
| | | US TREASURY BOND | 100,000.00 | 85,062.50 | |
| | | US TREASURY BOND | 200,000.00 | 194,687.50 | |
| | | US TREASURY N/B | 2,700,000.00 | 2,629,460.07 | |
| | | US TREASURY N/B | 700,000.00 | 683,051.74 | |
| | | US TREASURY N/B | 3,800,000.00 | 3,717,050.18 | |

| | | |
|-----------------|---------------|---------------|
| US TREASURY N/B | 89,100,000.00 | 87,123,895.65 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 95,559.41 |
| US TREASURY N/B | 18,400,000.00 | 17,885,574.64 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 293,159.55 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 95,289.06 |
| US TREASURY N/B | 34,100,000.00 | 33,096,979.19 |
| US TREASURY N/B | 4,450,000.00 | 4,307,286.72 |
| US TREASURY N/B | 27,800,000.00 | 27,283,092.36 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 95,185.54 |
| US TREASURY N/B | 4,300,000.00 | 4,174,694.99 |
| US TREASURY N/B | 1,200,000.00 | 1,159,664.03 |
| US TREASURY N/B | 22,000,000.00 | 21,583,201.20 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 94,917.96 |
| US TREASURY N/B | 5,050,000.00 | 4,881,337.57 |
| US TREASURY N/B | 10,000,000.00 | 9,591,601.00 |
| US TREASURY N/B | 15,400,000.00 | 15,154,862.80 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 94,708.98 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 96,937.50 |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00 | 2,018,050.65 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 94,794.92 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 290,958.96 |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 479,648.40 |
| US TREASURY N/B | 33,000,000.00 | 32,994,198.60 |
| US TREASURY N/B | 150,000.00 | 145,403.31 |
| US TREASURY N/B | 5,500,000.00 | 5,212,109.10 |
| US TREASURY N/B | 1,150,000.00 | 1,112,692.27 |
| US TREASURY N/B | 2,400,000.00 | 2,299,593.60 |
| US TREASURY N/B | 8,800,000.00 | 8,820,452.96 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 189,910.14 |
| US TREASURY N/B | 1,900,000.00 | 1,839,659.99 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 96,039.06 |
| US TREASURY N/B | 7,000,000.00 | 6,647,812.50 |
| US TREASURY N/B | 3,700,000.00 | 3,595,792.83 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 285,996.09 |
| US TREASURY N/B | 3,400,000.00 | 3,394,355.32 |

| | | |
|-----------------|---------------|---------------|
| US TREASURY N/B | 25,100,000.00 | 24,176,887.26 |
| US TREASURY N/B | 13,200,000.00 | 12,597,233.88 |
| US TREASURY N/B | 2,700,000.00 | 2,635,083.90 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 284,343.75 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 95,792.96 |
| US TREASURY N/B | 6,700,000.00 | 6,523,208.44 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 93,570.31 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 97,304.68 |
| US TREASURY N/B | 48,800,000.00 | 47,697,232.24 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 93,082.03 |
| US TREASURY N/B | 11,150,000.00 | 10,736,230.19 |
| US TREASURY N/B | 14,100,000.00 | 13,750,803.63 |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 977,246.00 |
| US TREASURY N/B | 6,100,000.00 | 5,650,243.95 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 97,765.62 |
| US TREASURY N/B | 4,200,000.00 | 4,093,933.20 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 185,078.12 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 293,917.95 |
| US TREASURY N/B | 5,200,000.00 | 5,082,491.96 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 92,222.65 |
| US TREASURY N/B | 36,750,000.00 | 35,219,704.27 |
| US TREASURY N/B | 50,700,000.00 | 49,413,685.23 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 183,976.56 |
| US TREASURY N/B | 48,500,000.00 | 47,513,893.15 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 183,875.00 |
| US TREASURY N/B | 450,000.00 | 453,708.94 |
| US TREASURY N/B | 12,100,000.00 | 11,852,563.47 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 183,171.86 |
| US TREASURY N/B | 51,300,000.00 | 49,342,181.67 |
| US TREASURY N/B | 18,500,000.00 | 18,783,642.00 |
| US TREASURY N/B | 13,200,000.00 | 12,891,397.20 |
| US TREASURY N/B | 40,200,000.00 | 36,847,380.30 |
| US TREASURY N/B | 25,020,000.00 | 24,277,218.75 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 183,195.30 |
| US TREASURY N/B | 18,100,000.00 | 17,556,292.29 |

| | | |
|-----------------|---------------|---------------|
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 91,253.90 |
| US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 1,887,929.60 |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 966,425.70 |
| US TREASURY N/B | 8,500,000.00 | 7,767,538.85 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 204,796.86 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 95,986.32 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 184,011.70 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 96,234.37 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 275,068.35 |
| US TREASURY N/B | 1,800,000.00 | 1,693,089.72 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 286,318.35 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 91,494.14 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 94,638.67 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 275,320.29 |
| US TREASURY N/B | 7,800,000.00 | 7,371,609.18 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 90,779.29 |
| US TREASURY N/B | 33,300,000.00 | 31,071,111.12 |
| US TREASURY N/B | 7,300,000.00 | 6,778,591.66 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 90,943.35 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 93,556.64 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 273,626.94 |
| US TREASURY N/B | 5,600,000.00 | 5,233,921.84 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 275,414.04 |
| US TREASURY N/B | 13,300,000.00 | 12,579,669.34 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 93,341.79 |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 460,371.05 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 93,646.48 |
| US TREASURY N/B | 54,200,000.00 | 49,822,710.44 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 185,281.24 |
| US TREASURY N/B | 24,050,000.00 | 22,899,637.99 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 91,298.82 |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00 | 1,970,472.63 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 89,310.54 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 96,003.90 |
| US TREASURY N/B | 37,000,000.00 | 32,784,745.40 |

| | | |
|-----------------|---------------|---------------|
| US TREASURY N/B | 350,000.00 | 338,953.12 |
| US TREASURY N/B | 17,500,000.00 | 16,709,423.50 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 176,777.34 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 96,339.84 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 264,568.35 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 296,039.04 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 87,521.48 |
| US TREASURY N/B | 1,400,000.00 | 1,354,363.22 |
| US TREASURY N/B | 18,400,000.00 | 17,448,732.88 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 87,802.73 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 98,224.60 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 87,103.51 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 262,177.71 |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 945,644.50 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 263,279.28 |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 437,832.00 |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 439,609.35 |
| US TREASURY N/B | 52,800,000.00 | 50,968,500.00 |
| US TREASURY N/B | 60,100,000.00 | 53,727,284.48 |
| US TREASURY N/B | 1,500,000.00 | 1,346,484.30 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 89,617.18 |
| US TREASURY N/B | 53,600,000.00 | 51,956,404.24 |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 447,363.25 |
| US TREASURY N/B | 16,400,000.00 | 14,645,967.52 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 87,953.12 |
| US TREASURY N/B | 16,150,000.00 | 15,639,002.69 |
| US TREASURY N/B | 10,100,000.00 | 8,924,296.37 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 88,761.71 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 267,714.84 |
| US TREASURY N/B | 66,200,000.00 | 64,790,661.58 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 89,714.84 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 89,056.64 |
| US TREASURY N/B | 2,200,000.00 | 1,996,199.04 |
| US TREASURY N/B | 37,350,000.00 | 35,556,904.93 |
| US TREASURY N/B | 18,000,000.00 | 16,433,436.60 |

| | | |
|-----------------|---------------|----------------|
| US TREASURY N/B | 8,100,000.00 | 7,596,597.15 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 96,373.04 |
| US TREASURY N/B | 28,900,000.00 | 27,081,331.67 |
| US TREASURY N/B | 2,100,000.00 | 2,009,191.38 |
| US TREASURY N/B | 3,300,000.00 | 3,244,827.96 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 94,898.43 |
| US TREASURY N/B | 300,000.00 | 268,757.79 |
| US TREASURY N/B | 41,000,000.00 | 40,027,849.00 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 90,173.82 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 83,187.50 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 176,140.62 |
| US TREASURY N/B | 50,000,000.00 | 51,421,875.00 |
| US TREASURY N/B | 50,000,000.00 | 50,351,560.00 |
| US TREASURY N/B | 86,200,000.00 | 100,845,578.25 |
| US TREASURY N/B | 400,000.00 | 329,210.92 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 81,835.93 |
| US TREASURY N/B | 82,500,000.00 | 93,115,423.50 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 84,597.65 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 87,255.85 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 84,140.62 |
| US TREASURY N/B | 150,000.00 | 126,846.67 |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 439,072.25 |
| US TREASURY N/B | 26,200,000.00 | 24,907,907.70 |
| US TREASURY N/B | 800,000.00 | 751,374.96 |
| US TREASURY N/B | 84,500,000.00 | 88,526,948.90 |
| US TREASURY N/B | 9,500,000.00 | 9,478,475.85 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 110,419.92 |
| US TREASURY N/B | 6,850,000.00 | 7,922,051.71 |
| US TREASURY N/B | 14,100,000.00 | 15,481,909.98 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 97,779.29 |
| US TREASURY N/B | 1,100,000.00 | 1,173,433.58 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 109,746.09 |
| US TREASURY N/B | 22,100,000.00 | 23,847,281.25 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 111,179.68 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 107,808.59 |

| | | |
|-----------------|---------------|---------------|
| US TREASURY N/B | 6,400,000.00 | 4,200,249.60 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 101,128.90 |
| US TREASURY N/B | 4,100,000.00 | 2,667,482.14 |
| US TREASURY N/B | 3,400,000.00 | 3,602,273.14 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 67,748.04 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 112,486.32 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 147,140.62 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 107,308.59 |
| US TREASURY N/B | 5,600,000.00 | 4,374,671.84 |
| US TREASURY N/B | 7,500,000.00 | 7,376,073.75 |
| US TREASURY N/B | 13,300,000.00 | 9,474,430.56 |
| US TREASURY N/B | 1,400,000.00 | 1,256,800.72 |
| US TREASURY N/B | 9,300,000.00 | 6,906,339.03 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 89,539.06 |
| US TREASURY N/B | 600,000.00 | 474,152.34 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 87,558.59 |
| US TREASURY N/B | 500,000.00 | 454,414.05 |
| US TREASURY N/B | 200,000.00 | 167,742.18 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 92,406.25 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 83,628.90 |
| US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 1,011,250.00 |
| US TREASURY N/B | 1,190,000.00 | 1,055,288.19 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 95,664.06 |
| US TREASURY N/B | 100,000.00 | 95,242.18 |
| US TREASURY N/B | 8,000,000.00 | 7,322,812.00 |
| US TREASURY N/B | 39,450,000.00 | 34,614,290.01 |
| US TREASURY N/B | 44,800,000.00 | 38,412,496.64 |
| US TREASURY N/B | 47,200,000.00 | 36,969,027.12 |
| US TREASURY N/B | 22,900,000.00 | 19,570,552.97 |
| US TREASURY N/B | 17,500,000.00 | 14,609,080.50 |
| US TREASURY N/B | 3,200,000.00 | 2,729,499.84 |
| US TREASURY N/B | 49,700,000.00 | 38,612,625.80 |
| US TREASURY N/B | 28,200,000.00 | 21,891,349.80 |
| US TREASURY N/B | 36,500,000.00 | 26,893,083.20 |
| US TREASURY N/B | 14,200,000.00 | 11,814,287.82 |

| | | | | |
|-------|---------------------|------------------|-------------------|--|
| | US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 1,699,375.00 | |
| | US TREASURY N/B | 2,000,000.00 | 1,698,671.80 | |
| | US TREASURY N/B | 11,400,000.00 | 9,238,897.44 | |
| | US TREASURY N/B | 6,300,000.00 | 5,106,937.50 | |
| | US TREASURY N/B | 100,000.00 | 84,949.21 | |
| | US TREASURY N/B | 100,000.00 | 86,953.12 | |
| | US TREASURY N/B | 500,000.00 | 424,941.40 | |
| | US TREASURY N/B | 2,100,000.00 | 1,913,214.66 | |
| | US TREASURY N/B | 470,000.00 | 400,399.58 | |
| | US TREASURY N/B | 100,000.00 | 83,246.09 | |
| | US TREASURY N/B | 250,000.00 | 182,421.87 | |
| | US TREASURY N/B | 300,000.00 | 224,894.52 | |
| | US TREASURY N/B | 1,000,000.00 | 686,367.10 | |
| | US TREASURY N/B | 47,900,000.00 | 26,861,419.48 | |
| | US TREASURY N/B | 52,200,000.00 | 30,220,944.66 | |
| | US TREASURY N/B | 32,600,000.00 | 20,178,888.18 | |
| | US TREASURY N/B | 25,800,000.00 | 17,026,991.22 | |
| | US TREASURY N/B | 45,850,000.00 | 34,059,741.27 | |
| | US TREASURY N/B | 1,400,000.00 | 950,250.00 | |
| | US TREASURY N/B | 100,000.00 | 65,656.25 | |
| | US TREASURY N/B | 100,000.00 | 72,031.25 | |
| | US TREASURY N/B | 100,000.00 | 82,804.68 | |
| | US TREASURY N/B | 200,000.00 | 170,000.00 | |
| 小計 | 銘柄数：243 | 2,739,730,000.00 | 2,576,043,306.81 | |
| | | | (348,152,252,915) | |
| | 組入時価比率：48.7% | | 49.2% | |
| カナダドル | CANADIAN GOVERNMENT | 5,500,000.00 | 5,403,062.50 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1,250,000.00 | 1,231,802.50 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1,600,000.00 | 1,596,417.60 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 34,500,000.00 | 32,983,380.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00 | 95,827.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4,500,000.00 | 4,374,243.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2,100,000.00 | 1,954,606.50 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1,600,000.00 | 1,577,321.60 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 350,000.00 | 320,170.20 | |

| | | | | |
|--------|-------------------------|----------------|------------------|--|
| | CANADIAN GOVERNMENT | 300,000.00 | 284,305.20 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 13,800,000.00 | 12,818,516.40 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00 | 93,026.80 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 200,000.00 | 184,357.60 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 300,000.00 | 295,278.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 800,000.00 | 815,015.20 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 250,000.00 | 238,883.50 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 15,430,000.00 | 17,831,293.75 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00 | 96,433.90 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 300,000.00 | 288,588.30 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 1,788,068.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5,950,000.00 | 5,342,397.90 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00 | 89,251.20 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 100,000.00 | 92,567.20 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 900,000.00 | 866,365.20 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 16,900,000.00 | 20,962,709.30 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5,040,000.00 | 6,124,340.88 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 500,000.00 | 558,690.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 9,400,000.00 | 9,948,490.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 600,000.00 | 561,278.40 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 15,600,000.00 | 12,341,659.20 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1,100,000.00 | 810,788.00 | |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2,700,000.00 | 2,478,964.50 | |
| 小計 | 銘柄数：32 | 143,970,000.00 | 144,448,099.33 | |
| | | | (14,587,813,551) | |
| | 組入時価比率：2.0% | | 2.1% | |
| メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT | 78,500,000.00 | 75,781,152.50 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 51,500,000.00 | 50,965,466.05 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 94,000,000.00 | 85,812,600.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 118,000,000.00 | 107,150,501.80 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 27,000,000.00 | 23,902,020.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 110,800,000.00 | 105,122,608.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 77,300,000.00 | 76,356,167.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 106,600,000.00 | 100,373,494.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 400,000.00 | 370,584.00 | |

| | | | | |
|--------------------------|---------------------------|----------------|---|--|
| 小計 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 53,300,000.00 | 58,499,948.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 59,600,000.00 | 57,093,820.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 68,200,000.00 | 60,009,862.00 | |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 54,000,000.00 | 48,600,000.00 | |
| | 銘柄数 : 13 組入時価比率 : 0.9% | 899,200,000.00 | 850,038,223.35 (6,472,361,040) 0.9% | |
| ユーク | BELGIUM KINGDOM | 9,830,000.00 | 9,784,782.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 9,400,000.00 | 9,113,300.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 600,000.00 | 577,191.48 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 9,600,000.00 | 10,091,376.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 100,000.00 | 95,960.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 100,000.00 | 92,955.70 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 1,000,000.00 | 914,253.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 6,500,000.00 | 5,861,362.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 11,400,000.00 | 9,885,088.20 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 7,500,000.00 | 8,111,137.50 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 100,000.00 | 85,490.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 2,800,000.00 | 2,229,180.24 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 100,000.00 | 83,336.70 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 1,000,000.00 | 615,720.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 4,100,000.00 | 4,561,084.36 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 4,000,000.00 | 4,186,468.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 5,550,000.00 | 3,874,116.45 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 3,400,000.00 | 2,350,957.20 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 3,600,000.00 | 2,735,607.60 | |
| | BELGIUM KINGDOM | 2,200,000.00 | 1,589,398.80 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 11,500,000.00 | 13,013,009.00 | |
| | BELGIUM KINGDOM GOVT | 10,500,000.00 | 12,366,049.50 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 600,000.00 | 604,200.00 | |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 9,300,000.00 | 9,269,719.20 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 97,517.00 | | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 24,300,000.00 | 22,889,122.56 | | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2,450,000.00 | 2,541,122.85 | | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 98,373.50 | | |

| | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 92,710.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 97,352.69 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 28,100,000.00 | 27,966,069.78 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 20,050,000.00 | 21,850,169.20 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 94,829.19 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 94,685.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 91,395.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 300,000.00 | 281,481.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 87,095.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 92,773.60 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 6,250,000.00 | 5,770,000.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 34,150,000.00 | 37,698,185.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 91,442.70 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 500,000.00 | 434,950.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,200,000.00 | 3,877,662.60 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,200,000.00 | 6,727,867.20 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5,400,000.00 | 4,897,800.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 83,058.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 68,388.50 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,900,000.00 | 2,154,286.50 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 11,200,000.00 | 12,410,137.60 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 500,000.00 | 464,799.60 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 13,000,000.00 | 15,288,845.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 84,709.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 100,000.00 | 80,028.00 | |
| BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 13,700,000.00 | 12,040,039.50 | |
| BUNDESobligation | 100,000.00 | 96,118.00 | |
| BUNDESobligation | 200,000.00 | 186,484.00 | |
| BUNDESobligation | 150,000.00 | 138,489.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 600,000.00 | 591,936.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 97,796.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 96,371.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,700,000.00 | 7,438,431.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 94,838.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 92,658.00 | |

| | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 92,682.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 31,300,000.00 | 36,428,818.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 200,000.00 | 185,762.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 19,300,000.00 | 22,133,047.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 600,000.00 | 552,918.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 10,700,000.00 | 11,989,564.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 90,128.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 89,319.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 98,975.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 19,550,000.00 | 24,326,260.50 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 37,100,000.00 | 45,405,577.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 17,800,000.00 | 21,898,111.80 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 16,700,000.00 | 19,602,309.70 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 33,600,000.00 | 27,232,128.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 7,700,000.00 | 9,437,897.70 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,800,000.00 | 3,657,158.40 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,730,000.00 | 3,021,643.17 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 700,000.00 | 698,603.50 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 100,000.00 | 100,362.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 200,000.00 | 155,224.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3,500,000.00 | 1,725,325.00 | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 17,900,000.00 | 15,193,878.00 | |
| BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 10,800,000.00 | 10,708,092.00 | |
| BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 23,700,000.00 | 23,627,004.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,200,000.00 | 1,181,976.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,900,000.00 | 1,865,344.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,300,000.00 | 3,321,120.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 97,339.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 98,830.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 95,112.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 35,100,000.00 | 36,129,132.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 13,000,000.00 | 12,999,896.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 96,300.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 96,429.90 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 97,100.00 | |

| | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|--|
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 300,000.00 | 286,080.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 250,000.00 | 245,100.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,000,000.00 | 2,901,600.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 32,350,000.00 | 32,430,875.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 92,519.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 35,500,000.00 | 36,579,200.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 9,800,000.00 | 9,890,591.20 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 800,000.00 | 758,240.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 96,040.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 600,000.00 | 674,580.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 92,800.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 91,350.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00 | 190,300.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00 | 188,600.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,750,000.00 | 4,211,250.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 96,170.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00 | 186,360.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 52,350,000.00 | 51,795,090.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 15,000,000.00 | 15,768,000.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 95,620.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 800,000.00 | 765,520.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 550,000.00 | 596,255.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 45,000,000.00 | 45,063,000.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 97,980.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 84,870.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 20,600,000.00 | 23,438,680.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 150,000.00 | 123,360.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 76,390.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 87,020.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 20,150,000.00 | 22,592,180.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,500,000.00 | 5,580,850.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,400,000.00 | 1,191,400.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 31,300,000.00 | 33,027,760.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 15,700,000.00 | 14,164,540.00 | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 800,000.00 | 771,600.00 | |

| | | | | |
|--|--------------------------|---------------|---------------|--|
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 78,300.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 300,000.00 | 286,230.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 500,000.00 | 431,300.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 100,000.00 | 82,960.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5,000,000.00 | 5,250,000.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 200,000.00 | 166,220.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 12,100,000.00 | 12,701,370.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,800,000.00 | 8,922,320.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,400,000.00 | 2,768,620.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,800,000.00 | 2,335,760.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,800,000.00 | 7,753,680.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 400,000.00 | 268,600.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6,100,000.00 | 5,862,100.00 | |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 8,100,000.00 | 5,427,801.90 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 600,000.00 | 616,530.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 100,000.00 | 96,101.30 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 1,884,922.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 3,300,000.00 | 3,318,295.20 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2,400,000.00 | 2,090,824.80 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1,300,000.00 | 1,107,302.30 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 2,000,000.00 | 1,648,966.00 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 4,500,000.00 | 3,072,391.20 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 400,000.00 | 370,005.20 | |
| | FINNISH GOVERNMENT | 1,000,000.00 | 717,724.10 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 100,130.00 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 95,178.40 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 95,022.50 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 150,000.00 | 143,420.79 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 500,000.00 | 469,139.75 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 45,500,000.00 | 45,234,962.50 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 92,040.50 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 8,000,000.00 | 7,506,952.00 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 5,500,000.00 | 5,037,428.00 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 91,227.60 | |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 90,397.90 | |

| | | | |
|--|---------------------------|---------------|---------------|
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 88,132.20 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 99,740.00 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2,100,000.00 | 1,756,362.30 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 79,930.00 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 82,500.00 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 400,000.00 | 309,006.56 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 200,000.00 | 134,660.80 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 100,000.00 | 52,376.00 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 41,500,000.00 | 21,142,922.00 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 2,000,000.00 | 1,313,528.40 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1,000,000.00 | 992,700.00 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 39,250,000.00 | 42,656,900.00 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 100,000.00 | 95,950.00 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 100,000.00 | 92,944.70 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 100,000.00 | 102,365.00 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 12,900,000.00 | 12,963,855.00 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 51,150,000.00 | 58,998,200.25 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 100,000.00 | 91,242.20 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 32,050,000.00 | 39,653,766.35 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 44,050,000.00 | 51,425,291.50 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 10,300,000.00 | 11,242,225.46 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 14,350,000.00 | 16,675,489.25 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 24,450,000.00 | 24,079,802.55 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 7,650,000.00 | 8,504,818.65 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 840,000.00 | 954,828.00 |
| | IRISH GOVERNMENT | 730,000.00 | 765,094.02 |
| | IRISH GOVERNMENT | 200,000.00 | 184,495.20 |
| | IRISH TSY 1.10% 2029 | 600,000.00 | 551,310.00 |
| | IRISH TSY 1.3% 2033 | 9,100,000.00 | 7,882,492.80 |
| | IRISH TSY 1.35% 2031 | 1,100,000.00 | 997,346.46 |
| | IRISH TSY 1.5% 2050 | 2,900,000.00 | 1,967,742.80 |
| | IRISH TSY 1.7% 2037 | 3,100,000.00 | 2,606,879.90 |
| | IRISH TSY 1% 2026 | 100,000.00 | 95,450.50 |
| | IRISH TSY 2.4% 2030 | 7,500,000.00 | 7,407,480.00 |
| | IRISH TSY 2% 2045 | 1,600,000.00 | 1,277,193.60 |

| | | | | |
|----|------------------------|------------------|---------------------------------------|--|
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00 | 99,130.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 7,800,000.00 | 7,415,977.14 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00 | 93,765.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00 | 93,100.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 12,300,000.00 | 13,887,930.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00 | 91,490.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00 | 86,725.50 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 100,000.00 | 87,098.64 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 11,750,000.00 | 11,596,838.75 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 11,650,000.00 | 13,161,785.55 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4,000,000.00 | 2,647,161.60 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 500,000.00 | 346,028.00 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5,300,000.00 | 5,972,294.40 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3,800,000.00 | 3,782,607.40 | |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3,400,000.00 | 2,863,480.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 800,000.00 | 572,744.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,300,000.00 | 1,257,100.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 700,000.00 | 688,703.40 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 900,000.00 | 853,630.20 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4,600,000.00 | 4,443,002.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 7,900,000.00 | 8,381,900.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,000,000.00 | 1,878,544.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 7,600,000.00 | 8,650,266.80 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 11,600,000.00 | 10,223,660.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 10,350,000.00 | 9,732,922.65 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,200,000.00 | 1,325,632.80 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,400,000.00 | 2,370,434.40 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 7,000,000.00 | 5,026,700.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,000,000.00 | 1,116,496.00 | |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2,650,000.00 | 2,998,392.32 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 34,500,000.00 | 39,815,942.85 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 27,950,000.00 | 33,333,170.00 | |
| | SPANISH GOVERNMENT | 13,250,000.00 | 13,985,814.90 | |
| 小計 | 銘柄数：236 | 1,554,630,000.00 | 1,590,752,611.06 (235,797,259,537) | |

| | | | |
|-------------|----------------|---------------|---------------|
| | 組入時価比率 : 33.0% | | 33.4% |
| 英ポンド | UK TREASURY | 3,350,000.00 | 3,285,468.95 |
| | UK TREASURY | 12,800,000.00 | 11,958,220.80 |
| | UK TREASURY | 120,000.00 | 121,865.61 |
| | UK TREASURY | 200,000.00 | 187,322.00 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 95,741.60 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 93,193.72 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 88,836.00 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 102,140.00 |
| | UK TREASURY | 200,000.00 | 180,142.08 |
| | UK TREASURY | 7,330,000.00 | 8,167,928.95 |
| | UK TREASURY | 9,800,000.00 | 8,152,620.00 |
| | UK TREASURY | 200,000.00 | 168,340.00 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 106,956.00 |
| | UK TREASURY | 160,000.00 | 166,297.92 |
| | UK TREASURY | 16,700,000.00 | 17,622,842.00 |
| | UK TREASURY | 15,430,000.00 | 15,870,680.80 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 75,020.00 |
| | UK TREASURY | 27,750,000.00 | 26,673,300.00 |
| | UK TREASURY | 4,250,000.00 | 4,573,595.00 |
| | UK TREASURY | 19,500,000.00 | 19,755,801.00 |
| | UK TREASURY | 500,000.00 | 505,464.60 |
| | UK TREASURY | 320,000.00 | 333,563.52 |
| | UK TREASURY | 10,440,000.00 | 9,337,761.50 |
| | UK TREASURY | 7,500,000.00 | 7,498,003.50 |
| | UK TREASURY | 3,000,000.00 | 1,765,719.60 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 61,555.20 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 100,164.48 |
| | UK TREASURY | 7,450,000.00 | 3,852,395.00 |
| | UK TREASURY | 100,000.00 | 92,350.00 |
| | UK TREASURY | 1,800,000.00 | 1,002,600.00 |
| UK TREASURY | 700,000.00 | 398,570.20 | |
| UK TREASURY | 100,000.00 | 97,898.64 | |
| UK TREASURY | 100,000.00 | 68,987.00 | |
| UK TREASURY | 200,000.00 | 177,695.52 | |

| | | | | |
|---------------|----------------------------|----------------|-----------------|------------------|
| 小計 | UK TSY 0 1/2% 2061 | 6,600,000.00 | 2,115,300.00 | |
| | UK TSY 0 5/8% 2050 | 30,100,000.00 | 12,789,821.10 | |
| | UK TSY 3 1/4% 2044 | 7,000,000.00 | 6,056,621.20 | |
| | UNITED KINGDOM GILT | 8,500,000.00 | 8,361,077.70 | |
| | UNITED KINGDOM GILT | 20,850,000.00 | 20,927,753.82 | |
| | UNITED KINGDOM GILT | 13,000,000.00 | 6,680,180.00 | |
| | UNITED KINGDOM(GOVERNMENT) | 170,000.00 | 172,190.34 | |
| | 銘柄数 : 41 | 237,020,000.00 | 199,841,985.35 | (34,103,034,799) |
| 組入時価比率 : 4.8% | | | 4.8% | |
| スウェーデンクローナ | SWEDISH GOVERNMENT | 41,350,000.00 | 40,998,525.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 16,000,000.00 | 15,167,571.20 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 18,300,000.00 | 16,888,638.12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 4,100,000.00 | 3,712,856.27 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 13,100,000.00 | 11,008,585.00 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 21,300,000.00 | 24,079,437.00 | |
| | 銘柄数 : 6 | 114,150,000.00 | 111,855,612.59 | (1,483,205,422) |
| 組入時価比率 : 0.2% | | | 0.2% | |
| ノルウェークローネ | NORWEGIAN GOVERNMENT | 22,300,000.00 | 21,636,592.84 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 8,600,000.00 | 8,203,574.40 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1,700,000.00 | 1,614,592.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 9,400,000.00 | 8,914,960.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 28,000,000.00 | 25,819,248.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 7,400,000.00 | 6,552,756.24 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 13,000,000.00 | 11,946,207.00 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 5,500,000.00 | 5,415,696.00 | |
| 銘柄数 : 8 | 95,900,000.00 | 90,103,626.48 | (1,152,425,382) | |
| 組入時価比率 : 0.2% | | | 0.2% | |
| デンマーククローネ | KINGDOM OF DENMARK | 25,200,000.00 | 24,595,200.00 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 6,500,000.00 | 5,954,313.30 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 37,250,000.00 | 32,763,237.50 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 38,100,000.00 | 46,937,157.84 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | 7,500,000.00 | 3,858,483.75 | |

| | | | | |
|-----------------------|------------------------|----------------|------------------------------------|--|
| 小計 | 銘柄数 : 5 | 114,550,000.00 | 114,108,392.39 (2,271,898,092) | |
| | 組入時価比率 : 0.3% | | 0.3% | |
| ズロチ | POLAND GOVERNMENT BOND | 37,900,000.00 | 36,153,264.80 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 8,300,000.00 | 7,555,490.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 56,800,000.00 | 49,659,785.60 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 2,200,000.00 | 2,363,881.74 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 3,300,000.00 | 2,780,745.00 | |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 7,400,000.00 | 5,435,522.00 | |
| 小計 | 銘柄数 : 6 | 115,900,000.00 | 103,948,689.14 (3,385,193,010) | |
| | 組入時価比率 : 0.5% | | 0.5% | |
| 豪ドル | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 7,850,000.00 | 7,854,170.70 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 16,880,000.00 | 17,425,774.28 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 7,250,000.00 | 7,687,462.82 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3,200,000.00 | 3,149,215.04 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 300,000.00 | 293,473.32 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1,700,000.00 | 1,702,893.91 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 9,300,000.00 | 9,015,885.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 22,200,000.00 | 21,089,589.30 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5,700,000.00 | 4,804,667.37 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3,300,000.00 | 2,862,619.98 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 300,000.00 | 246,690.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 600,000.00 | 499,087.26 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2,500,000.00 | 2,158,162.50 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 17,000,000.00 | 18,497,538.50 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 300,000.00 | 287,582.19 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4,050,000.00 | 3,723,322.14 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 10,450,000.00 | 10,504,550.04 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1,550,000.00 | 1,440,725.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2,250,000.00 | 1,918,771.42 | |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 6,600,000.00 | 5,608,680.00 | |
| AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3,000,000.00 | 1,870,500.00 | | |
| 小計 | 銘柄数 : 21 | 126,280,000.00 | 122,641,360.77 (11,209,420,374) | |

| | | | | |
|----------------|------------------------|-------------|---------------|----------------------------------|
| | | 組入時価比率：1.6% | | 1.6% |
| ニュージーランド ドル | NEW ZEALAND GOVERNMENT | | 4,300,000.00 | 4,140,900.00 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | | 4,000,000.00 | 4,045,600.00 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | | 3,000,000.00 | 2,824,333.20 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | | 4,000,000.00 | 3,784,160.00 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | | 3,500,000.00 | 2,901,300.85 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | | 2,600,000.00 | 1,720,800.90 |
| | NEW ZEALAND GOVERNMENT | | 1,000,000.00 | 730,000.00 |
| 小計 | 銘柄数：7 | | 22,400,000.00 | 20,147,094.95 (1,725,195,740) |
| | 組入時価比率：0.2% | | | 0.2% |
| シンガポールドル | SINGAPORE GOVERNMENT | | 2,300,000.00 | 2,288,500.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 1,100,000.00 | 1,084,028.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 3,000,000.00 | 2,930,100.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 500,000.00 | 473,400.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 5,850,000.00 | 5,998,005.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 500,000.00 | 498,492.50 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 300,000.00 | 303,000.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 5,260,000.00 | 5,309,970.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 2,980,000.00 | 3,148,370.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 3,220,000.00 | 3,089,590.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 1,950,000.00 | 2,046,339.75 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 1,900,000.00 | 2,006,400.00 |
| | SINGAPORE GOVERNMENT | | 3,000,000.00 | 2,746,500.00 |
| | 小計 | 銘柄数：13 | | 31,860,000.00 |
| 組入時価比率：0.5% | | | | 0.5% |
| リンギ | MALAYSIA GOVERNMENT | | 400,000.00 | 404,541.24 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | | 1,000,000.00 | 1,012,612.10 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | | 2,600,000.00 | 2,792,506.86 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | | 3,300,000.00 | 3,291,750.99 |
| | MALAYSIA GOVERNMENT | | 5,600,000.00 | 6,056,280.72 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 2,500,000.00 | 2,506,909.00 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 7,800,000.00 | 7,885,544.16 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | | 2,900,000.00 | 2,942,204.28 |

| | | | |
|-----|-----------------------|----------------|-----------------|
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 16,600,000.00 | 17,076,441.58 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4,600,000.00 | 4,664,094.56 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 9,200,000.00 | 9,186,064.76 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 2,200,000.00 | 2,225,495.58 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 280,000.00 | 283,526.15 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 15,400,000.00 | 16,202,735.78 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5,400,000.00 | 5,553,410.22 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 10,200,000.00 | 10,205,702.82 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 11,100,000.00 | 11,375,141.25 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 13,350,000.00 | 14,884,637.23 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 10,500,000.00 | 11,462,652.60 |
| | MALAYSIAN GOVERNMENT | 300,000.00 | 342,912.60 |
| 小計 | 銘柄数：20 | 125,230,000.00 | 130,355,164.48 |
| | | | (3,960,880,779) |
| | 組入時価比率：0.6% | | 0.6% |
| 人民元 | CHINA GOVERNMENT BOND | 141,900,000.00 | 142,277,808.75 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 27,300,000.00 | 27,313,527.15 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 142,100,000.00 | 142,011,912.21 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 8,500,000.00 | 8,509,775.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 49,900,000.00 | 49,785,230.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 73,500,000.00 | 73,173,645.30 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 156,500,000.00 | 156,163,525.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 54,000,000.00 | 54,097,200.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 89,500,000.00 | 90,148,660.20 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 33,000,000.00 | 32,831,700.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 84,800,000.00 | 84,626,160.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 54,000,000.00 | 53,892,000.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 31,500,000.00 | 31,337,374.95 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 95,900,000.00 | 96,177,151.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 70,000,000.00 | 70,940,394.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 60,000,000.00 | 60,429,000.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 74,000,000.00 | 74,255,300.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 93,500,000.00 | 93,004,450.00 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 49,200,000.00 | 49,449,557.16 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | 33,000,000.00 | 33,686,799.30 |

| | | | | | |
|--|-------|-----------------------|------------------|-------------------|--|
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 20,000,000.00 | 20,184,914.00 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 20,000,000.00 | 19,969,360.00 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 31,500,000.00 | 31,476,135.60 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 66,300,000.00 | 65,854,145.76 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 49,400,000.00 | 49,546,480.88 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 51,000,000.00 | 51,658,986.30 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 15,000,000.00 | 16,602,969.00 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 36,000,000.00 | 38,632,870.80 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 87,700,000.00 | 90,782,576.07 | |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 61,100,000.00 | 61,179,191.71 | |
| | 小計 | 銘柄数：30 | 1,860,100,000.00 | 1,869,998,800.14 | |
| | | | | (36,516,401,569) | |
| | | 組入時価比率：5.1% | | 5.2% | |
| | 新シェケル | ISRAEL FIXED BOND | 1,900,000.00 | 1,798,173.11 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 700,000.00 | 653,284.10 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 14,300,000.00 | 13,588,114.54 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 6,500,000.00 | 7,012,164.25 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 5,000,000.00 | 4,687,041.00 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 6,300,000.00 | 5,860,984.50 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 4,500,000.00 | 3,784,518.45 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 5,900,000.00 | 4,381,711.70 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 7,200,000.00 | 8,604,591.84 | |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 5,700,000.00 | 5,374,475.28 | |
| | 小計 | 銘柄数：10 | 58,000,000.00 | 55,745,058.77 | |
| | | | | (2,054,656,950) | |
| | | 組入時価比率：0.3% | | 0.3% | |
| | 合計 | | | 706,124,283,352 | |
| | | | | (706,124,283,352) | |

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(3)貸付有価証券の明細(2023年5月10日現在)

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 備考 |
|------|-----|-----------------|------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY N/B | 24,000,000 | |
| | | US TREASURY N/B | 18,000,000 | |
| | | US TREASURY N/B | 2,500,000 | |
| | | US TREASURY N/B | 33,000,000 | |

| | | | |
|--|-------|-----------------------|------------|
| | | US TREASURY N/B | 30,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 14,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 875,000 |
| | | US TREASURY N/B | 33,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 85,000 |
| | | US TREASURY N/B | 85,000 |
| | | US TREASURY N/B | 4,900,000 |
| | | US TREASURY N/B | 45,877,000 |
| | | US TREASURY N/B | 15,000,000 |
| | | US TREASURY BOND | 22,250,000 |
| | | US TREASURY N/B | 50,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 23,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 170,000 |
| | | US TREASURY N/B | 85,000 |
| | | US TREASURY N/B | 170,000 |
| | | US TREASURY N/B | 170,000 |
| | | US TREASURY N/B | 85,000 |
| | | US TREASURY N/B | 14,450,000 |
| | | US TREASURY N/B | 25,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 255,000 |
| | | US TREASURY N/B | 425,000 |
| | | US TREASURY N/B | 19,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 1,530,000 |
| | | US TREASURY N/B | 425,000 |
| | | US TREASURY N/B | 85,000 |
| | | US TREASURY N/B | 85,000 |
| | | US TREASURY N/B | 15,300,000 |
| | | US TREASURY N/B | 10,877,000 |
| | | US TREASURY N/B | 15,600,000 |
| | | US TREASURY N/B | 7,317,000 |
| | | US TREASURY N/B | 5,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 2,245,000 |
| | | US TREASURY N/B | 6,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 5,605,000 |
| | | US TREASURY BOND | 43,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 17,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 24,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 85,000 |
| | | US TREASURY N/B | 700,000 |
| | | US TREASURY N/B | 85,000 |
| | | US TREASURY N/B | 14,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 38,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 255,000 |
| | | US TREASURY N/B | 255,000 |
| | | US TREASURY N/B | 8,075,000 |
| | | US TREASURY N/B | 50,000,000 |
| | | US TREASURY N/B | 3,000,000 |
| | カナダドル | CANADIAN GOVERNMENT | 4,000,000 |
| | 豪ドル | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 6,600,000 |

| | | |
|--------------------------|---------------------------|------------|
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3,900,000 |
| 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 |
| メキシコペソ | MEX BONOS DESARR FIX RT | 450,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 705,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 1,003,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 900,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 570,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 906,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 667,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 459,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 413,000 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 657,000 |
| ズロチ | POLAND GOVERNMENT BOND | 22,964,000 |
| | POLAND GOVERNMENT BOND | 2,805,000 |
| ユーロ | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,540,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 28,500,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 170,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,550,000 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 5,200,000 |
| | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 3,000,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6,000,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 9,000,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 15,000,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2,000,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 16,000,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 18,100,000 |
| | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4,000,000 |
| | FRANCE (GOVT OF) | 14,000,000 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1,000,000 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 8,700,000 |
| | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 1,000,000 |
| | BELGIUM KINGDOM | 7,000,000 |
| | BELGIUM KINGDOM | 2,380,000 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4,500,000 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 7,900,000 |
| | SPANISH GOVERNMENT | 7,800,000 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3,570,000 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1,600,000 |
| | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 9,061,000 |
| | SPANISH GOVERNMENT | 10,000,000 |
| | SPANISH GOVERNMENT | 24,030,000 |
| | SPANISH GOVERNMENT | 3,970,000 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 6,530,000 |
| | NETHERLANDS GOVERNMENT | 9,987,000 |
| | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1,700,000 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1,600,000 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 26,600,000 | |

| | | |
|--|--------------------------|------------|
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 250,000 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2,481,000 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 24,480,000 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3,800,000 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 29,800,000 |
| | BUONI POLIENNALI DEL TES | 17,500,000 |

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

| 種類 | 2023年5月10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 | 673,905,608 | — | 673,928,630 | 23,022 |
| 米ドル | 350,707,246 | — | 351,298,000 | 590,754 |
| カナダドル | 70,599,312 | — | 70,675,640 | 76,328 |
| ユーロ | 252,599,050 | — | 251,954,990 | △644,060 |
| 合計 | 673,905,608 | — | 673,928,630 | 23,022 |

(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。

【中間財務諸表】

(1)当ファンドの中間財務諸表は、「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 条の 3 および第 57 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、中間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 23 期中間計算期間(2023 年 5 月 11 日から 2023 年 11 月 10 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による中間監査を受けております。

独立監査人の中間監査報告書

2024年1月12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

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、「ファンドの経理状況」に掲げられているバランスセレクト50の2023年5月11日から2023年11月10日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、バランスセレクト50の2023年11月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2023年5月11日から2023年11月10日まで）の損益の状況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、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、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、継続企業的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。

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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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。

【バランスセレクト50】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

| | 第22期 (2023年5月10日現在) | 第23期中間計算期間末 (2023年11月10日現在) |
|-----------------|------------------------|--------------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 9,443,830 | 10,179,006 |
| 親投資信託受益証券 | 2,145,480,564 | 2,197,676,743 |
| 未収入金 | 14,835,436 | 15,543,894 |
| 流動資産合計 | 2,169,759,830 | 2,223,399,643 |
| 資産合計 | 2,169,759,830 | 2,223,399,643 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 12,115,535 | - |
| 未払解約金 | 1,919,216 | 15,453,600 |
| 未払受託者報酬 | 567,581 | 615,106 |
| 未払委託者報酬 | 6,810,879 | 7,381,272 |
| 未払利息 | 15 | 4 |
| その他未払費用 | 33,994 | 36,850 |
| 流動負債合計 | 21,447,220 | 23,486,832 |
| 負債合計 | 21,447,220 | 23,486,832 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,101,412,358 | 1,064,565,983 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金(△) | 1,046,900,252 | 1,135,346,828 |
| (分配準備積立金) | 711,226,147 | 665,466,747 |
| 元本等合計 | 2,148,312,610 | 2,199,912,811 |
| 純資産合計 | 2,148,312,610 | 2,199,912,811 |
| 負債純資産合計 | 2,169,759,830 | 2,223,399,643 |

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第22期中間計算期間 自 2022年5月11日 至 2022年11月10日 | 第23期中間計算期間 自 2023年5月11日 至 2023年11月10日 |
|-----------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 52,442,191 | 135,153,527 |
| 営業収益合計 | 52,442,191 | 135,153,527 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 833 | 1,419 |
| 受託者報酬 | 583,804 | 615,106 |
| 委託者報酬 | 7,005,568 | 7,381,272 |
| その他費用 | 34,966 | 36,850 |
| 営業費用合計 | 7,625,171 | 8,034,647 |

| | | |
|---|-------------|---------------|
| 営業利益又は営業損失（△） | 44,817,020 | 127,118,880 |
| 経常利益又は経常損失（△） | 44,817,020 | 127,118,880 |
| 中間純利益又は中間純損失（△） | 44,817,020 | 127,118,880 |
| 一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△） | 1,784,025 | 6,912,518 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（△） | 950,228,465 | 1,046,900,252 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 27,874,227 | 37,288,905 |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 27,874,227 | 37,288,905 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 37,801,732 | 69,048,691 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 37,801,732 | 69,048,691 |
| 分配金 | - | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金（△） | 983,333,955 | 1,135,346,828 |

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|--|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
| 4. その他 | 当ファンドの中間計算期間は、2023年5月11日から2023年11月10日までとなっております。 |

(中間貸借対照表に関する注記)

| 第22期 2023年5月10日現在 | 第23期中間計算期間末 2023年11月10日現在 |
|---|---|
| 1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,101,412,358 口 | 1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,064,565,983 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 | 2. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 |
| 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) | 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) |
| 1.9505円 (19,505円) | 2.0665円 (20,665円) |

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 第22期 2023年5月10日現在 | 第23期中間計算期間末 2023年11月10日現在 |
|---|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。 | 1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。 |
| 2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載して おります。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。 | 2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載して おります。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。 |

(その他の注記)

1 元本の移動

| 第22期 自 2022年 5月 11日 至 2023年 5月 10日 | | 第23期中間計算期間 自 2023年 5月 11日 至 2023年 11月 10日 | |
|--|-----------------|---|-----------------|
| 期首元本額 | 1,113,386,188 円 | 期首元本額 | 1,101,412,358 円 |
| 期中追加設定元本額 | 59,391,351 円 | 期中追加設定元本額 | 36,074,352 円 |
| 期中一部解約元本額 | 71,365,181 円 | 期中一部解約元本額 | 72,920,727 円 |

2 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド」、「国内債券マザーファンド」および「外国債券マザーファンド」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)

(2023年11月10日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 37,281,245,199 |
| 株式 | 582,832,579,840 |
| 派生商品評価勘定 | 146,720,295 |
| 未収配当金 | 5,376,392,867 |
| 未収利息 | 111,055 |
| その他未収収益 | 49,436,075 |
| 差入委託証拠金 | 677,369,190 |
| 流動資産合計 | 626,363,854,521 |
| 資産合計 | 626,363,854,521 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 78,430,875 |
| 未払金 | 241,290 |
| 未払解約金 | 375,263,642 |
| 未払利息 | 14,994 |
| 有価証券貸借取引受入金 | 29,442,443,408 |
| 流動負債合計 | 29,896,394,209 |
| 負債合計 | 29,896,394,209 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 229,463,681,325 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 367,003,778,987 |
| 元本等合計 | 596,467,460,312 |
| 純資産合計 | 596,467,460,312 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|--|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | 株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。 |
| 2. 費用・収益の計上基準 | 受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 2023年11月10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 | 2,5994円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (25,994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 | |
| | 28,367,222,850円 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 2023年11月10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 | |
| 先物取引 | (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年11月10日現在 | |
|----------------------------------|------------------|
| 期首 | 2023年5月11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 | 222,905,745,135円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 23,022,804,411円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 16,464,868,221円 |
| 期末元本額 | 229,463,681,325円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 107,343,915円 |

| | |
|------------------------------------|-----------------|
| バランスセレクト50 | 254,013,625円 |
| バランスセレクト70 | 406,147,765円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 1,792,164,283円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 2,432,580,661円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 9,879,942,794円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 27,208,311円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 30,715,021円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 47,286,674円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 79,398,407円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 78,221,929円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 141,350,726円 |
| 野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け) | 20,600,609,813円 |
| のむラップ・ファンド(保守型) | 1,785,092,474円 |
| のむラップ・ファンド(普通型) | 14,038,911,997円 |
| のむラップ・ファンド(積極型) | 6,415,147,416円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 33,406,273円 |
| 野村インデックスファンド・TOPIX | 2,135,083,176円 |
| マイ・ロード | 2,117,481,438円 |
| ネクストコア | 18,772,283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 | 1,161,809,312円 |
| 野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け) | 2,669,685,251円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 1,080,491,852円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 36,373,976円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 8,970,670円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 5,657,752円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 4,657,176円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 4,560,546円 |
| のむラップ・ファンド(やや保守型) | 326,788,322円 |
| のむラップ・ファンド(やや積極型) | 994,187,422円 |
| インデックス・ブレンド(タイプI) | 5,670,078円 |
| インデックス・ブレンド(タイプII) | 4,360,365円 |
| インデックス・ブレンド(タイプIII) | 31,007,935円 |
| インデックス・ブレンド(タイプIV) | 11,718,286円 |
| インデックス・ブレンド(タイプV) | 39,274,949円 |
| 野村6資産均等バランス | 4,057,669,053円 |
| 世界6資産分散ファンド | 90,268,579円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 31,688,596円 |
| はじめてのNISA・日本株式インデックス(TOPIX) | 11,550,726円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式 | 3,745,609,495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) | 187,422,727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) | 109,909,468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) | 254,925,646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) | 115,097,447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) | 1,775,796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) | 4,507,034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) | 199,858円 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 1,483,261,516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) | 965,547円 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 14,757,544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) | 32,476,743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) | 8,458,254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) | 71,194,492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) | 131,996,083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) | 3,505,172,652円 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 29,020,009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) | 196,963,623円 |

| | |
|---|------------------|
| ノムラ F O F s 用インデックスファンド・ T O P I X (適格機関投資家専用) | 3,908,256,685 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) | 31,165,389 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) | 120,498,921 円 |
| 野村 F O F s 用・ターゲット・リターン・8資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 1,837,655 円 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 5,196,103 円 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | 24,891,212 円 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 33,511,375 円 |
| 国内債券・株式バランスファンド (確定拠出年金向け) | 99,912,036 円 |
| マイバランス30 (確定拠出年金向け) | 7,639,246,857 円 |
| マイバランス50 (確定拠出年金向け) | 23,403,875,762 円 |
| マイバランス70 (確定拠出年金向け) | 30,135,004,424 円 |
| 野村国内株式インデックスファンド・ T O P I X (確定拠出年金向け) | 40,047,849,592 円 |
| マイバランスDC30 | 3,340,609,402 円 |
| マイバランスDC50 | 6,125,702,098 円 |
| マイバランスDC70 | 7,242,696,553 円 |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・ T O P I X | 13,491,935,114 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 813,281,755 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 36,077,357 円 |
| マイターゲット2050 (確定拠出年金向け) | 2,015,816,555 円 |
| マイターゲット2030 (確定拠出年金向け) | 1,879,978,840 円 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け) | 1,662,768,767 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 15,532,366 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 7,574,675 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 135,477,080 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030 | 44,806,365 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 47,397,351 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 34,777,381 円 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け) | 1,076,296,124 円 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け) | 843,975,222 円 |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け) | 635,549,010 円 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け) | 866,131,956 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 28,769,821 円 |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け) | 337,112,482 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) | 157,711,938 円 |
| みらいバランス・株式10 (富士通企業年金基金DC向け) | 193,990,077 円 |
| 野村DCバランスファンド (年金運用戦略タイプ) | 87,483,264 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

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2023年11月10日現在)

| 資産の部 | |
|----------|-------------------|
| 流動資産 | |
| 預金 | 4,029,631,404 |
| コール・ローン | 1,291,969,693 |
| 株式 | 1,791,171,086,363 |
| 投資証券 | 35,383,482,673 |
| 派生商品評価勘定 | 529,287,400 |
| 未収入金 | 16,040,990 |

| | |
|-----------------|-------------------|
| 未収配当金 | 1,343,695,321 |
| 差入委託証拠金 | 15,840,072,644 |
| 流動資産合計 | 1,849,605,266,488 |
| 資産合計 | 1,849,605,266,488 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 16,649,863 |
| 未払解約金 | 842,412,644 |
| 未払利息 | 519 |
| その他未払費用 | 7,790,500 |
| 流動負債合計 | 866,853,526 |
| 負債合計 | 866,853,526 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 329,187,403,295 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 1,519,551,009,667 |
| 元本等合計 | 1,848,738,412,962 |
| 純資産合計 | 1,848,738,412,962 |
| 負債純資産合計 | 1,849,605,266,488 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

| | |
|------------------------|---|
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | 約定日基準で計上しております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 |
|------------------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| 2023年11月10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 | 5,6161円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (56,161円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| 2023年11月10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。 |
| 新株予約権証券 | (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 |
| 投資証券 | (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 |
| 派生商品評価勘定 | |
| 先物取引 | (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 | |
| 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。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 | |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年11月10日現在 | |
|----------------------------------|------------------|
| 期首 | 2023年5月11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 | 317,097,722,497円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 26,797,781,234円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 14,708,100,436円 |
| 期末元本額 | 329,187,403,295円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 24,760,755円 |
| バランスセレクト50 | 78,093,992円 |
| バランスセレクト70 | 104,203,482円 |
| 野村外国株式インデックスファンド | 485,048,608円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 2,537,265,492円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 3,443,947,629円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 4,662,538,695円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 7,444,891円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 8,407,116円 |

| | |
|--|-----------------|
| 野村資産設計ファンド2025 | 13,017,295円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 21,820,425円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 21,445,401円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 38,604,237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) | 41,501,164,014円 |
| のむラップ・ファンド (保守型) | 1,267,823,990円 |
| のむラップ・ファンド (普通型) | 13,502,424,381円 |
| のむラップ・ファンド (積極型) | 15,263,545,361円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 9,167,069円 |
| 野村インデックスファンド・外国株式 | 9,004,907,702円 |
| マイ・ロード | 1,344,099,852円 |
| ネクストコア | 11,562,920円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 176,016,664円 |
| 野村外国株インデックスBコース (野村SMA・EW向け) | 3,288,092,603円 |
| 野村世界6資産分散投信 (配分変更コース) | 358,932,012円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 9,967,119円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 2,455,292円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 1,560,862円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,269,227円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 1,253,517円 |
| のむラップ・ファンド (やや保守型) | 286,234,561円 |
| のむラップ・ファンド (やや積極型) | 1,375,529,847円 |
| インデックス・ブレンド (タイプI) | 4,417,337円 |
| インデックス・ブレンド (タイプII) | 4,835,260円 |
| インデックス・ブレンド (タイプIII) | 45,003,546円 |
| インデックス・ブレンド (タイプIV) | 16,588,003円 |
| インデックス・ブレンド (タイプV) | 56,088,804円 |
| 野村6資産均等バランス | 1,914,890,889円 |
| 野村つみたて外国株投信 | 17,164,021,352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) | 5,281,351,680円 |
| 世界6資産分散ファンド | 42,599,531円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 8,673,574円 |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信 | 2,353,556,771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) | 172,354,094円 |
| NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数 (為替ヘッジなし) 連動型上場投信 | 7,317,959,054円 |
| ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 外国株式 | 7,020,604,896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) | 88,437,940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) | 51,868,416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) | 356,355,069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) | 268,153,738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) | 837,899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) | 2,599,199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) | 207,463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) | 182,235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) | 4,642,173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) | 309,391,004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) | 2,993,607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) | 22,395,928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) | 62,281,565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) | 1,890,165,567円 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 13,694,561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) | 1,158,289,305円 |
| 野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド (適格機関投資家専用) | 11,504,991,766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 | 867,225円 |

| | |
|---|-------------------|
| 機関投資家専用) | |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 1,226,496 円 |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | 7,652,561 円 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 8,784,528 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) | 102,070,906,110 円 |
| マイバランス30 (確定拠出年金向け) | 1,795,657,139 円 |
| マイバランス50 (確定拠出年金向け) | 7,339,062,257 円 |
| マイバランス70 (確定拠出年金向け) | 7,896,154,294 円 |
| マイバランスDC30 | 779,567,078 円 |
| マイバランスDC50 | 1,923,465,158 円 |
| マイバランスDC70 | 1,889,614,602 円 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSA I | 46,018,398,247 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 500,387,214 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド) | 17,996,286 円 |
| マイターゲット2050 (確定拠出年金向け) | 562,134,039 円 |
| マイターゲット2030 (確定拠出年金向け) | 485,373,583 円 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け) | 510,408,558 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース | 21,990,095 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 10,723,843 円 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 63,934,245 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030 | 12,313,860 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 12,944,652 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 9,529,585 円 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け) | 319,938,805 円 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け) | 246,454,443 円 |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け) | 170,191,520 円 |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け) | 227,080,456 円 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 7,874,687 円 |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け) | 88,383,366 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) | 93,034,233 円 |
| みらいバランス・株式10 (富士通企業年金基金DC向け) | 61,031,811 円 |
| 野村DCバランスファンド (年金運用戦略タイプ) | 41,285,082 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

国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2023年11月10日現在)

| | |
|---------|----------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 144,700,630 |
| 国債証券 | 18,798,799,910 |
| 未収入金 | 52,801,000 |
| 未収利息 | 41,979,297 |
| 前払費用 | 907,908 |
| 流動資産合計 | 19,039,188,745 |
| 資産合計 | 19,039,188,745 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |

| | |
|-----------------|----------------|
| 未払解約金 | 16,882,254 |
| 未払利息 | 58 |
| 流動負債合計 | 16,882,312 |
| 負債合計 | 16,882,312 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 14,921,412,241 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 4,100,894,192 |
| 元本等合計 | 19,022,306,433 |
| 純資産合計 | 19,022,306,433 |
| 負債純資産合計 | 19,039,188,745 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

| | |
|----------------------------|-----------|
| 2023年11月10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 | 1.2748円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (12,748円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

| | |
|--|--|
| 2023年11月10日現在 | |
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | |
| 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ | |
| ん。 | |
| 2. 時価の算定方法 | |
| 国債証券 | |
| (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | |
| コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 | |
| これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており | |
| ます。 | |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| | |
|----------------------------------|-----------------|
| 2023年11月10日現在 | |
| 期首 | 2023年5月11日 |
| 本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額 | 16,728,022,987円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,678,659,736円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 4,485,270,482円 |
| 期末元本額 | 14,921,412,241円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 601,020,952円 |
| バランスセレクト50 | 690,113,026円 |

| | |
|------------------------------------|----------------|
| バランスセレクト70 | 363,825,429円 |
| ネクストコア | 124,062,873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) | 247,264,968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) | 956,034,336円 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 28,435,433円 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 67,627,904円 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 29,634,134円 |
| 野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け) | 4,804,708,000円 |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け) | 198,911,833円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 5,362,164,627円 |
| 野村DC運用戦略ファンド(マイルド) | 1,447,608,726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

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2023年11月10日現在)

| 資産の部 | |
|-----------------|-----------------|
| 流動資産 | |
| 預金 | 418,010,826 |
| コール・ローン | 566,956,575 |
| 国債証券 | 775,930,740,615 |
| 派生商品評価勘定 | 513,282 |
| 未収入金 | 151,510,263 |
| 未収利息 | 7,906,439,777 |
| 前払費用 | 839,702,391 |
| その他未収収益 | 19,828,850 |
| 流動資産合計 | 785,833,702,579 |
| 資産合計 | 785,833,702,579 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 226,680 |
| 未払金 | 344,925,598 |
| 未払解約金 | 556,537,136 |
| 未払利息 | 228 |
| その他未払費用 | 10,123,531 |
| 流動負債合計 | 911,813,173 |
| 負債合計 | 911,813,173 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 280,944,958,741 |
| 剰余金 | |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△) | 503,976,930,665 |
| 元本等合計 | 784,921,889,406 |
| 純資産合計 | 784,921,889,406 |
| 負債純資産合計 | 785,833,702,579 |

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|------------------------|---|
| 1. 運用資産の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p> |
| 2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準 | <p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> |
| 3. 費用・収益の計上基準 | <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 | <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> |

(貸借対照表に関する注記)

| 2023年11月10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 | 2,7939円 |
| (10,000口当たり純資産額) | (27,939円) |
| 2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券 | 252,079,068,265円 |
| なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。 | |
| 3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価 | |
| 貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。 | |
| 有価証券 | 265,485,638,864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)

金融商品の時価等に関する事項

| 2023年11月10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>国債証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>為替予約取引</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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。 <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

| 2023年11月10日現在 | |
|---------------|------------|
| 期首 | 2023年5月11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 | 275,585,073,380円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 26,592,476,813円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 21,232,591,452円 |
| 期末元本額 | 280,944,958,741円 |
| 期末元本額の内訳* | |
| バランスセレクト30 | 74,558,640円 |
| バランスセレクト50 | 78,404,372円 |
| バランスセレクト70 | 83,598,719円 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 254,828,137円 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 3,311,168,113円 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 22,473,563,465円 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 2,607,958,689円 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 19,105,417円 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 21,567,020円 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 33,481,534円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 49,171,865円 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 39,216,336円 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 63,345,047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) | 77,935,388,701円 |
| のむらップ・ファンド(保守型) | 5,360,510,816円 |
| のむらップ・ファンド(普通型) | 30,072,792,558円 |
| のむらップ・ファンド(積極型) | 9,692,552,540円 |
| 野村外国債券インデックス(野村SMA向け) | 373,511,278円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 13,028,631円 |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 1,055,557,427円 |
| マイ・ロード | 6,432,384,570円 |
| ネクストコア | 61,197,217円 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 344,596,638円 |
| 野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け) | 6,554,725,698円 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 990,032,245円 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 11,599,956円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型 | 4,197,758円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型 | 2,920,827円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型 | 1,900,544円 |
| 野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型 | 1,699,574円 |
| のむらップ・ファンド(やや保守型) | 950,238,929円 |
| のむらップ・ファンド(やや積極型) | 1,650,725,037円 |
| インデックス・ブレンド(タイプI) | 3,462,889円 |
| インデックス・ブレンド(タイプII) | 2,683,908円 |
| インデックス・ブレンド(タイプIII) | 12,011,363円 |
| インデックス・ブレンド(タイプIV) | 3,698,629円 |
| インデックス・ブレンド(タイプV) | 10,821,166円 |
| 野村6資産均等バランス | 3,748,560,832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) | 8,152,036,813円 |
| 世界6資産分散ファンド | 83,399,286円 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 6,356,302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 | 12,340,625,685円 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券 | 8,324,692,941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) | 5,408,847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) | 831,048,832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) | 162,496,134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) | 824,214,680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) | 265,846,809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) | 1,640,356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) | 5,551,044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） | 73,845 円 |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 2,283,980,149 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） | 1,605,428 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） | 13,631,989 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） | 5,858,744 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） | 153,485,076 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） | 121,928,777 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） | 1,850,191,002 円 |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用） | 53,118,206 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） | 922,098,408 円 |
| ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用） | 1,958,895,276 円 |
| 野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用） | 5,093,352 円 |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け） | 3,601,672 円 |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け） | 7,682,986 円 |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け） | 6,878,999 円 |
| 野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け） | 636,475,601 円 |
| マイバランス30（確定拠出年金向け） | 5,387,226,474 円 |
| マイバランス50（確定拠出年金向け） | 7,306,363,677 円 |
| マイバランス70（確定拠出年金向け） | 6,282,519,357 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） | 25,521,996,795 円 |
| マイバランスDC30 | 2,325,546,706 円 |
| マイバランスDC50 | 1,895,297,986 円 |
| マイバランスDC70 | 1,491,598,006 円 |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 10,707,253,297 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 2,643,190,765 円 |
| 野村DC運用戦略ファンド（マイルド） | 343,737,925 円 |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け） | 460,900,974 円 |
| マイターゲット2030（確定拠出年金向け） | 1,082,651,399 円 |
| マイターゲット2040（確定拠出年金向け） | 443,593,691 円 |
| 野村世界6資産分散投信（DC）安定コース | 28,700,760 円 |
| 野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース | 69,953,370 円 |
| 野村世界6資産分散投信（DC）成長コース | 35,752,054 円 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030 | 27,760,128 円 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040 | 21,234,291 円 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050 | 11,085,809 円 |
| マイターゲット2035（確定拠出年金向け） | 392,802,390 円 |
| マイターゲット2045（確定拠出年金向け） | 208,918,200 円 |
| マイターゲット2055（確定拠出年金向け） | 135,188,839 円 |
| マイターゲット2060（確定拠出年金向け） | 177,826,812 円 |
| 野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060 | 5,771,092 円 |
| マイターゲット2065（確定拠出年金向け） | 69,213,066 円 |
| 多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け） | 60,712,624 円 |
| みらいバランス・株式10（富士通企業年金基金DC向け） | 298,652,035 円 |
| 野村DCバランスファンド（年金運用戦略タイプ） | 80,825,895 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

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

バランスセレクト50

2023年11月30日現在

| | |
|----------------------|----------------|
| I 資産総額 | 2,153,918,366円 |
| II 負債総額 | 857,680円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 2,153,060,686円 |
| IV 発行済口数 | 1,027,472,948口 |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 2.0955円 |

(参考) 国内株式マザーファンド

2023年11月30日現在

| | |
|----------------------|------------------|
| I 資産総額 | 685,946,797,431円 |
| II 負債総額 | 78,094,022,780円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 607,852,774,651円 |
| IV 発行済口数 | 230,045,243,998口 |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 2.6423円 |

(参考) 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

2023年11月30日現在

| | |
|----------------------|--------------------|
| I 資産総額 | 1,895,254,423,781円 |
| II 負債総額 | 6,288,198,148円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 1,888,966,225,633円 |
| IV 発行済口数 | 329,648,761,416口 |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 5.7302円 |

(参考) 国内債券マザーファンド

2023年11月30日現在

| | |
|----------------------|-----------------|
| I 資産総額 | 19,380,966,967円 |
| II 負債総額 | 349,443,967円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 19,031,523,000円 |
| IV 発行済口数 | 14,755,955,675口 |
| V 1口当たり純資産額 (III/IV) | 1.2898円 |

(参考) 外国債券マザーファンド

2023年11月30日現在

| | |
|------------------------|------------------|
| I 資産総額 | 794,448,832,340円 |
| II 負債総額 | 1,778,551,496円 |
| III 純資産総額 (I - II) | 792,670,280,844円 |
| IV 発行済口数 | 282,221,906,782口 |
| V 1口当たり純資産額 (III / IV) | 2.8087円 |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同法に定めるところにしたがい、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

2023年12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年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

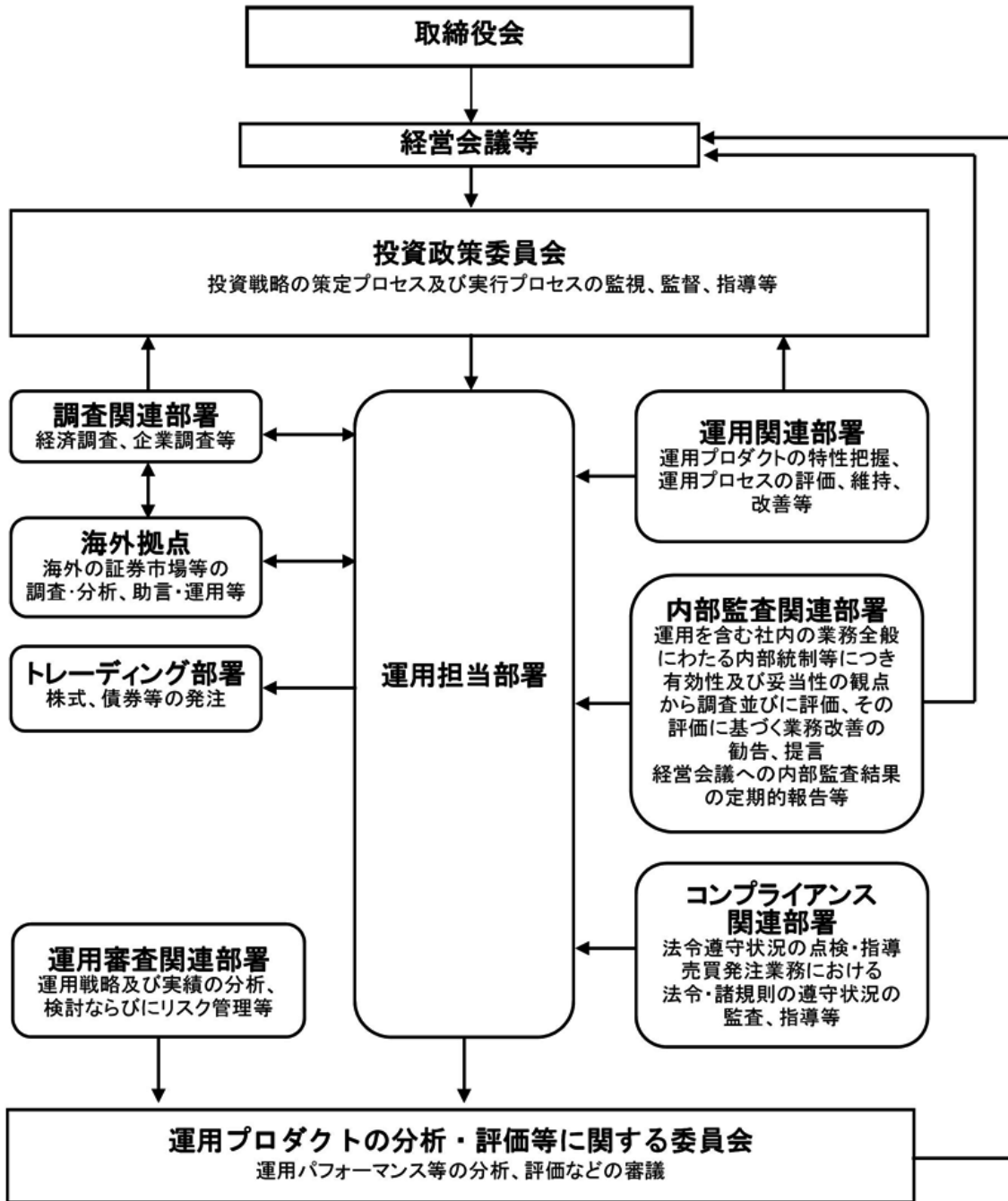
代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

(b) 投資信託の運用体制



2 【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2023年11月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

| 種類 | 本数 | 純資産総額(百万円) |
|------------|-------|------------|
| 追加型株式投資信託 | 998 | 46,504,659 |
| 単位型株式投資信託 | 176 | 662,729 |
| 追加型公社債投資信託 | 14 | 6,759,998 |
| 単位型公社債投資信託 | 464 | 957,221 |
| 合計 | 1,652 | 54,884,607 |

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。

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
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

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、継続企業的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に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。

(1) 【貸借対照表】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (2022年3月31日) | | 当事業年度 (2023年3月31日) | |
|----------|----------|-----------------------|---------|-----------------------|---------|
| | | 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 (2022年3月31日) | | 当事業年度 (2023年3月31日) | |
|--------------|----------|-----------------------|---------|-----------------------|---------|
| 区分 | 注記 番号 | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| (負債の部) | | | | | |
| 流動負債 | | | | | |
| 預り金 | | | 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】

| 区分 | 注記 番号 | 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) | |
|-----------|----------|--|---------|--|---------|
| | | 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 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) | |
|--------------|----------|--|--------|--|--------|
| 区分 | 注記 番号 | 金額(百万円) | | 金額(百万円) | |
| 営業外収益 | | | | | |
| 受取配当金 | ※ 1 | 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 | | 0 | | 16 | |
| 関係会社株式評価損 | | 727 | | - | |
| 固定資産除却損 | ※ 2 | 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 | | | | | | | | 株主資本合計 |
|---------------------|--------|--------|----------|---------|-------|--------|---------|---------|---------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益準備金 | 利益剰余金 | | 利益剰余金合計 | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 31,395 | 56,686 | 87,596 |
| 当期変動額 | | | | | | | | | |
| 剰余金の配当 | | | | | | | △26,268 | △26,268 | △26,268 |
| 当期純利益 | | | | | | | 24,904 | 24,904 | 24,904 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | | | | | | | | | |
| 当期変動額合計 | — | — | — | — | — | — | △1,364 | △1,364 | △1,364 |
| 当期末残高 | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 30,030 | 55,322 | 86,232 |

(単位：百万円)

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

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 | | | 利益剰余金合計 | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | 利益準備金 | その他利益剰余金 | 繰越利益剰余金 | | |
| | | 別途積立金 | | | | | | | |
| 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 |
|---------------------|--------------|------------|---------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 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]

| | | | | | | | |
|---------------------------------|---|----|----|------|-------|------|-------|
| <p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> | <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 市場価格のない … 時価法 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) 市場価格のない … 移動平均法による原価法 株式等</p> | | | | | | |
| <p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p> | <p>時価法</p> | | | | | | |
| <p>3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p> | <p>時価法</p> | | | | | | |
| <p>4. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準</p> | <p>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。</p> | | | | | | |
| <p>5. 固定資産の減価償却の方法</p> | <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0" data-bbox="671 936 1050 1025"> <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 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 | | | | | | |
| <p>6. 引当金の計上基準</p> | <p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。</p> <p>① 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</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 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> | | | | | | |

7. 収益及び費用の計上基準

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

① 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

② 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

③ 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

[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 (2022年3月31日) | 当事業年度末 (2023年3月31日) |
|---|---|
| <p>※1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">未払費用 1,223 百万円</p> | <p>※1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">未払費用 1,350 百万円</p> |
| <p>※2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <p style="text-align: right;">建物 589 百万円</p> <p style="text-align: right;">器具備品 618</p> <hr/> <p style="text-align: right;">合計 1,207</p> | <p>※2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額</p> <p style="text-align: right;">建物 901 百万円</p> <p style="text-align: right;">器具備品 657</p> <hr/> <p style="text-align: right;">合計 1,559</p> |

◇ 損益計算書関係

| 前事業年度 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | 当事業年度 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日) |
|---|--|
| <p>※1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 3,525 百万円</p> | <p>※1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p style="text-align: right;">受取配当金 7,634 百万円</p> |
| <p>※2. 固定資産除却損</p> <p style="text-align: right;">建物 346 百万円</p> <p style="text-align: right;">器具備品 28</p> <p style="text-align: right;">ソフトウェア -</p> <hr/> <p style="text-align: right;">合計 374</p> | <p>※2. 固定資産除却損</p> <p style="text-align: right;">建物 0 百万円</p> <p style="text-align: right;">器具備品 0</p> <p style="text-align: right;">ソフトウェア 52</p> <hr/> <p style="text-align: right;">合計 52</p> |

◇ 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、当社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2022年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

(単位：百万円)

| | 貸借対照表 計上額 | 時価 | 差額 |
|-------------------|--------------|--------|----|
| (1) 金銭の信託 | 35,894 | 35,894 | - |
| 資産計 | 35,894 | 35,894 | - |
| (2) その他（デリバティブ取引） | 121 | 121 | - |
| 負債計 | 121 | 121 | - |

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、有価証券、短期貸付金、未払金、未払費用、未払法人税等は短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注2) 投資有価証券及び関係会社株式は、市場価格のない株式等及び組合出資金等であることから、上表には含まれておりません。当該金融商品の貸借対照表計上額は以下のとおりであります。

| | 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 5年以内 | 5年超 10年以内 | 10年超 |
|--------------|---------|-------------|--------------|------|
| 預金 | 2,006 | - | - | - |
| 金銭の信託 | 35,894 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 27,176 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 4,002 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| その他有価証券 | 29,300 | - | - | - |
| 短期貸付金 | 1,835 | | | |
| 合計 | 100,215 | - | - | - |

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

レベル3の時価：重要な観察できないインプットを使用して算定した時価

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

| 区分 | 貸借対照表計上額（単位：百万円） | | | |
|------------------------|------------------|-------|------|-------|
| | レベル1 | レベル2 | レベル3 | 合計 |
| 金銭の信託（運用目的・その他） （※） | - | 1,736 | - | 1,736 |
| 資産計 | - | 1,736 | - | 1,736 |
| デリバティブ取引（通貨関連） | - | 121 | - | 121 |
| 負債計 | - | 121 | - | 121 |

（※）時価算定適用指針第26項に従い経過措置を適用し、投資信託を主要な構成物とする金銭の信託34,157百万円は表中に含まれておりません。

（注）時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

金銭の信託

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

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

デリバティブ取引

時価の算定方法は、取引先金融機関から提示された価格等に基づき算出しており、レベル2の時価に分類しております。

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 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 5年以内 | 5年超 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 (百万円) |
|--------|----------------|
| 子会社株式 | 9,107 |
| 関連会社株式 | 106 |

4. その他有価証券(2022 年 3 月 31 日)

| 区分 | 貸借対照表 計上額 (百万円) | 取得原価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|-----------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 株式 | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 譲渡性預金 | 29,300 | 29,300 | - |
| 小計 | 29,300 | 29,300 | - |
| 合計 | 29,300 | 29,300 | - |

※市場価格のない株式等（貸借対照表計上額 315 百万円）及び組合出資金等（貸借対照表計上額 1,886 百万円）は、記載していません。

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日）

該当事項はありません。

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 (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 計上額 (百万円) | 取得原価 (百万円) | 差額 (百万円) |
|-----------------------------------|-----------------------|---------------|-------------|
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 株式 | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| 貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 譲渡性預金 | 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、記載していません。

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 (百万円) | 契約額等の うち一年超 (百万円) | 時価 (百万円) | 評価損益 (百万円) |
|-----------|---------------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 米ドル | 1,714 | - | △121 | △121 |

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 (百万円) | 契約額等の うち一年超 (百万円) | 時価 (百万円) | 評価損益 (百万円) |
|-----------|---------------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 米ドル | 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 | |
| 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 |
| <u>退職給付債務の期末残高</u> | <u>20,314</u> |

(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 |
| <u>年金資産の期末残高</u> | <u>19,378</u> |

(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 |
| <u>非積立型制度の退職給付債務</u> | <u>2,927</u> |
| 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 |
| <u>貸借対照表上に計上された負債と資産の純額</u> | <u>1,387</u> |
| 退職給付引当金 | 2,940 |
| 前払年金費用 | △1,553 |
| <u>貸借対照表上に計上された負債と資産の純額</u> | <u>1,387</u> |

(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 |
| <u>確定給付制度に係る退職給付費用</u> | <u>653</u> |

(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% |
| <u>合計</u> | <u>100%</u> |

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 (2022年3月31日) | | 当事業年度末 (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 | 至 2022年3月31日 | 自 2022年4月1日 | 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 (自 2021 年 4 月 1 日 至 2022 年 3 月 31 日) |
|---------|--|
| 委託者報酬 | 115,670 百万円 |
| 運用受託報酬 | 16,675 百万円 |
| 成功報酬（注） | 1,058 百万円 |
| その他営業収益 | 530 百万円 |
| 合計 | 133,935 百万円 |

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

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 (自 2022 年 4 月 1 日 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(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|-----|---------------------|------|----------------|-------|----------------|-----------|-------|-----------|-------|-----------|
| 子会社 | ノムラ・エーエム・ファイナンス・インク | ケイマン | 2,500 (米ドル) | 資金管理 | 直接 100% | 資産の賃貸借 | 資金の貸付 | 3,427 | 短期貸付金 | 1,835 |
| | | | | | | | 資金の返済 | 1,709 | | |
| | | | | | | | 貸付金利息 | 9 | 未収利息 | 4 |

(ウ) 兄弟会社等

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(百万円) | 科目 | 期末残高(百万円) |
|---------|----------|--------|-----------------|-------|----------------|---|-----------------------|-----------|-------|-----------|
| 親会社の子会社 | 野村証券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000 (百万円) | 証券業 | — | 当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1) | 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 (被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (百万円) | 科目 | 期末残高 (百万円) |
|-----|---------------------------------|------|----------------|-------|--------------------|-----------|-------|---------------|-----------|---------------|
| 子会社 | ノムラ・エー エム・ファイ ナンス・イン ク | ケイマン | 2,500 (米ドル) | 資金管理 | 直接 100% | 資産の賃貸借 | 資金の貸付 | 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 (被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 (百万円) | 科目 | 期末残高 (百万円) |
|---------|----------|--------|-----------------|-------|--------------------|---|-----------------------|---------------|-------|---------------|
| 親会社の子会社 | 野村証券株式会社 | 東京都中央区 | 10,000 (百万円) | 証券業 | — | 当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任 | 投資信託に係る事務代行手数料の支払(*1) | 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 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日) | | 当事業年度 (自 2022年4月1日 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 |
| <p>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。</p> <p>1株当たり当期純利益の算定上の基礎</p> <p>損益計算書上の当期純利益 24,904百万円</p> <p>普通株式に係る当期純利益 24,904百万円</p> <p>普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。</p> <p>普通株式の期中平均株式数 5,150,693株</p> | | <p>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。</p> <p>1株当たり当期純利益の算定上の基礎</p> <p>損益計算書上の当期純利益 26,064百万円</p> <p>普通株式に係る当期純利益 26,064百万円</p> <p>普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。</p> <p>普通株式の期中平均株式数 5,150,693株</p> | |

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 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 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 | | |
| 資本金 | | 48,142 |
| 資本剰余金 | | 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 至 2023年9月30日 |
|--------------|----------|-----------------------------|
| 区分 | 注記 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 | | | | | | | | 株主資本合計 |
|-----------------------|--------|--------|----------|---------|-------|---------|---------|---------|---------|
| | 資本金 | 資本剰余金 | | | 利益準備金 | 利益剰余金 | | 利益剰余金合計 | |
| | | 資本準備金 | その他資本剰余金 | 資本剰余金合計 | | 別途積立金 | 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 17,180 | 11,729 | 2,000 | 13,729 | 685 | 24,606 | 31,217 | 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 | — | — |
| 株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額) | | | | | | | | | |
| 当中間期変動額合計 | — | — | — | — | — | △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 |
|-----------------------|--------------|------------|---------|
| | その他有価証券評価差額金 | 評価・換算差額等合計 | |
| 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当中間期変動額(純額) | 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]

| | | | | | | | |
|---------------------------------|--|----|----|------|-------|------|-------|
| <p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> | <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 市場価格のない … 時価法 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)</p> <p>市場価格のない … 移動平均法による原価法 株式等</p> | | | | | | |
| <p>2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法</p> | <p>時価法</p> | | | | | | |
| <p>3. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p> | <p>時価法</p> | | | | | | |
| <p>4. 外貨建の資産又は負債の本邦通貨への換算基準</p> | <p>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。</p> | | | | | | |
| <p>5. 固定資産の減価償却の方法</p> | <p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0" data-bbox="671 965 1050 1061"> <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 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 | | | | | | |
| <p>6. 引当金の計上基準</p> | <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、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 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 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、</p> | | | | | | |

7. 収益及び費用の計上基準

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。

当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。

① 委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

② 運用受託報酬

運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき契約期間の純資産総額等に対する一定割合として認識され、確定した報酬を顧問口座によって主に年4回、もしくは年2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

③ 成功報酬

成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。

[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 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 至 2023年9月30日 | | | | |
|-----------------------------|--------------------------------------|------------|------------|------------|
| 1 発行済株式に関する事項 | | | | |
| | 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 |
| | 普通株式 | 5,150,693株 | — | — |
| | | | | 当中間会計期間末 |
| | | | | 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 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。

| | 中間貸借対照表計上額 (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 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 （百万円） | 契約額等 のうち一年超 （百万円） | 時価 （百万円） | 評価損益 （百万円） |
|-----------|---------------------|---------------|-------------------------|-------------|---------------|
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 米ドル | 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 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 (自 2023 年 4 月 1 日 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 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通常の見取の条件と異なる条件であって見取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。

約款

(バランスセレクト 50)

運用の基本方針

約款第 22 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、内外の株式および公社債に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行いません。

2. 運用方法

(1) 投資対象

国内株式マザーファンド受益証券、外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド受益証券、国内債券マザーファンド受益証券および外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式および公社債に直接投資する場合があります。

(2) 投資態度

① 各マザーファンド受益証券への投資比率は以下を基本とし、原則として 3 ヶ月毎にリバランスを行いません。

国内株式マザーファンド受益証券：30%

外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド受益証券：20%

国内債券マザーファンド受益証券：40%

外国債券マザーファンド受益証券：10%

② 実質組入れ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 非株式割合（株式以外の資産への実質投資割合）は、原則として信託財産総額の 75%以下を基本とします。

④ 資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 70%未満とします。

② 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 40%以内とします。

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

④ 有価証券先物取引等は約款第 27 条の範囲で行いません。

⑤ スワップ取引は約款第 28 条の範囲で行いません。

⑥ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。

⑦ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5%以内とします。

⑧ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 10%以内とします。

- ⑨ 投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的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 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. 収益分配方針

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・配当収入と売買益（評価益を含みません。）等の全額とします。
- ② 収益分配金額は、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。

追加型証券投資信託
バランスセレクト 50
約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第 1 条 この信託は証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下特段の記載があるものを除き「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託の目的および金額)

第 2 条 委託者は、金 500 億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

(信託金の限度額)

第 3 条 委託者は、受託者と合意のうえ、5,000 億円を限度として信託金を追加することができます。

② 追加信託が行なわれたときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、第 1 項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 4 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 54 条第 1 項、第 55 条第 1 項、第 56 条第 1 項および第 58 条第 2 項の規定による解約の日までとします。

(受益権の取得申込みの勧誘の種類)

第 5 条 この信託にかかる受益権の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 1 号に掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 2 条第 8 項で定める公募により行われます。

(当初の受益者)

第 6 条 この信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託者の指定する受益権取得申込者とし、第 7 条により分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

(受益権の分割および再分割)

第 7 条 委託者は、第 2 条の規定による受益権については 500 億口を上限とし、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 8 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、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。

(追加信託の価額および口数、基準価額の計算)

第 8 条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前日の基準価額に当該追加信託にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「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た金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第9条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益権の帰属と受益証券の不発行)

第10条 この信託の受益権は、平成19年1月4日より、社債等の振替に関する法律（政令で定める日以降「社債、株式等の振替に関する法律」となった場合は読み替えるものとし、「社債、株式等の振替に関する法律」を含め「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受けることとし、同日以降に追加信託される受益権の帰属は、委託者があらかじめこの投資信託の受益権を取り扱うことについて同意した一の振替機関（社振法第2条に規定する「振替機関」をいい、以下「振替機関」といいます。）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。）。

② 委託者は、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、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。

③ 委託者は、第7条の規定により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。

④ 委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請することができるものとし、原則としてこの信託の平成18年12月29日現在の全ての受益権（受益権につき、既に信託契約の一部解約が行なわれたもので、当該一部解約にかかる一部解約金の支払開始日が平成19年1月4日以降となるものを含みます。）を受益者を代理して平成19年1月4日に振替受入簿に記載または記録するよう申請します。ただし、保護預かりではない受益証券に係る受益権については、信託期間中において委託者が受益証券を確認した後当該申請を行なうものとします。振替受入簿に記載または記録された受益権にかかる受益証券（当該記載または記録以降に到来する計算期間の末日にかかる収益分配金交付票を含みます。）は無効となり、当該記載または記録により振替受益権となります。また、委託者は、受益者を代理してこの信託の受益権を振替受入簿に記載または記録を申請する場合において、販売会社（委託者の指定する第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および委託者の指定する登録金融機関（金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）をいいます。以下同じ。）に当該申請の手続きを委任することができます。

(受益権の設定に係る受託者の通知)

第11条 受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

(受益権の申込単位および価額)

第12条 販売会社は、第7条第1項の規定により分割される受益権を、その取得申込者に対し、1口単位もしくは1口の整数倍となる販売会社が定める単位をもって取得申込に応じることができるものとします。

② 前項の場合の受益権の価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額に、手数料および当該手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を加算した価額とします。ただし、この信託契約締結日前の取得申込にかかる受益権の価額は、1万口につき1万円に手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した価額とします。

③ 前項の手数料の額は、販売会社がそれぞれ独自に定めるものとします。

④ 前2項の規定にかかわらず、受益者が第50条第2項の規定に基づいて収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、取得申込日の基準価額とします。

⑤ 第1項の取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたこの信託の受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金（第2項の受益権の価額に当該取得申込の口数を乗じて得た額をいいます。）の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。

⑥ 前各項の規定にかかわらず、委託者は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた取得申込の受け付けを取消することができます。

(受益権の譲渡に係る記載または記録)

第13条 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 前項の申請のある場合には、前項の振替機関等は、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、前項の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

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

(受益権の譲渡の対抗要件)

第14条 受益権の譲渡は、前条の規定による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。

第 15 条 (削除)

第 16 条 (削除)

第 17 条 (削除)

第 18 条 (削除)

第 19 条 (削除)

(投資の対象とする資産の種類)

第 20 条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引（金融商品取引法第 2 条第 20 項に規定するものをいい、約款第 27 条及び第 28 条に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. (削除)

ロ. 為替手形

ハ. (削除)

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第 21 条 委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である下記の各マザーファンド受益証券のほか、

国内株式マザーファンド受益証券（以下「国内株式マザーファンド」といいます。）

外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド受益証券（以下「外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド」といいます。）

国内債券マザーファンド受益証券（以下「国内債券マザーファンド」といいます。）

外国債券マザーファンド受益証券（以下「外国債券マザーファンド」といいます。）

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 3 号で定めるものをいいます。）

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、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、ならびに会

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総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)

6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 4 号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 6 号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 7 号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 8 号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 10 号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 11 号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 18 号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 20 号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第 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表示されるべきもの
19. 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
20. 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。）
21. 抵当証券（金融商品取引法第 2 条第 1 項第 16 号で定めるものをいいます。）

なお、第 1 号の証券または証書、第 12 号ならびに第 16 号の証券または証書のうち第 1 号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第 2 号から第 6 号までの証券および第 12 号ならびに第 16 号の証券または証書のうち第 2 号から第 6 号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第 13 号および第 14 号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項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（前項に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③ 委託者は、信託財産に属する株式の時価総額と国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドに属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の 100 分の 70 以上となる投資の指図をしません。

④ 委託者は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の 100 分の 20 を超えることとなる投資の指図をしません。

⑤ 前 2 項において国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの時価総額に国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいい、国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの時価総額に国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑥ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額と国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

⑦ 前項において国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの時価総額に国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(利害関係人等との取引等)

第 21 条の 2 受託者は、受益者の保護に支障を生じることがないものであり、かつ信託業法、投資信託及び投資法人に関する法律ならびに関連法令に反しない場合には、委託者の指図により、信託財産と、受託者および受託者の利害関係人（金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にて準用する信託業法第 29 条第 2 項第 1 号に規定する利害関係人をいいます。以下本条および第 35 条において同じ。）第 35 条第 1 項に定める信託業務の委託先およびその利害関係人または受託者における他の信託財産との間で、前 2 条に掲げる資産への投資等ならびに第 26 条、第 30 条、第 33 条および第 42 条に掲げる取引その他これらに類する行為を行なうことができます。

(運用の基本方針)

第 22 条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。

(投資する株式等の範囲)

第 23 条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、第 22 条の運用の基本方針の範囲内（新株引受権証券および新株予約権証券については、第 22 条の運用の基本方針に特別の規定がない場合、株式の範囲と同じものとする。）で、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

(同一銘柄の株式への投資制限)

第 24 条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることとなる投資の指図をしません。

② 前項において国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの時価総額に国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限)

第 25 条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 5 を超えることとなる投資の指図をしません。

② 前項において国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの時価総額に国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(信用取引の指図範囲)

第 26 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号のものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(先物取引等の運用指図・目的・範囲)

第27条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等（株式、株価指数に係る先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに第21条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

② 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の時価総額と各マザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属する各マザーファンドの時価総額に各マザーファンドの信託財産純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

③ 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が 1 年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第 21 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 21 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

(スワップ取引の運用指図・目的・範囲)

第 28 条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第 4 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額と各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ 前項において各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、各マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額に各マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属する各マザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

⑤ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

⑥ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第 29 条 委託者は、信託財産に属する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の時価総額と国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産に属する当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 10 を超えることとなる投資の指図をしません。

② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの時価総額に国内株式マザーファンドおよび外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドの信託財産純資産総額に占める当該転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第 30 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

② 前項に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(外貨建資産への投資制限)

第 31 条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額と外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の 100 分の 40 を超えることとなる投資の指図をしません。

② 前項において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの時価総額に外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じ

て得た額をいいます。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 32 条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約の指図)

第 33 条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産と外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属する外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの時価総額に外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンドおよび外国債券マザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(外貨建資産の円換算および予約為替の評価)

第 34 条 信託財産に属する外貨建資産の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

② 前条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

(信託業務の委託等)

第 35 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託業務の一部について、信託業法第 22 条第 1 項に定める信託業務の委託をするときは、以下に掲げる基準のすべてに適合するもの（受託者の利害関係人を含みます。）を委託先として選定します。

1. 委託先の信用力に照らし、継続的に委託業務の遂行に懸念がないこと
2. 委託先の委託業務に係る実績等に照らし、委託業務を確実に処理する能力があると認められること
3. 委託される信託財産に属する財産と自己の固有財産その他の財産とを区分する等の管理を行なう体制が整備されていること
4. 内部管理に関する業務を適正に遂行するための体制が整備されていること

② 受託者は、前項に定める委託先の選定にあたっては、当該委託先が前項各号に掲げる基準に適合していることを確認するものとします。

③ 前 2 項にかかわらず、受託者は、次の各号に掲げる業務（裁量性のないものに限ります。）を、受託者および委託者が適当と認める者（受託者の利害関係人を含みます。）に委託することができるものとします。

1. 信託財産の保存に係る業務
2. 信託財産の性質を変えない範囲内において、その利用または改良を目的とする業務
3. 委託者のみの指図により信託財産の処分およびその他の信託の目的の達成のために必要な行為に係る業務
4. 受託者が行なう業務の遂行にとって補助的な機能を有する行為

(有価証券の保管)

第 36 条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第 37 条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（外国の法令に準拠して設立された法人で第一種金融商品取引業者に類する者を含みます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマースヤル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第 38 条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済にかかる国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 39 条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第 40 条 委託者は、信託財産に属する親投資信託の受益証券にかかる信託契約の一部解約、有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 41 条 委託者は、前条の規定による親投資信託の受益証券の一部解約金、有価証券の売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(資金の借入れ)

第 42 条 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。

② 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。

③ 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。

④ 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(損益の帰属)

第 43 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金の立替え)

第 44 条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 45 条 この信託の計算期間は、毎年 5 月 11 日から翌年 5 月 10 日までとすることを原則とします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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。

(信託財産に関する報告)

第 46 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用および監査費用)

第 47 条 信託財産に関する租税、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は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

② 信託財産に係る監査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、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

(信託報酬等の総額)

第 48 条 委託者および受託者の信託報酬の総額は、第 45 条に規定する計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年 10,000 分の 65 の率を乗じて得た額とします。

② 前項の信託報酬は、毎計算期間の最初の 6 ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとし、委託者と受託者との間の配分は別に定めます。

③ 第 1 項の信託報酬に係る消費税等に相当する金額を信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

(収益の分配方式)

第 49 条 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

1. 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、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。

2. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、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。

② 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。

(収益分配金、償還金および一部解約金の支払い)

第 50 条 収益分配金は、毎計算期間終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、毎計算期間の末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計算期間の末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、）に支払います。なお、平成 19 年 1 月 4 日以降においても、第 51 条に規定する時効前の収益分配金にかかる収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、当該収益分配金交付票と引き換えに受益者に支払います。

② 前項の規定にかかわらず、販売会社との累積投資契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者に対しては、受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌日に、収益分配金が販売会社に交付されます。この場合、販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行いません。当該売付けにより増加した受益権は、第 10 条第 3 項の規定にしたがい、振替口座簿に記載または記録されます。

③ 償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から、信託終了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（信託終了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、当該信託終了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、）に支払います。なお、当該受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して委託者がこの信託の償還をするのと引き換えに、当該償還に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。また、受益証券を保有している受益者に対しては、償還金は、信託終了日後 1 ヶ月以内の委託者の指定する日から受益証券と引き換えに当該受益者に支払います。

④ 一部解約金（第53条第3項の一部解約の価額に当該一部解約口数を乗じて得た額をいいます。以下同じ。）は、第53条第1項の受益者の請求を受け付けた日から起算して、原則として、5営業日目から当該受益者に支払います。

⑤ 前各項（第2項を除く。）に規定する収益分配金、償還金および一部解約金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

⑥ 収益分配金、償還金および一部解約金にかかる収益調整金は、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額等に応じて計算されるものとします。

(収益分配金および償還金の時効)

第51条 受益者が、収益分配金については前条第1項に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないとき、ならびに信託終了による償還金について前条第3項に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属します。

(収益分配金、償還金および一部解約金の払い込みと支払いに関する受託者の免責)

第52条 受託者は、収益分配金については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日までに、償還金については第50条第3項に規定する支払開始日までに、一部解約金については第50条第4項に規定する支払日までに、その全額を委託者の指定する預金口座等に払い込みます。

② 受託者は、前項の規定により委託者の指定する預金口座等に収益分配金、償還金および一部解約金を払い込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(信託の一部解約)

第53条 受益者（販売会社を含みます。以下本条において同じ。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位もしくは1口の整数倍となる販売会社が定める単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

② 委託者は、前項の一部解約の実行の請求を受け付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。なお、前項の一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

③ 前項の一部解約の価額は、一部解約の実行の請求日の翌営業日の基準価額から当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保額として控除した価額とします。

④ 平成19年1月4日以降の信託契約の一部解約に係る一部解約の実行の請求を受益者がするとき、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。ただし、平成19年1月4日以降に一部解約金が受益者に支払われることとなる一部解約の実行の請求で、平成19年1月4日以前に行なわれる当該請求については、振替受益権となることが確実な受益証券をもって行なうものとします。

⑤ 委託者は、金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、第1項による一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取消することができます。

⑥ 前項により、一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実

行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして第 3 項の規定に準じて計算された価額とします。

(信託契約の解約)

第 54 条 委託者は、第 4 条の規定による信託終了前に、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が 30 億口を下回った場合またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、前項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託契約の解約をしません。

⑤ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑥ 第 3 項から前項までの規定は、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、第 3 項の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第 55 条 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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第 59 条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第 56 条 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。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 59 条第 4 項の規定に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第 57 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託

契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 58 条 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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、第 59 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

② 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。

(信託約款の変更)

第 59 条 委託者は、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更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。

② 委託者は、前項の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第 60 条 第 54 条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第 54 条第 3 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、第 54 条第 2 項または前条第 2 項に規定する公告または書面に付記します。

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

第 60 条の 2 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条第 1 項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託者は、運用報告書を交付したものとみなします。

② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

(公告)

第 61 条 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/>

② 前項の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。

(質権口記載又は記録の受益権の取り扱い)

第 61 条の 2 振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第 62 条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

(付 則)

第 1 条 第 50 条第 6 項に規定する「収益調整金」は、所得税法施行令第 27 条の規定によるものとし、受益者毎の信託時の受益権の価額と元本との差額をいい、原則として、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。また、同条同項に規定する「受益者毎の信託時の受益権の価額等」とは、原則として、受益者毎の信託時の受益権の価額をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、収益分配のつど調整されるものとします。

第 2 条 平成 18 年 12 月 29 日現在の信託約款第 10 条、第 11 条、第 13 条（受益証券の種類）から第 19 条（受益証券の再交付の費用）の規定および受益権と読み替えられた受益証券に関する規定は、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には、なおその効力を有するものとします。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成 13 年 5 月 11 日

東京都江東区豊洲二丁目 2 番 1 号

委託者 野村アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目 2 番 2 号

受託者 野村信託銀行株式会社

(国内株式マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主としてわが国の株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。

② 非株式割合(株式以外の資産への投資割合)は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

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

(3) 投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への投資は行いません。

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条の範囲で行いません。

⑤ スワップ取引は約款第17条の範囲で行いません。

⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的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。

親投資信託
国内株式マザーファンド
約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第 1 条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下特段の記載があるものを除き「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第 2 条 委託者は、金 1,000 億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、金 2 兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 3 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 33 条第 1 項、第 33 条第 2 項、第 36 条第 1 項、第 37 条第 1 項および第 39 条第 2 項の規定による解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第 4 条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 2 号イに掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 4 条第 2 項第 12 号で定める適格機関投資家私募により行なわれます。

(受益者)

第 5 条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする野村アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第 6 条 委託者は、第 2 条第 1 項による受益権については、1,000 億円を上限に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 7 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 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ます。

(追加信託金の計算方法)

第 7 条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「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た金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益証券の発行および種類)

第9条 委託者は、第6条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

③ 受益者は当該受益証券を他に譲渡することはできません。

(受益証券の発行についての受託者の認証)

第10条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行ないます。

(投資の対象とする資産の種類)

第11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ります。）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. デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第16条及び第17条に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. （削除）

ロ. 為替手形

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第12条 委託者は、信託金を、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. 株券、新株の引受権を表示する証券もしくは証書または新株予約権証券

2. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

3. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の証券の性質を有するもの

4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの

5. 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

6. 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1号の証券または証書を以下「株式」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項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（前項に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第 2 条第 2 項第 1 号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(運用の基本方針)

第 13 条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。なお、この信託約款において、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以下「金融商品取引所」といい、また、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以下「証券取引所」という場合があります。

(投資する株式の範囲)

第 14 条 委託者が投資することを指図する株式は、わが国の金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

(信用取引の指図範囲)

第 15 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（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、ならびに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（総称して「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号のものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(先物取引等の運用指図・目的・範囲)

第16条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所ならびに外国の金融商品取引所における邦貨建の株式、株価指数に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入貸付債権信託受益権および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等（株式、株価指数に係る先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

② 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利に係るこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(スワップ取引の運用指図・目的・範囲)

第17条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純

資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

⑤ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第 18 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

② 前項に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③ 委託者は、株式の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(有価証券の保管)

第 19 条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第 20 条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および外国の法令に準拠して設立された法人で第一種金融商品取引業者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 21 条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第22条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第23条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(損益の帰属)

第24条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第25条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前2項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第26条 この信託の計算期間は、毎年5月11日から翌年5月10日までとすることを原則とします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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、第3条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第27条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第28条 信託財産に関する租税、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は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬)

第29条 委託者および受託者は、この信託契約に関して信託報酬を収受しません。

(利益の留保)

第30条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、中には分配を行ないません。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第31条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

(信託の一部解約)

第 32 条 委託者は受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

② 解約金は、一部解約を行なう日の前営業日の基準価額に、当該解約にかかる受益権の口数を乗じた金額とします。

(信託契約の解約)

第 33 条 委託者は、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、対象インデックスが改廃の場合またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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。

③ 委託者は、前 2 項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託契約の解約をしません。

⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑦ 第 4 項から前項までの規定は、第 2 項の規定に基づいてこの信託を解約する場合には適用しません。

(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第 34 条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金の支払いの時期)

第 35 条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに、当該償還金を受益者に支払います。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第 36 条 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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第 40 条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第37条 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。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第40条第4項の規定に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第38条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第39条 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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、第40条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

② 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。

(信託約款の変更)

第40条 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ができるものとし、あらかじめ、変更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。

② 委託者は、前項の事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第41条 第33条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第33条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、第33条第3項または前条第2項に規定する公告または書面に付記します。

(利益相反のおそれがある場合の受益者への書面の交付)

第42条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第1項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第43条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

(公告)

第44条 委託者が行なう公告は、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/>

② 前項の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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第45条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成13年5月11日

東京都江東区豊洲二丁目2番1号
委託者 野村アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目2番2号
受託者 野村信託銀行株式会社

(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いません。

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

(3) 投資制限

① 株式への投資割合には制限を設けません。

② 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

④ 有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

⑤ スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

⑥ 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

⑦ 同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

⑩ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的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。

親投資信託
外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド
約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第 1 条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下特段の記載があるものを除き「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第 2 条 委託者は、金 100 億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、金 3 兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 3 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 40 条第 1 項、第 40 条第 2 項、第 43 条、第 44 条第 1 項および第 46 条第 2 項の規定による解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第 4 条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 2 号イに掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 4 条第 2 項第 12 号で定める適格機関投資家私募により行なわれます。

(受益者)

第 5 条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする野村アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第 6 条 委託者は、第 2 条第 1 項による受益権については 100 億口を上限に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 7 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 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ます。

(追加信託金の計算方法)

第 7 条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「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た金額をいいます。

(信託日時の異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益証券の発行および種類)

第9条 委託者は、第6条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

- ② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。
- ③ 受益者は当該受益証券を他に譲渡することはできません。

(受益証券の発行についての受託者の認証)

第10条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

- ② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行ないます。

(投資の対象とする資産の種類)

第11条 この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第17条及び第18条に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. （削除）

ロ. 為替手形

ハ. （削除）

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第12条 委託者は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、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、ならびに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総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定め

るものをいいます。)

8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)

9. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)

16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)

17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

18. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの

19. 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

20. 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。)

21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第16号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第13号および第14号の証券を以下「投資信託証券」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項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（前項に掲げるものを除く。)

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

③ 委託者は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

④ 委託者は、信託財産に属する投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を

超えることとなる投資の指図をしません。

(運用の基本方針)

第13条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。なお、この信託約款において、金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を以下「金融商品取引所」といい、また、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以下「証券取引所」という場合があります。

(投資する株式等の範囲)

第14条 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、第13条の運用の基本方針の範囲内（新株引受権証券および新株予約権証券については、第13条の運用の基本方針に特別の規定がない場合、株式の範囲と同じものとする。）で、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

② 前項の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

(同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限)

第15条 委託者は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(信用取引の指図範囲)

第16条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

② 前項の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号のものを除きます。）の行使により取得可能な株券

(先物取引等の運用指図・目的・範囲)

第17条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の

金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等（株式、株価指数に係る先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

② 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

③ 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(スワップ取引の運用指図・目的・範囲)

第18条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

⑤ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(同一銘柄の転換社債等への投資制限)

第19条 委託者は、信託財産に属する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の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第20条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社

債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

② 前項に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③ 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第21条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約の指図)

第22条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(外貨建資産の円換算および予約為替の評価)

第23条 信託財産に属する外貨建資産の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

② 前条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

(保管業務の委任)

第24条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

(有価証券の保管)

第25条 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第26条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および外国の法令に準拠して設立された法人で第一種金融商品取引業者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第27条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済にかかる国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第28条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をす

ることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第 29 条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 30 条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(損益の帰属)

第 31 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第 32 条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 33 条 この信託の計算期間は、毎年 4 月 1 日から翌年 3 月 31 日までとすることを原則とします。ただし、第 1 計算期間は平成 14 年 2 月 22 日から平成 15 年 3 月 31 日までとします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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、第 3 条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第 34 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第 35 条 信託財産に関する租税、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は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬)

第 36 条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

(利益の留保)

第 37 条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、期中には分配を行ないません。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第 38 条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託金にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

(信託の一部解約)

第 39 条 委託者は受益者の請求があつた場合には、信託の一部を解約します。

② 解約金は、一部解約を行なう日の前営業日の基準価額に、当該解約にかかる受益権の口数を乗じた金額とします。

(信託契約の解約)

第 40 条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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。

③ 委託者は、前 2 項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託契約の解約をしません。

⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑦ 第 4 項から前項までの規定は、第 2 項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第 41 条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、そ

の責に任じません。

(償還金の支払いの時期)

第42条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに、当該償還金を受益者に支払います。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第43条 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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第47条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第44条 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。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第47条第4項の規定に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第45条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第46条 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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、第47条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

② 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。

(信託約款の変更)

第47条 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ができるものとし、あらかじめ、変更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。

② 委託者は、前項の事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第 48 条 第 40 条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第 40 条第 4 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、第 40 条第 3 項または前条第 2 項に規定する公告または書面に付記します。

(利益相反のおそれがある場合の受益者への書面の交付)

第 49 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 13 条第 1 項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第 50 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条に定める運用報告書を交付しません。

(公告)

第 51 条 委託者が行なう公告は、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/>

② 前項の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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第 52 条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成 14 年 2 月 22 日

東京都江東区豊洲二丁目 2 番 1 号
委託者 野村アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目 2 番 2 号
受託者 野村信託銀行株式会社

(国内債券マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

① 主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指します。

② 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

① 外貨建資産への投資は行いません。

② 有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行いません。

③ スワップ取引は約款第15条の範囲で行いません。

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

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。

親投資信託
国内債券マザーファンド
約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第 1 条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下特段の記載があるものを除き「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第 2 条 委託者は、金 1,000 億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、金 1 兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、あらかじめ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 3 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 32 条第 1 項、第 32 条第 2 項、第 35 条第 1 項、第 36 条第 1 項および第 38 条第 2 項の規定による解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第 4 条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 2 号イに掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 4 条第 2 項第 12 号で定める適格機関投資家私募により行なわれます。

(受益者)

第 5 条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする野村アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第 6 条 委託者は、第 2 条第 1 項による受益権については、1,000 億円を上限に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 7 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 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ます。

(追加信託金の計算方法)

第 7 条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「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た金額をいいます。

(信託日時異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益証券の発行および種類)

第9条 委託者は、第6条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

③ 受益者は当該受益証券を他に譲渡することはできません。

(受益証券の発行についての受託者の認証)

第10条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行ないます。

(投資の対象とする資産の種類)

第11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、かつ、株式、出資証券、投資証券およびその他の資産でこれらの性質を有するものを除きます。）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. デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条及び第15条に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. (削除)

ロ. 為替手形

ハ. (削除)

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第12条 委託者は、信託金を、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. 国債証券

2. 地方債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. 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を除きます。新株予約権付社債券については、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、ならびに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（総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）に限ります。）

5. コマーシャル・ペーパー
6. 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前各号の証券の性質を有するもの
7. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの(投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第13条第2号イ(3)に定めるものに限る)
8. 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
9. 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。)
10. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

なお、第1号から第4号までの証券および第6号の証券のうち第1号から第4号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項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(前項に掲げるものを除く。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(運用の基本方針)

第13条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行いません。なお、この信託約款において、金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を以下「金融商品取引所」といい、また、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以下「証券取引所」という場合があります。

(先物取引等の運用指図・目的・範囲)

第14条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券

の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

② 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利に係るこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

(スワップ取引の運用指図・目的・範囲)

第15条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用および価格変動リスクを回避するため、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第3条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

⑤ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第 16 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

② 前項に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③ 委託者は、公社債の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(保管業務の委任)

第 17 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することができます。

(有価証券の保管)

第 17 条の 2 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第 18 条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および外国の法令に準拠して設立された法人で第一種金融商品取引業者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行されたコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第 19 条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済にかかる国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 20 条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第 21 条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 22 条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(損益の帰属)

第 23 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第 24 条 信託財産に属する有価証券について、借替がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、有価証券等に係る利子等およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 25 条 この信託の計算期間は、毎年 5 月 11 日から翌年 5 月 10 日までとすることを原則とします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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、第 3 条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第 26 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第 27 条 信託財産に関する租税、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は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬)

第 28 条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

(利益の留保)

第 29 条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、期中には分配を行ないません。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第 30 条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託金にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

(信託の一部解約)

第 31 条 委託者は受益者の請求があった場合には、信託の一部を解約します。

② 解約金は、一部解約を行なう日の前営業日の基準価額に、当該解約にかかる受益権の口数を乗じた金額とします。

(信託契約の解約)

第 32 条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。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。

③ 委託者は、前 2 項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託契約の解約をしません。

⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑦ 第 4 項から前項までの規定は、第 2 項の規定に基づいてこの信託を解約する場合には適用しません。

(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第 33 条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金の支払いの時期)

第 34 条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに、当該償還金を受益者に支払います。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第 35 条 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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第 39 条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第36条 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。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第39条第4項の規定に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第37条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第38条 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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、第39条の規定にしたがい、委託者は新受託者を選任します。

② 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。

(信託約款の変更)

第39条 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ができるものとし、あらかじめ、変更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。

② 委託者は、前項の事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第1項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第40条 第32条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第32条第4項または前条第3項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、第32条第3項または前条第2項に規定する公告または書面に付記します。

(利益相反のおそれがある場合の受益者への書面の交付)

第41条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第13条第1項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第42条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

(公告)

第43条 委託者が行なう公告は、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/>

② 前項の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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第44条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成13年5月11日

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

委託者 野村アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目2番2号

受託者 野村信託銀行株式会社

(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。

親投資信託
外国債券マザーファンド
約款

(信託の種類、委託者および受託者)

第 1 条 この信託は、その受益権を他の投資信託の受託者に取得させることを目的とする証券投資信託であり、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ます。

② この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正 11 年法律第 62 号）（以下特段の記載があるものを除き「信託法」といいます。）の適用を受けます。

(信託の目的、金額および追加信託の限度額)

第 2 条 委託者は、金 1,000 億円を上限として受益者のために利殖の目的をもって信託し、受託者はこれを引き受けます。

② 委託者は、受託者と合意のうえ、金 3 兆円を限度として信託金を追加できるものとし、追加信託を行なったときは、受託者はその引き受けを証する書面を委託者に交付します。

③ 委託者は、受託者と合意のうえ、前項の限度額を変更することができます。

(信託期間)

第 3 条 この信託の期間は、信託契約締結日から第 35 条第 1 項、第 35 条第 2 項、第 38 条、第 39 条第 1 項および第 41 条第 2 項の規定による解約の日までとします。

(受益証券の取得申込みの勧誘の種類)

第 4 条 この信託にかかる受益証券の取得申込みの勧誘は、金融商品取引法第 2 条第 3 項第 2 号イに掲げる場合に該当し、投資信託及び投資法人に関する法律第 4 条第 2 項第 12 号で定める適格機関投資家私募により行なわれます。

(受益者)

第 5 条 この信託の元本および収益の受益者は、この信託の受益証券を投資対象とする野村アセットマネジメント株式会社の証券投資信託の受託者である信託業務を営む銀行とします。

(受益権の分割および再分割)

第 6 条 委託者は、第 2 条第 1 項による受益権については 1,000 億口を上限に、追加信託によって生じた受益権については、これを追加信託のつど第 7 条第 1 項の追加口数に、それぞれ均等に分割します。

② 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ます。

(追加信託金の計算方法)

第 7 条 追加信託金は、追加信託を行なう日の前営業日の基準価額に、当該追加にかかる受益権の口数を乗じた額とします。

② この約款において基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「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た金額をいいます。

(信託日時異なる受益権の内容)

第8条 この信託の受益権は、信託の日時を異にすることにより差異を生ずることはありません。

(受益証券の発行および種類)

第9条 委託者は、第6条の規定により分割された受益権を表示する記名式の受益証券を発行します。

② 委託者が発行する受益証券は、1口の整数倍の口数を表示した受益証券とします。

③ 受益者は当該受益証券を他に譲渡することはできません。

(受益証券の発行についての受託者の認証)

第10条 委託者は、前条第1項により受益証券を発行するときは、その発行する受益証券がこの信託約款に適合する旨の受託者の認証を受けなければなりません。

② 前項の認証は、受託者の代表取締役がその旨を受益証券に記載し記名捺印することによって行ないます。

(投資の対象とする資産の種類)

第11条 この信託において投資の対象とする資産（株式、出資証券、投資証券およびその他の資産でこれらの性質を有するものを除きます。）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. デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条及び第15条に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ. 約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ. 金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. （削除）

ロ. 為替手形

(有価証券および金融商品の指図範囲等)

第12条 委託者は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 国債証券

2. 地方債証券

3. 特別の法律により法人の発行する債券

4. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

5. コマーシャル・ペーパー

6. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券の性質を有するもの

7. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

8. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

9. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの（投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第13条第2号イ（3）に定

めるものに限る)

10. 外国の者に対する権利で前号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

11. 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1号から第4号までの証券および第6号の証券のうち第1号から第4号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

② 委託者は、信託金を、前項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（前項に掲げるものを除く。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(運用の基本方針)

第13条 委託者は、信託財産の運用にあたっては、別に定める運用の基本方針にしたがって、その指図を行ないます。なお、この信託約款において、金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場を以下「金融商品取引所」といい、また、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以下「証券取引所」という場合があります。

(先物取引等の運用指図・目的・範囲)

第14条 委託者は、信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第12条第2項第1号から第4号に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

② 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

③ 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が 1 年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに第 12 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等ならびに第 12 条第 2 項第 1 号から第 4 号に掲げる金融商品で運用している額（以下本号において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券に係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の 5%を上回らない範囲内とし、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の 5%を上回らない範囲内とします。

(スワップ取引の運用指図・目的・範囲)

第 15 条 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすること

とができます。

② スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として第 3 条に定める信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

③ スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

④ スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

⑤ 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(有価証券の貸付の指図および範囲)

第 16 条 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

② 前項に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

③ 委託者は、公社債の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

(特別の場合の外貨建有価証券への投資制限)

第 17 条 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(外国為替予約の指図)

第 18 条 委託者は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

② 委託者は、外国為替の売買の予約取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(外貨建資産の円換算および予約為替の評価)

第 19 条 信託財産に属する外貨建資産の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。

② 前条に規定する予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算します。

(保管業務の委任)

第 20 条 受託者は、委託者と協議のうえ、信託財産に属する資産を外国で保管する場合には、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる金融機関と保管契約を締結し、これを委任することが

できます。

(有価証券の保管)

第 20 条の 2 受託者は、信託財産に属する有価証券を、法令等に基づき、保管振替機関等に預託し保管させることができます。

(混蔵寄託)

第 21 条 金融機関または第一種金融商品取引業者等（第一種金融商品取引業者（金融商品取引法第 28 条第 1 項に規定する第一種金融商品取引業を行なう者をいいます。以下同じ。）および外国の法令に準拠して設立された法人で第一種金融商品取引業者に類する者をいいます。以下本条において同じ。）から、売買代金および償還金等について円貨で約定し円貨で決済する取引により取得した外国において発行された譲渡性預金証書またはコマーシャル・ペーパーは、当該金融機関または第一種金融商品取引業者等が保管契約を締結した保管機関に当該金融機関または第一種金融商品取引業者等の名義で混蔵寄託できるものとします。

(一括登録)

第 22 条 信託財産に属する国債証券のうち振替決済にかかる国債証券については、日本銀行で保管することがあります。この場合、日本銀行においては日本銀行名義で一括登録することがあります。

(信託財産の登記等および記載等の留保等)

第 23 条 信託の登記または登録をすることができる信託財産については、信託の登記または登録をすることとします。ただし、受託者が認める場合は、信託の登記または登録を留保することがあります。

② 前項ただし書きにかかわらず、受益者保護のために委託者または受託者が必要と認めるときは、速やかに登記または登録をするものとします。

③ 信託財産に属する旨の記載または記録をすることができる信託財産については、信託財産に属する旨の記載または記録をするとともに、その計算を明らかにする方法により分別して管理するものとします。ただし、受託者が認める場合は、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

④ 動産（金銭を除きます。）については、外形上区別することができる方法によるほか、その計算を明らかにする方法により分別して管理することがあります。

(有価証券売却等の指図)

第 24 条 委託者は、信託財産に属する有価証券の売却等の指図ができます。

(再投資の指図)

第 25 条 委託者は、前条の規定による売却代金、有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式の配当金およびその他の収入金を再投資することの指図ができます。

(損益の帰属)

第 26 条 委託者の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

(受託者による資金立替え)

第 27 条 信託財産に属する有価証券について、借替、転換、新株発行または株式割当がある場合で、委託者の申出があるときは、受託者は資金の立替えをすることができます。

② 信託財産に属する有価証券に係る償還金等、株式の清算分配金、有価証券等に係る利子等、株式

の配当金およびその他の未収入金で、信託終了日までにその金額を見積りうるものがあるときは、受託者がこれを立替えて信託財産に繰り入れることができます。

③ 前 2 項の立替金の決済および利息については、受託者と委託者との協議によりそのつど別にこれを定めます。

(信託の計算期間)

第 28 条 この信託の計算期間は、毎年 5 月 11 日から翌年 5 月 10 日までとすることを原則とします。

② 前項にかかわらず、前項の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下本項において「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、第 3 条に定める信託期間の終了日とします。

(信託財産に関する報告)

第 29 条 受託者は、毎計算期末に損益計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

② 受託者は、信託終了のときに最終計算を行ない、信託財産に関する報告書を作成して、これを委託者に提出します。

(信託事務の諸費用)

第 30 条 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、第 16 条に規定する有価証券の貸付に係る事務の処理を第三者に委託した場合に要する費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

(信託報酬)

第 31 条 委託者および受託者は、この信託契約に関し信託報酬を収受しません。

(利益の留保)

第 32 条 信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、中には分配を行ないません。

(追加信託金および一部解約金の計理処理)

第 33 条 追加信託金または信託の一部解約金は、当該金額と元本に相当する金額との差額を、追加信託金にあつては追加信託差金、信託の一部解約にあつては解約差金として処理します。

(信託の一部解約)

第 34 条 委託者は受益者の請求があつた場合には、信託の一部を解約します。

② 解約金は、一部解約を行なう日の前営業日の基準価額に、当該解約にかかる受益権の口数を乗じた金額とします。

(信託契約の解約)

第 35 条 委託者は、信託期間中において、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

② 委託者は、この信託の受益証券を投資対象とすることを信託約款において定めるすべての証券投資信託がその信託を終了させることとなる場合には、この信託契約を解約し、信託を終了させます。

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。

③ 委託者は、前 2 項の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

④ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

⑤ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託契約の解約をしません。

⑥ 委託者は、この信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

⑦ 第 4 項から前項までの規定は、第 2 項の規定に基づいてこの信託契約を解約する場合には適用しません。

(償還金の委託者への交付と支払いに関する受託者の免責)

第 36 条 受託者は、信託が終了したときは、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）の全額を委託者に交付します。

② 受託者は、前項の規定により委託者に償還金を交付した後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

(償還金の支払いの時期)

第 37 条 委託者は、受託者より償還金の交付を受けた後、受益証券と引換えに、当該償還金を受益者に支払います。

(信託契約に関する監督官庁の命令)

第 38 条 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。

② 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、第 42 条の規定にしたがいます。

(委託者の登録取消等に伴う取扱い)

第 39 条 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。

② 前項の規定にかかわらず、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、第 42 条第 4 項の規定に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(委託者の事業の譲渡および承継に伴う取扱い)

第 40 条 委託者は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。

② 委託者は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴ない、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

(受託者の辞任および解任に伴う取扱い)

第 41 条 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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。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、第 42 条の規定にしたがい、新受託者を選任します。

② 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。

(信託約款の変更)

第 42 条 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ができるものとし、あらかじめ、変更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。

② 委託者は、前項の事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

③ 前項の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

④ 前項の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、第 1 項の信託約款の変更をしません。

⑤ 委託者は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

(反対者の買取請求権)

第 43 条 第 35 条に規定する信託契約の解約または前条に規定する信託約款の変更を行う場合において、第 35 条第 4 項または前条第 3 項の一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己の有する受益証券を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、第 35 条第 3 項または前条第 2 項に規定する公告または書面に付記します。

(利益相反のおそれがある場合の受益者への書面の交付)

第 44 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 13 条第 1 項に定める書面を交付しません。

(運用報告書)

第 45 条 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第 14 条に定める運用報告書を交付しません。

(公告)

第 46 条 委託者が行なう公告は、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/>

② 前項の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。

(信託約款に関する疑義の取扱い)

第 47 条 この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託者と受託者との協議により定めます。

上記条項により信託契約を締結します。

信託契約締結日 平成 13 年 5 月 11 日

東京都江東区豊洲二丁目 2 番 1 号
委託者 野村アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目 2 番 2 号
受託者 野村信託銀行株式会社